

أهداف الصندوق :

صندوق استثماري مفتوح متخصص يهدف إلى تنمية رأس مال المستثمرين على المدى الطويل من خلال الاستثمار في أسهم الشركات السعودية المدرجة في مؤشر تاسي.

معلومات الصندوق بنهاية الربع الأول 2026م :

17.73	سعر الوحدة في نهاية الربع
1.18%	التغير في سعر الوحدة مقارنة بالربع السابق
263,801	إجمالي عدد الوحدات
4,676,302	صافي قيمة الأصول
20.00	مكرر الربحية (P/E)
62,014	إجمالي المصروفات
1.33%	نسبة المصروفات الإجمالية
0.00	نسبة الاقتراض
5,414	مصاريف التداول
0.12%	نسبة مصاريف التداول
0.00	استثمار مدير الصندوق
N/A	الأرباح الموزعة
100%	ملكية مدير الصندوق
0.00	حق الانتفاع

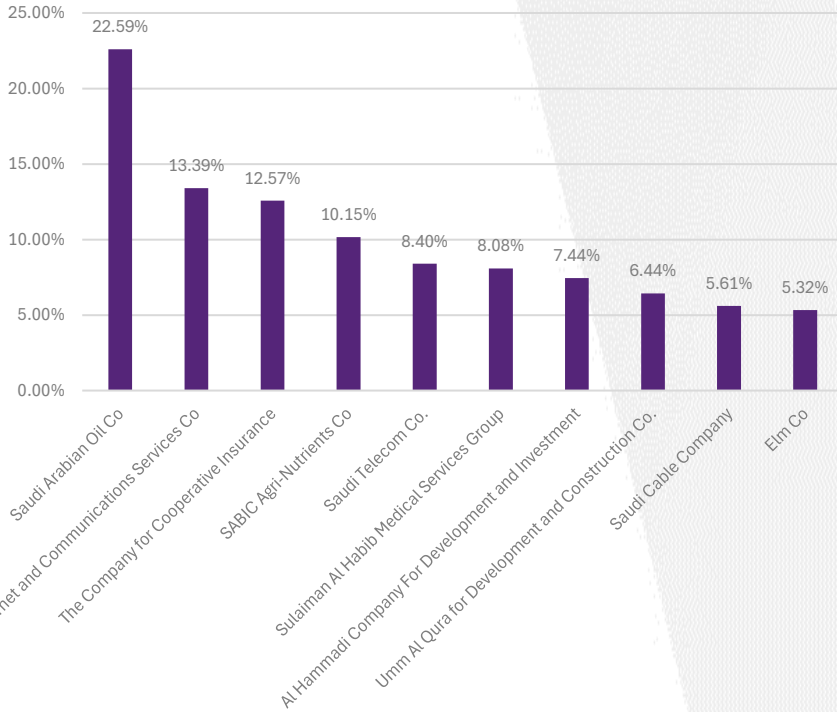
بيانات الصندوق :

14/09/2015	تاريخ البدء
4,676,302	حجم الصندوق
10	سعر الوحدة عند الطرح
مفتوح	نوع الصندوق
ريال سعودي	عملة الصندوق
مرتفع المخاطر	مستوى المخاطر
مؤشر قيمة الشري للأسهم السعودية	المؤشر المرجعي
لا ينطبق	عدد مرات التوزيع
لا ينطبق	نسبة رسوم الإدارة للصناديق المستثمر فيها
لا ينطبق	مستشار الاستثمار ومدير الصندوق من الباطن
لا ينطبق	عدد أيام المتوسط المرجح

العائد :

البند	3 أشهر	منذ بداية العام	1 سنة	3 سنوات	5 سنوات
أداء الصندوق	1.18%	1.18%	-15.30%	4.64%	36.35%
أداء المؤشر المرجعي	6.06%	6.06%	-8.14%	3.31%	8.39%
فارق الأداء	-4.87%	-4.87%	-7.16%	1.33%	27.96%

