الراجحي المالية
Al Rajhi Capital

صندوق الراجحي إم إس سي أي لمؤشر الأسهم السعودية متعدد العوامل

البيان الربع السنوي الثاني للعام 2021م

شركة الراجحي المالية هي شركة مرخص لها بالعمل وفق الترخيص رقم 37-07068 الصادر من هيئة السوق المالية ويقع المقر الرئيسي للشركة في مدينة الرياض

صندوق الراجحي لمؤشر أم أس سي أي للأسهم السعودية

للشهر المنتهي يونيو 2021

الراجحي المالية
Al Rajhi Capital

الهدف

صندوق الراجحي إم إس سي أي لمؤشر الأسهم السعودية متعدد العوامل هو صندوق استثمار عام مفتوح يهدف إلى تحقيق نمو متوسط إلى طويل الأجل لرأس المال من خلال تتبع أداء مؤشر إم إس سي أي للأسهم السعودية متعدد العوامل المتوافقة مع ضوابط الهيئة الشرعية للصندوق.

أداء الصندوق (الجدول)

المؤشر	سنة واحدة	ثلاث سنوات	خمس سنوات	عشر سنوات	منذ التأسيس
عدد أشهر الأداء الايجابي	11.00	-	-	-	22.00
عدد أشهر الأداء المتفوق على المؤشر القياسي	-	-	-	-	-
العائد قصير الأجل (%)	**شهرواحد**	**ثلاثة أشهر**	**ستة أشهر**	**منذ بداية الربع حتى**	**منذ بداية العام حتى تاريخه**
الصندوق	3.09	14.08	28.67	14.08	28.67
المؤشر القياسي	3.22	13.34	27.56	13.34	27.56
عوائد كل سنة (%)	**2016**	**2017**	**2018**	**2019**	**2020**
الصندوق	-	-	-	3.87	9.79
المؤشر القياسي	-	-	-	-	3.59
العوائد التراكمية (%)	**سنة واحدة**	**ثلاث سنوات**	**خمس سنوات**	**عشر سنوات**	**منذ التأسيس**
الصندوق	51.93	-	-	-	46.74
المؤشر القياسي	50.30	-	-	-	-
العوائد السنوية (%)	**سنة واحدة**	**ثلاث سنوات**	**خمس سنوات**	**عشر سنوات**	**منذ التأسيس**
الصندوق	51.93	-	-	-	16.61
المؤشر القياسي	50.30	-	-	-	-

خصائص الصندوق

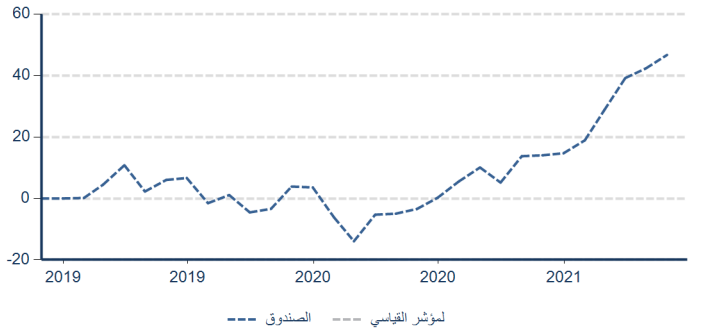
نوع الصندوق	صندوق مفتوح
مقر الصندوق	المملكة العربية السعودية
مستوى المخاطرة	عالي
تاريخ التأسيس	20 يناير
السعر عند التأسيس	10 ريال سعودي للوحدة
عملة الصندوق	ريال سعودي
المؤشر القياسي	مؤشر أم أس سي أي للأسهم السعودية
رسم الاشتراك	لا يوجد
أتعاب الإدارة	1.00% سنويا
أتعاب الأداء	-
الحد الأدنى للاشتراك	ريال سعودي 2,000
الحد الأدنى للاشتراك الإضافي	ريال سعودي 1,000
الحد الأدنى للاسترداد	ريال سعودي 1,000
أيام التقييم	مرتين أسبوعيا – يومي الإثنين والأربعاء
آخر موعد لاستلام طلبات الاشتراك والاسترداد	قبل الساعة الخامسة مسا ء – قبل يوم التقييم
موعد الإعلان والسداد	اليوم التالي ليوم التقييم
تنفيذ التداول	ثالث يوم عمل
مدير الصندوق	الراجحي المالية
أمين الحفظ	شركة البلاد للاستثمار clientservices@albilad-capital.com

آخر الجوائز و الترتيب

معلومات الأسعار – نهاية يونيو 2021

صافي قيمة الأصول للوحدة	ريال سعودي	14.6737	▲
التغير (للشهر مقارنة بالسابق)	ريال سعودي	0.4398	% 3.09
اجمالي وحدات الصندوق		2,944,083	
اجمالي صافي الأصول	ريال سعودي	43,200,584.55	

