

صندوق المبارك للصكوك السيادية السعودية

البيان الربع سنوي
مارس ٢٠٢٢

أ. هدف الصندوق

يهدف الصندوق إلى تنمية رأس المال على المدى الطويل من خلال الاستثمار في الصكوك السيادية المدرجة المقومة بالريال السعودي الصادرة عن الجهات الحكومية في المملكة العربية السعودية بالإضافة لأدوات أسواق النقد مثل معاملات المراجعة والاجارة المتوافقة مع المعايير الشرعية للصندوق.

ب. بيانات الصندوق

١. تاريخ بدء الصندوق	٢٠٢٠/٠١/٠٥
٢. سعر الوحدة عند الطرح	١٠ ريالاً سعودية
٣. حجم الصندوق	81,884,774.40
٤. نوع الصندوق	صندوق مفتوح
٥. عملة الصندوق	الريال السعودي
٦. مستوى المخاطر	مخاطر منخفضة
٧. المؤشر الاسترشادي	مؤشر سايبور ٣ أشهر
٨. عدد مرات التوزيع	لا ينطبق
٩. نسبة رسوم الإدارة للصناديق المستثمر فيها	لا يوجد
١٠. مستشار الاستثمار ومدير الصندوق من الباطن	لا ينطبق
١١. عدد أيام المتوسط المرجح	لا ينطبق

ج. تعريفات

١- الانحراف المعياري	المقياس الأساسي لمعدل المخاطرة. وهو يقيس مقدار التذبذب في السعر أو العائد حول المتوسط عبر فترة من الزمن. وبصفة عامة كلما كان أصغر كانت المخاطرة أقل
٢- مؤشر شارب	نسبة تقيس متوسط العائد الذي يتم الحصول عليه بما يزيد عن المعدل الخالي من المخاطر. نسبة شارب = (متوسط عائد المحفظة - معدل العائد الخالي من المخاطر) / الانحراف المعياري لعائد المحفظة
٣- خطأ التتبع	يعطي خطأ التتبع دليلاً على تقلب العوائد من خلال قياس اتساق فرق تتبع المحفظة بمرور الوقت، ويتم حسابه باستخدام الانحراف المعياري السنوي للفرق في المحفظة والعوائد المعيارية
٤- بيتا	قياس لمدى حساسية الصندوق للحركة في سوقه أو مؤشره الإرشادي
٥- ألفا	هو الفارق بين العائد الفعلي للصندوق والعائد المتوقع له بناء على نسبة المخاطرة التي يتحملها (بالمقارنة مع مخاطرة سوقه ككل، والتي نحسبها بمعامل (بيتا)).
٦- مؤشر المعلومات	مؤشر يستخدم لتقييم أداء مدير الصندوق لفترة معينة ويقاس قدرة مدير الصندوق في تحقيق أداء أفضل من السوق أو من المؤشر الإشرادي

د. بيانات الاتصال

١. رقم الهاتف: ٨٠٠١٢٤٠٠٥٥
٢. الموقع الإلكتروني: www.anbinvest.com.sa
٣. البريد الإلكتروني: info@anbinvest.com.sa

و. معلومات الأسعار كما في نهاية الربع الأول - مارس ٢٠٢٢

١. سعر الوحدة كما في نهاية الربع الأول	9.4890
٢. التغير في سعر الوحدة مقارنة بالربع السابق	-٣,٦٥%
٣. سعر الوحدة المزدوج لصناديق أسواق النقد	9.4871
٤. إجمالي وحدات الصندوق	8,629,167.24
٥. إجمالي صافي الأصول	81,882,402.45
٦. مكرر الربحية	لا ينطبق

ز. معلومات الصندوق كما في نهاية الربع الأول

البند	القيمة	%
١. نسبة الأتعاب الإجمالية	73,963.11	٠,٠٩
٢. نسبة الاقتراض	٠	٠
٣. مصاريف التعامل	1,171.95	٠,٠٠١
٤. استثمار مدير الصندوق	٠	٠
٥. الأرباح الموزعة	لا ينطبق	لا ينطبق

ح. بيانات ملكية استثمار الصندوق

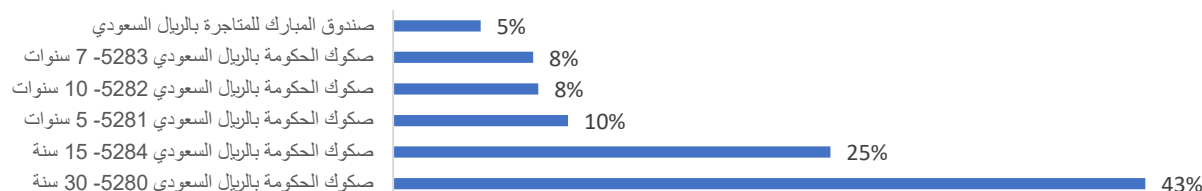
ملكية تامة	١٠٠%
------------	------

حق منفعة	%٠
----------	----

ط. إخلاء مسؤولية

لا يعتبر الأداء في الماضي دليلاً لسير الأداء في المستقبل، إذ أن أسعار الوحدات قابلة للتغيير وليست مضمونة

ي. رسم بياني يوضح أكبر استثمارات الصندوق:



ك. رسم بياني يوضح توزيع أصول الصندوق (قطاعي/جغرافي):



البند	٣ أشهر	سنة حتى تاريخه	سنة واحدة	٣ سنوات	٥ سنوات
أداء الصندوق	-3.65	-3.65	-4.32	-	-
أداء المؤشر الاسترشادي	0.34	0.34	0.96	-	-
فارق الأداء	-3.99	-3.99	-5.28	-	-

معايير الأداء والمخاطر	٣ أشهر	سنة حتى تاريخه	سنة واحدة	٣ سنوات	٥ سنوات
١. الانحراف المعياري	5.98	5.98	4.04	-	-
٢. مؤشر شارب	-2.64	-2.64	-1.31	-	-
٣. خطأ التتبع	5.97	5.97	4.09	-	-
٤. بيتا	11.94	11.94	-18.16	-	-
٥. ألفا	-3.99	-3.99	-5.28	-	-
٦. مؤشر المعلومات	-2.63	-2.63	-1.29	-	-

ن. رسم بياني يوضح الأداء منذ بداية الصندوق:

