

هدف الصندوق

إن صندوق التداول المعزز بالخوارزميات للأسهم السعودية فئة ب هو صندوق أسهم مفتوح يهدف لتحقيق نمو على المدى المتوسط إلى الطويل يفوق المؤشر الاستراتيجي عن طريق الاستثمار في الأسهم المدرجة في سوق الأسهم السعودي والمتوافقة مع الشريعة الإسلامية.

بيانات الصندوق

2025/12/18	تاريخ بدء الصندوق
10 ريال سعودي	سعر الوحدة عند الطرح
12,139,032.06 ريال سعودي	حجم الصندوق (بالمليون)
صندوق مفتوح متوافق مع أحكام الشريعة الإسلامية.	نوع الصندوق
ريال سعودي	عملة الصندوق
مرتفعة	مستوى المخاطر
S&P Saudi Arabia Shariah Domestic Total Return Index	المؤشر الاستراتيجي
لا يوجد	عدد مرات التوزيع
1.75% في السنة - من صافي المستثمر بها	نسبة رسوم الإدارة للصناديق
لا يوجد	مستشار الاستثمار ومدير الصندوق من الباطن
لا يوجد	عدد أيام المتوسط المرجح

بيانات ملكية استثمارات الصندوق

100%	ملكية تامة
لا يوجد	حق منفعة

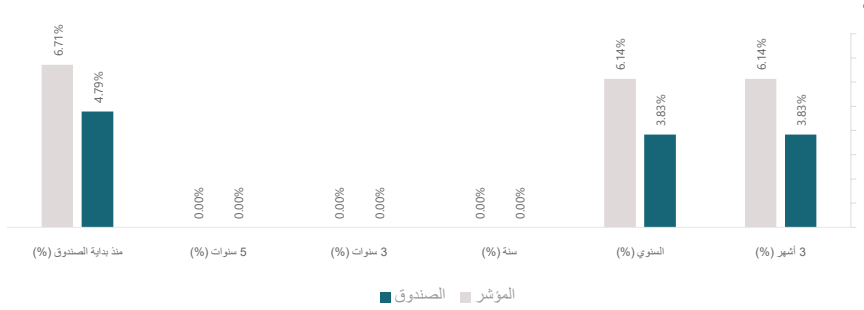
تعريفات ومعادلات

$\sigma = \sqrt{\frac{\sum (R_i - \bar{R})^2}{N-1}}$	الانحراف المعياري	يقيس مدى تشتت العوائد بالنسبة لمتوسطها، مما يعكس درجة تقلب العوائد
$SR = \frac{R_p - R_f}{\sigma_p}$	مؤشر شارب	مقياس أداء معدل بالمخاطر يوضح مقدار العائد الإضافي للصندوق فوق معدل العائد الخالي من المخاطر، مقارنة بتقلبات الصندوق
$TE = \sqrt{\frac{\sum (R_{p,i} - R_{b,i})^2}{N-1}}$	خطأ التتبع	هو الفرق بين عوائد الصندوق وعوائد المؤشر المعياري
$\beta = \frac{Cov(R_p, R_b)}{Var(R_b)}$	بيتا	مقياس تذبذب الصندوق مقارنة بالمؤشر المعياري
$\alpha = R_p - [R_f + \beta(R_b - R_f)]$	ألفا	تمثل العائد الإضافي للصندوق مقارنة بالمؤشر المعياري، مما يعكس القيمة المضافة من الإدارة النشطة
$IR = \frac{R_p - R_b}{TE}$	مؤشر المعلومات	مقياس معدل بالمخاطر يقارن العوائد النشطة للصندوق بالنسبة إلى عوائد المؤشر المعياري، مقارنة بتقلبات تلك العوائد

حيث:

Rp	أداء الصندوق
Rb	أداء مؤشر القياس
Rf	معدل الخلو من المخاطر
σp	الانحراف المعياري لعوائد الصندوق
TE	خطأ التتبع
N	عدد العينات

الأداء	3 أشهر (%)	السنتي (%)	سنة (%)	3 سنوات (%)	5 سنوات (%)	منذ بداية الصندوق (%)
أداء الصندوق	3.83	3.83	لا يوجد	لا يوجد	لا يوجد	4.79
أداء المؤشر الاستراتيجي	6.14	6.14	لا يوجد	لا يوجد	لا يوجد	6.71
فارق الأداء	-2.32	-2.32	لا يوجد	لا يوجد	لا يوجد	-1.93



معايير الأداء و المخاطر	3 أشهر	السنتي	سنة	3 سنوات	5 سنوات
الانحراف المعياري	16.09%	16.09%	لا يوجد	لا يوجد	لا يوجد
مؤشر شارب	0.72	0.72	لا يوجد	لا يوجد	لا يوجد
خطأ التتبع	7.74%	7.74%	لا يوجد	لا يوجد	لا يوجد
بيتا	0.86	0.86	لا يوجد	لا يوجد	لا يوجد
ألفا	-0.06%	-0.06%	لا يوجد	لا يوجد	لا يوجد
مؤشر المعلومات	(1.41)	(1.41)	لا يوجد	لا يوجد	لا يوجد