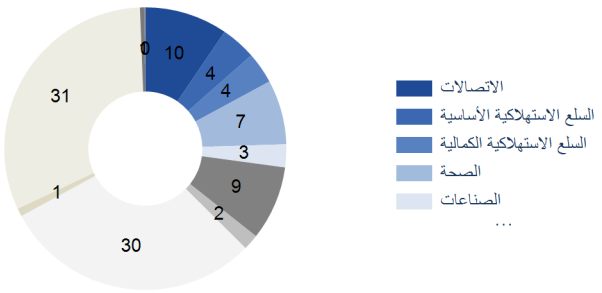
أداء الصندوق (الرسم البياني)



أكبر 5 شركات

الشركة	نسبة الصندوق في الشهر الحالي %
مصرف الراجحي	16.98
الشركة السعودية العالمية للبتروكيماويات	7.74
مصرف الإنماء	6.89
شركة الإتصالات السعودية	6.58
Saudi Arabian Oil Co.	4.62

تقسيم القطاعات (نسبة اجمالي صافي الأصول)



التحليل الاحصائي

الأداء	سنة واحدة	ثلاث سنوات	خمس سنوات	عشر سنوات	منذ التأسيس
العوائدالإضافية (%)	1.63	-	-	-	16.61
ألفا (%)	0.80-	-	-	-	4.30
المخاطرة	**سنة واحدة**	**ثلاث سنوات**	**خمس سنوات**	**عشر سنوات**	**منذ التأسيس**
الحد الأقصى للانخفاض (%)	4.47-	-	-	-	22.34-
الانحراف المعياري (%)	12.41	-	-	-	18.11
مخاطر الانخفاض (%)	9.37	-	-	-	13.74
حساسية السوق	**سنة واحدة**	**ثلاث سنوات**	**خمس سنوات**	**عشر سنوات**	**منذ التأسيس**
بيتا	1.05	-	-	-	0.94
عوائد المخاطرة	**سنة واحدة**	**ثلاث سنوات**	**خمس سنوات**	**عشر سنوات**	**منذ التأسيس**
نسبة شارب	3.49	-	-	-	0.97
مؤشر المعلومات	0.80	-	-	-	1.00
نسبة الانحراف عن المؤشر	-	-	-	-	-

إخلاء المسؤولية

شركة الراجحي المالية:هي شركة مُرخصة من قبل هيئة السوق المالية بالترخيص رقم: 37-07068. وتحسب العروض حسب أسعار الأشهر المنتهية. ولا يُعتبر أداء الصندوق في الماضي مؤشراً على الأداء المستقبلي. كما أن قيمة الاستثمار في وحدات الصندوق متغيرة، وقد تخضع للزيادة أو النقصان. ومن الممكن أن تهبط قيمة الاستثمار ويستلم المُستثمر مبلغاً أقل من المبلغ المستثمر، وكذلك الأتعاب التي تترتب على الصندوق وعلى سعر صرف العملة الأجنبية قد تشكل عامل معاكس للاستثمار.وعلى المستثمرين أن يأخذوا بعين الإعتبار وضعهم المالي، وكذلك عليهم أخذ النصيحة من خبراء في الاستثمار والشؤون القانونية قبل دخولهم في أي منتج مالي أو صندوق استثماري. إن المعلومات المفصلة عن هذا الاستثمار توجد بوضوح وعلى المستثمر أن يقرأ ويتأكد من إستيعاب جميع المعلومات المفصلة عن هذا الاستثمار في اللائحة الواردة في الشروط والمواصفات الخاصة بهذا الصندوق.

للإتصال

شركة الراجحي المالية الإدارة العامة،
، طريق الملك فهد ص.ب. 5561
، الرياض 11432
المملكة العربية السعودية
هاتف: 920005856
البريد الالكتروني salessupport@alrajhi-capital.com الموقع الالكتروني : www.alrajhi-capital.com

1- تاريخ بدء الصندوق:

يعتبر صندوق مفتوح غير محدد المدة وقد بدأ تشغيل الصندوق بتاريخ (28 / 05 /1440 هـ) الموافق (03 / 02 /2019 م) .

يعتبر هذا الصندوق من الصناديق المفتوحة المدة وليس هناك يوم محدد لتصفيته. ومع ذلك، فإنه سيكون لمدير الصندوق الحق في تصفية الصندوق بالكامل، إذا أصبح جلياً أن حجم أصول الصندوق لا يبرر الاستمرار في إدارته بطريقة عملية وملائمة ومجدية من الناحية الاقتصادية أو بسبب حدوث بعض التغييرات في الأنظمة التي تحكم إدارة الصندوق

2- عدد مرات التوزيع.