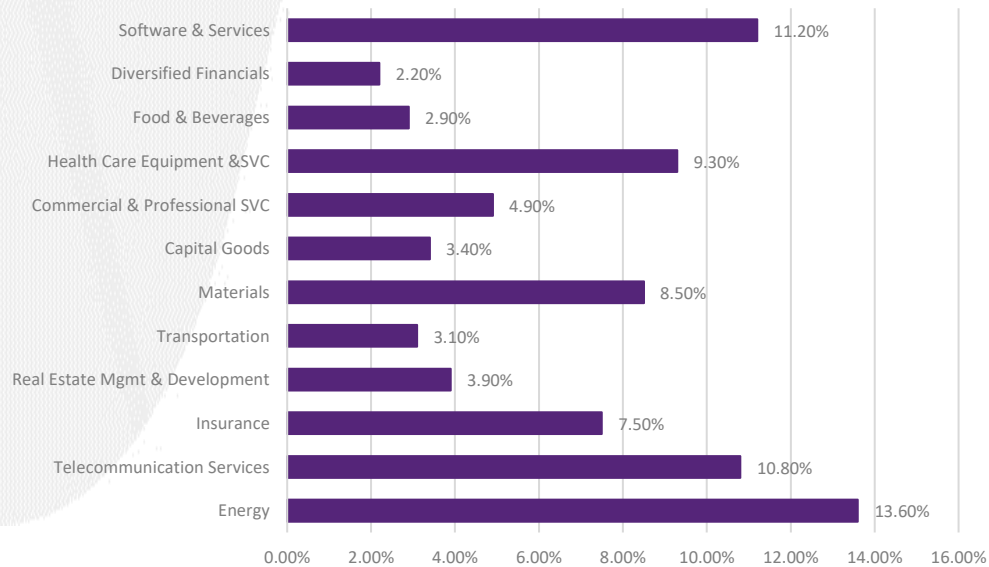
أكبر عشرة إستثمارات للصندوق :



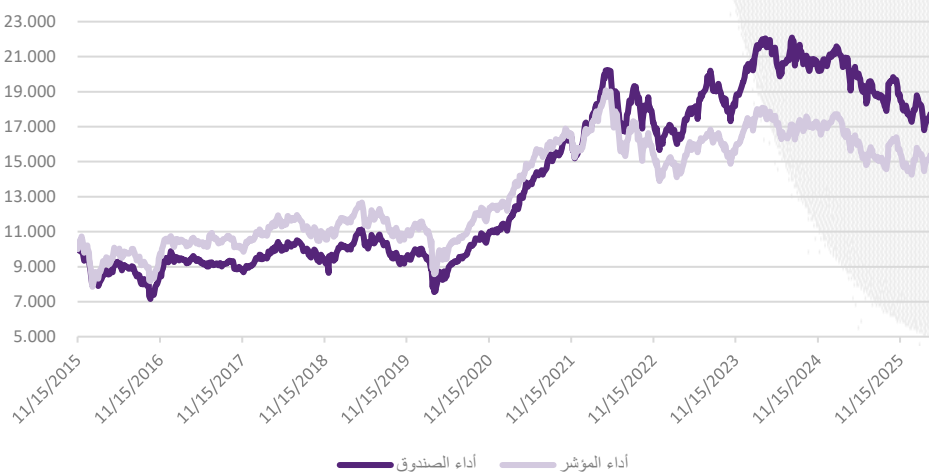
الأداء و المخاطر :

معايير الأداء والمخاطر	3 أشهر	منذ بداية العام	1 سنة	3 سنوات	5 سنوات
الانحراف المعياري	1.40%	1.40%	1.60%	1.42%	1.49%
نسبة شارب	0.81	0.81	-9.46	3.25	24.39
خطأ التتبع	1.54%	1.54%	1.59%	1.52%	1.61%
بيتا B	0.69	0.69	0.72	0.75	0.78
ألفا α	-4.87%	-4.87%	-7.16%	1.33%	27.96%
نسبة المعلومات	-3.17	-3.17	-4.50	0.88	17.32

رسم بياني لتوزيع الأصول للصندوق :



أداء الصندوق مقارنة بالمؤشر



توزيع الأصول لصندوق جغرافي :

100%	داخل المملكة العربية السعودية
------	-------------------------------

بيان المعادلات المستخدمة لاحتساب مقاييس الأداء والمخاطر:  
الانحراف المعياري:  $\sigma = \sqrt{1/n \times \sum (R_i - R)^2}$   
نسبة شارب: تقسيم العائد المعدل حسب المخاطر  
 $Sharpe = (R_p - R_f) / \sigma_p$   
خطأ التتبع: الفرق بين أداء الصندوق والمؤشر المرجعي  
 $Tracking Error = \sqrt{1/n \times \sum (R_{pi} - R_{bi})^2}$   
بيتا: تقسيم حساسية الصندوق لتحركات السوق  
 $\beta = Cov(R_p, R_m) / Var(R_m)$   
ألفا: العائد الزائد للصندوق مقارنة بالمؤشر المرجعي  
 $\alpha = R_p - [R_f + \beta(R_m - R_f)]$

بيانات مدير الصندوق:  
الهاتف: 920000757

الموقع الإلكتروني: [www.valuecapital.sa](http://www.valuecapital.sa)  
البريد الإلكتروني: [crm@valuecapital.sa](mailto:crm@valuecapital.sa)