معلومات الأسعار

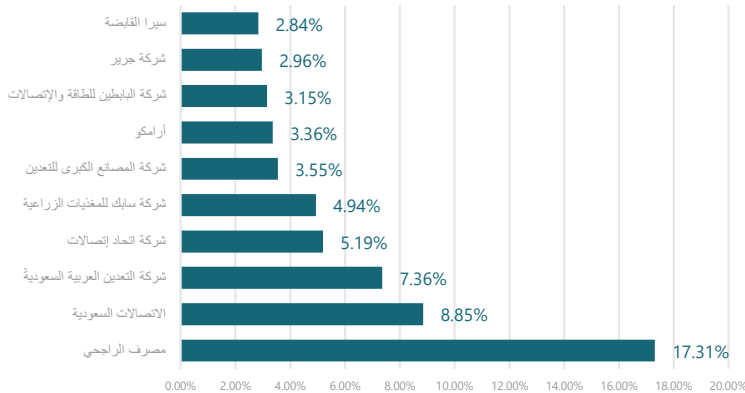
10.4787 ريال سعودي	سعر الوحدة
3.83%	التغير في سعر الوحدة (مقارنة بالربع السابق)
لا يوجد	سعر الوحدة المزدوج لصناديق أسواق النقد، وصناديق أدوات الدين ذات الدخل الثابت
1,158,446.75	أجمالي وحدات الصندوق
12,139,032.06 ريال سعودي	إجمالي صافي الأصول
41.97	مكرر الربحية (P/E)

معلومات الصندوق

2.98%	نسبة الأتعاب الإجمالية من متوسط صافي الأصول (%)
93,819.10	قيمة الأتعاب الإجمالية
0.00	قيمة الاقتراض
0.00%	نسبة الاقتراض من القيمة الإجمالية لأصول الصندوق (%)
18,162.81 ريال سعودي	مصاريف التعامل
0.58%	نسبة مصاريف التعامل من متوسط صافي الأصول (%)
0.00	مبلغ استثمارات مدير الصندوق من صافي الأصول
0.00%	نسبة استثمارات مدير الصندوق من صافي الأصول (%)
لا يوجد	إجمالي الأرباح الموزعة في الربع المعني
لا يوجد	عدد الوحدات القائمة التي تم التوزيع لها خلال الربع المعني
لا يوجد	قيمة الربح الموزع لكل وحدة خلال الربع المعني
لا يوجد	نسبة التوزيع من صافي قيمة أصول الصندوق
لا يوجد	أحقية التوزيعات النقدية التي تم توزيعها خلال الربع المعني

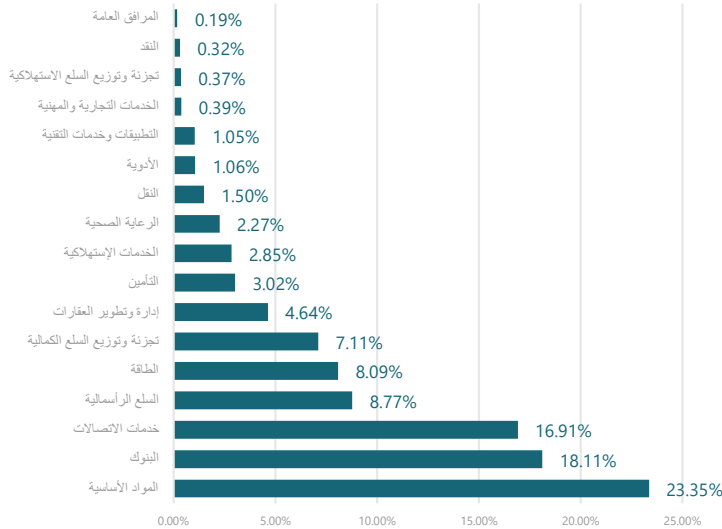
Public

أكبر 10 استثمارات للصندوق



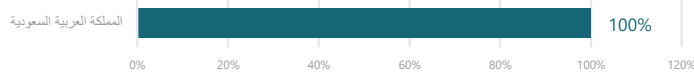
أكبر 10 استثمارات للصندوق	%
مصرف الراجحي	17.31%
الاتصالات السعودية	8.85%
شركة التعدين العربية السعودية	7.36%
شركة اتحاد اتصالات	5.19%
شركة سابك للمغذيات الزراعية	4.94%
شركة المصانع الكبرى للتعبئة	3.55%
أرامكو	3.36%
شركة البابطين للطاقة والاتصالات	3.15%
شركة جريير	2.96%
سيراف القابضة	2.84%

توزيع القطاعات



توزيع القطاعات	%
المواد الأساسية	23.35%
البنوك	18.11%
خدمات الاتصالات	16.91%
السلع الرأسمالية	8.77%
الطاقة	8.09%
تجزئة وتوزيع السلع الكمالية	7.11%
إدارة وتطوير العقارات	4.64%
التأمين	3.02%
الخدمات الاستهلاكية	2.85%
الرعاية الصحية	2.27%
النقل	1.50%
الأدوية	1.06%
التطبيقات وخدمات التقنية	1.05%
الخدمات التجارية والمهنية	0.39%
تجزئة وتوزيع السلع الاستهلاكية	0.37%
النقد	0.32%
المرافق العامة	0.19%

التوزيع الجغرافي



التوزيع الجغرافي	%
المملكة العربية السعودية	100%

بيانات الاتصال

رقم الهاتف	8001243232
الموقع الإلكتروني	https://bsfcapital.sa/
البريد الإلكتروني	complaints@bsfcapital.sa

إخلاء مسؤولية

الأداء الموضح في التقرير ليس مؤشراً ولا ضماناً للعوائد المستقبلية حيث أن قيمة الوحدات عرضة لتقلبات الأسعار لذا يمكن أن ترتفع قيمة الوحدات؛ ننصح المستثمرون بالنظر في أوضاعهم الفردية والمالية ومدى ملائمة المنتج لأهدافهم الاستثمارية والحصول على المشورة من الخبراء المختصين في مجالات الاستثمار.
* أكبر عشر إستثمارات للصندوق وقطاعات الصندوق هي كما في بداية الربع المعني.