لن يقوم الصندوق بتوزيع أي أرباح أو توزيعات نقدية على المستثمرين وسيقوم بإعادة استثمار الأرباح الموزعة في الصندوق.

3- نسبة رسوم الإدارة للصناديق المستثمر فيها.

يستثمر الصندوق في صندوق جدوى ريت علما ن رسوم ادارة الصندوق لا تتجاوز (نسبة 0.75% سنويا من صافي قيمة الأصول) حسب شروط وأحكام الصندوق، ويتقاضى الصندوق رسوم إدارة 1.00% من صافي قيمة الأصول وذلك حسب الشروط والاحكام الصندوق.

4- مستشار الاستثمار ومدير الصندوق من الباطن.

لا يوجد

5- عدد أيام المتوسط المرجح.

لا يوجد

ج. تعريفات:

1- الانحراف المعياري.

الانحراف المعياري أو Standard Deviation، يعبر عنه بنسبة مئوية وهي أداة إحصائية تقوم بتحديد مدى تغير سلسلة من الأرقام مثل عوائد الصندوق حول متوسطها. ويعتبر الانحراف المعياري مقياس للتقلب التاريخي، يتم حساب الانحراف المعياري على أنه الجذر التربيعي للتباين ويسمح الانحراف المعياري بتحديد تأرجح أداء الصندوق في رقم واحد.

2- مؤشر شارب.

مؤشر شارب أو Sharpe Ratio، يعبر عنه برقم عددي ويعبر عن مدى الارتفاع أو الانخفاض الذي يمكن أن يتوقعه المستثمر مقارنة مع المعدل خالي المخاطر (مثل السندات الحكومية) لكل وحدة مخاطرة (تقلب). علماً أن المعدل خالي المخاطر يختلف من عملة لأخرى. وكلما كان مؤشر شارب أعلى، كلما كانت عوائد المستثمر على المخاطر التي يحملها الاستثمار أعلى. يمكن استخدام مؤشر شارب لمقارنة أداء صناديق متعددة.

3- خطأ التتبع(Tracking Error)

خطأ التتبع أو Tracking Error، يعبر عنه بنسبة مئوية وهو مقياس انحراف عائد الصندوق مقارنة بعائد المؤشر الاسترشادي خلال فترة زمنية محددة. وكلما كانت إدارة صندوق الاستثمار بطريقة غير نشطة بشكل أكبر، كلما كانت نسبة خطأ التتبع أصغر.

4- بيتا(Beta)

معامل بيتا أو Beta، يعبر عنه برقم عددي وهي أداة إحصائية لمقياس المخاطرة الذي يدل على حساسية استثمار ما تجاه تذبذبات السوق ككل، ويمثله في ذلك المؤشر الاسترشادي ذو الصلة. وعلى سبيل المثال، يخبرنا بيتا 1.20 بأنه يمكننا أن نتوقع أن تتغير قيمة الصندوق الاستثماري بنسبة 20% أعلى من نسبة التحرك المتوقعة للسوق، وفي حال كانت بيتا 0.80 فأنه من المتوقع أن تتغير قيمة الصندوق الاستثماري بنسبة 20% أقل من نسبة التحرك المتوقعة للسوق.

5- ألفا(Alpha)

ألفا أو Alpha، يعبر عنه بنسبة مئوية وهو مقياس الفارق بين العائد بعد تعديل المخاطر في استثمار ما والمؤشر الاسترشادي. يقيس ألفا جزء الأداء الذي لا يمكن شرحه من قبل حركات السوق أو مخاطر السوق، ولكن يمكن استنتاجه من اختيار الأسهم ضمن السوق. فإذا كان معامل ألفا بنسبة (1%)، فيعني ذلك أن عائد الاستثمار خلال فترة زمنية محددة كان أفضل من السوق بنسبة (1%) في نفس الفترة. والعكس صحيح، فإذا كان معامل ألفا للصندوق (-1%) فإن ذلك يدل على أن أداء الصندوق أقل بنسبة (1%) من أداء السوق في نفس الفترة.

6- مؤشر المعلومات.

مؤشر المعلومات أو Information Ratio، يعبر عنه بنسبة مئوية وهي أداة مالية تقيس الفرق بين متوسط العوائد السنوية للصندوق وللمؤشر الاسترشادي، مقسوماً على نسبة الانحراف عن

المؤشر. وتكون نسبة مؤشر المعلومات مرتفعة في حين أن مدير الصندوق قد تفوق على مدراء الصناديق الآخرين وحقق عوائد إيجابية خلال فترة محددة.

و. معلومات الأسعار كما في نهاية الربع المعني (الشهر/ السنة):

1. سعر الوحدة كما في نهاية الربع المعني.	14.6737
2. التغير في سعر الوحدة (مقارنة بالربع السابق).	%12.35
3. سعر الوحدة المزدوج لصناديق أسواق النقد، وصناديق أدوات الدين ذات الدخل الثابت (إن وُجد)	لا يوجد
4. إجمالي وحدات الصندوق	2,944,082.58
5. إجمالي صافي الأصول	43,239,073.07
6. مكرر الربحية (P/E) (إن وُجد)	لا يوجد

ز. معلومات الصندوق كما في نهاية الربع المعني (الشهر/ السنة):

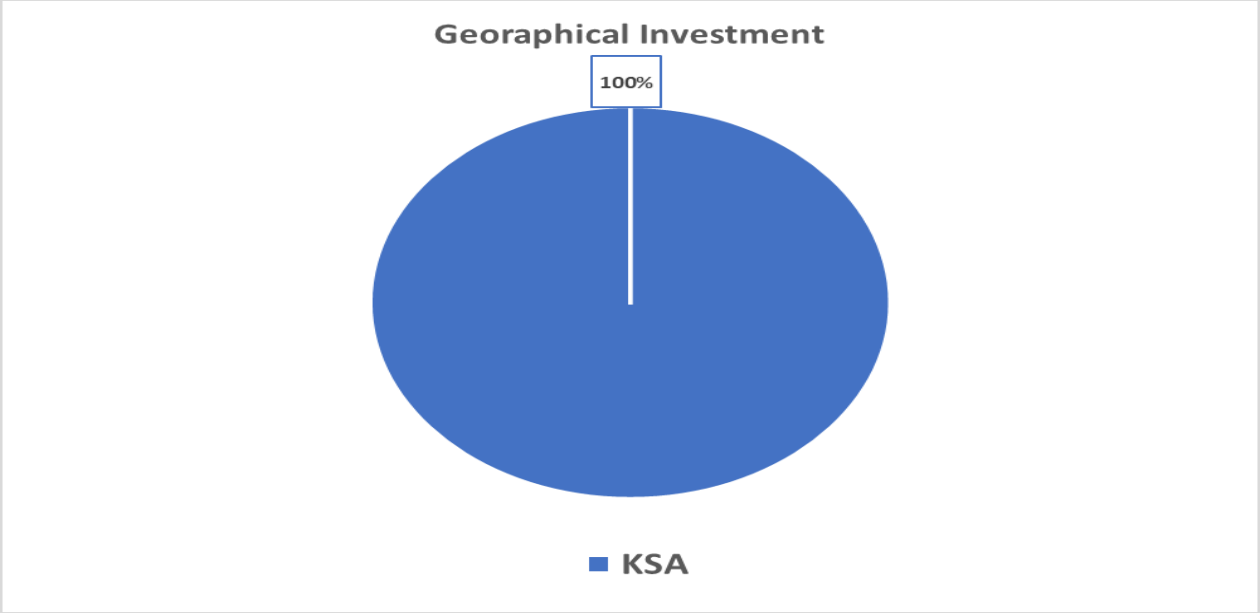
البند	قيمة*	%*
1-نسبة الأتعاب الإجمالي (TER)	92,048.71	%0.25
2- نسبة الاقتراض (إن وُجدت)	لا يوجد	لا يوجد
3-مصاريف التعامل	22,431.84	%0.06
4-استثمار مدير الصندوق (إن وُجدت)	لا يوجد	لا يوجد
5-الأرباح الموزعة	لا يوجد	لا يوجد

ح. بيانات ملكية استثمارات الصندوق:

1- ملكية تامة	%100
2- حق منفعة	%100

ي. رسم بياني يوضح أكبر عشرة استثمارات للصندوق:

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



ل. العائد:

البند	3 أشهر (نهاية الربع الحالي)	سنة حتى تاريخه (YTD)	سنة واحدة	3 سنوات	5 سنوات
1-أداء الصندوق.	14.08	28.67	51.93	-	-
2-أداء المؤشر الاسترشادي	13.34	27.56	50.30	-	-
3- فارق الأداء	0.74	1.11	1.63	-	-

م. الأداء والمخاطر:

معايير الأداء والمخاطر	3 أشهر (نهاية الربع الحالي)	سنة حتى تاريخه (YTD)	سنة واحدة	3 سنوات	5 سنوات
1-الانحراف المعياري	9.16	10.01	12.41	-	-
2- مؤشر شارب	5.93	5.19	3.49	-	-
3- خطأ التتبع	0.00	0.00	0.00		
4-بيتا(Beta)	2.57	0.71	1.05	-	-
5-ألفا (Alpha)	-44.72	13.83	0.80-	-	-
6-مؤشر المعلومات	1.55	-0.40	0.80	-	-

البيان الربع السنوي لصندوق الراجحي إم إس سي أي لمؤشر الأسهم السعودية متعدد العوامل متاح عند الطلب بدون مقابل ومتوفر في موقعنا الإلكتروني
www.alrajhi-capital.com