الراجحي المالية
Al Rajhi Capital

صندوق الراجحي للمضاربة بالبضائع – دولار أمريكي

البيان الربع السنوي الأول للعام 2022م

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 للمضاربة بالبضائع – دولار أمريكي

للشهر المنتهي مارس 2022

الهدف

تحقيق نمو طويل الأجل في رأس المال عن طريق الاستثمار في أسهم الشركات المدرجة في سوق الأسهم السعودي(تداول) والمتوافقة مع أحكام الشريعة الإسلامية، ويوفر الصندوق السيولة للمستثمرين.

أداء الصندوق (الجدول)

المؤشر	سنة واحدة	ثلاث سنوات	خمس سنوات	عشر سنوات	منذ التأسيس
عدد أشهر الأداء الايجابي	12.00	36.00	60.00	120.00	376.00
عدد أشهر الأداء المتفوق على المؤشر القياسي	11.00	35.00	42.00	102.00	306.00
العائد قصير الأجل (%)	**شهرواحد**	**ثلاثة أشهر**	**ستة أشهر**	**منذ بداية الربع حتى**	**منذ بداية العام حتى تاريخه**
الصندوق	0.08	0.20	0.39	0.20	0.20
المؤشر القياسي	0.08	0.15	0.19	0.15	0.15
عوائد كل سنة (%)	**2017**	**2018**	**2019**	**2020**	**2021**
الصندوق	1.53	2.11	2.52	1.40	0.72
المؤشر القياسي	1.30	2.39	2.32	0.61	0.16
العوائد التراكمية (%)	**سنة واحدة**	**ثلاث سنوات**	**خمس سنوات**	**عشر سنوات**	**منذ التأسيس**
الصندوق	0.76	4.24	8.30	15.33	135.04
المؤشر القياسي	0.26	2.58	6.80	8.75	95.10
العوائد السنوية (%)	**سنة واحدة**	**ثلاث سنوات**	**خمس سنوات**	**عشر سنوات**	**منذ التأسيس**
الصندوق	0.76	1.39	1.61	1.44	2.77
المؤشر القياسي	0.26	0.85	1.33	0.84	2.16

خصائص الصندوق

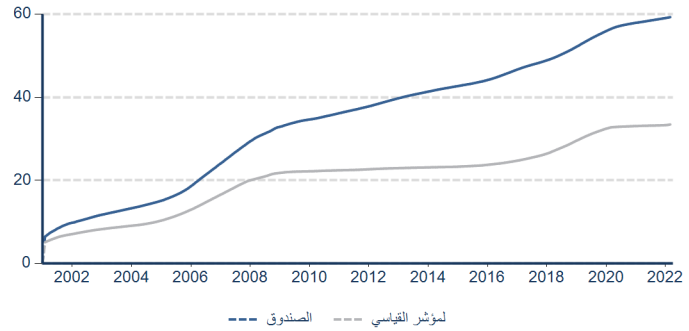
نوع الصندوق	صندوق أسواق مالية مفتوح المدة
مقر الصندوق	المملكة العربية السعودية
مستوى المخاطرة	منخفض
تاريخ التأسيس	ديسمبر 1990
السعر عند التأسيس	1000 دولار أمريكي للوحدة
عملة الصندوق	دولار أمريكي
المؤشر القياسي	سعر الفائدة على القروض بمصارف لندن بالدولار- 3 شهور
رسم الاشتراك	لا يوجد
أتعاب الإدارة	16.00% سنويا
أتعاب الأداء	-
الحد الأدنى للاشتراك	دولار أمريكي 2,000
الحد الأدنى للاشتراك الإضافي	دولار أمريكي 1,000
الحد الأدنى للاسترداد	دولار أمريكي 1,000
أيام التقييم	يوميا – من يوم الأحد حتى يوم الخميس
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

أخر الجوائز و الترتيب

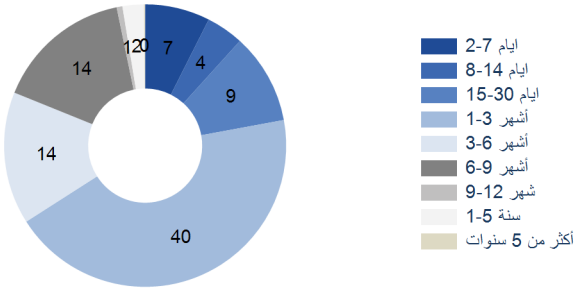
معلومات الأسعار – نهاية مارس 2022

صافي قيمة الأصول للوحدة	دولار أمريكي	2,350.3513	▲
التغير (للشهر مقارنة بالسابق)	دولار أمريكي	1.8129	% 0.08
اجمالي وحدات الصندوق		72,605	
اجمالي صافي الأصول	دولار أمريكي	170,646,711.31	

أداء الصندوق (الرسم البياني)



تقسيم الحصص (نسبة اجمالي صافي الأصول)



التحليل الاحصائي

الأداء	سنة واحدة	ثلاث سنوات	خمس سنوات	عشر سنوات	منذ التأسيس
العوائدالإضافية (%)	0.50	0.54	0.28	0.59	0.61
ألفا (%)	0.70	0.70	0.71	0.94	0.91
المخاطرة	**سنة واحدة**	**ثلاث سنوات**	**خمس سنوات**	**عشر سنوات**	**منذ التأسيس**
الحد الأقصى للانخفاض (%)	-	-	-	-	-
الانحراف المعياري (%)	0.02	0.21	0.20	0.16	0.46
مخاطر الانخفاض (%)	0.01	0.13	0.14	0.10	0.29
حساسية السوق	**سنة واحدة**	**ثلاث سنوات**	**خمس سنوات**	**عشر سنوات**	**منذ التأسيس**
بيتا	0.21	0.81	0.67	0.58	0.85
عوائد المخاطرة	**سنة واحدة**	**ثلاث سنوات**	**خمس سنوات**	**عشر سنوات**	**منذ التأسيس**
نسبة شارب	42.41	6.45	7.90	8.66	5.92
مؤشر المعلومات	8.90	6.45	2.35	4.55	3.21
نسبة الانحراف عن المؤشر	0.06	0.08	0.12	0.13	0.19

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 بدأ الصندوق عمله في 27 جماد الأول 1411هـ الموافق 14 ديسمبر 1990م.

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.

أستثمر الصندوق في صندوق الراجحي للمضاربة بالبضائع بالريال السعودي. كما ان رسوم الادارة لا تشكل اعلى من 16% من صافي الارباح من الصندوق والصناديق المستثمر بها.

4- مستشار الاستثمار ومدير الصندوق من الباطن.

لا يوجد

5- عدد أيام المتوسط المرجح.

(99.15 يوم)

6- حجم الصندوق (قبل خصم المصاريف).

640,279,891.32

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.	8,813.8174
2.	التغير في سعر الوحدة (مقارنة بالربع السابق).	%1.5995
3.	سعر الوحدة المزدوج لصناديق أسواق النقد، وصناديق أدوات الدين ذات الدخل الثابت (إن وُجد)	لا يوجد
4.	إجمالي وحدات الصندوق	72,604.7692
5.	إجمالي صافي الأصول	639,925,178.99
6.	مكرر الربحية (P/E) (إن وُجد)	لا يوجد

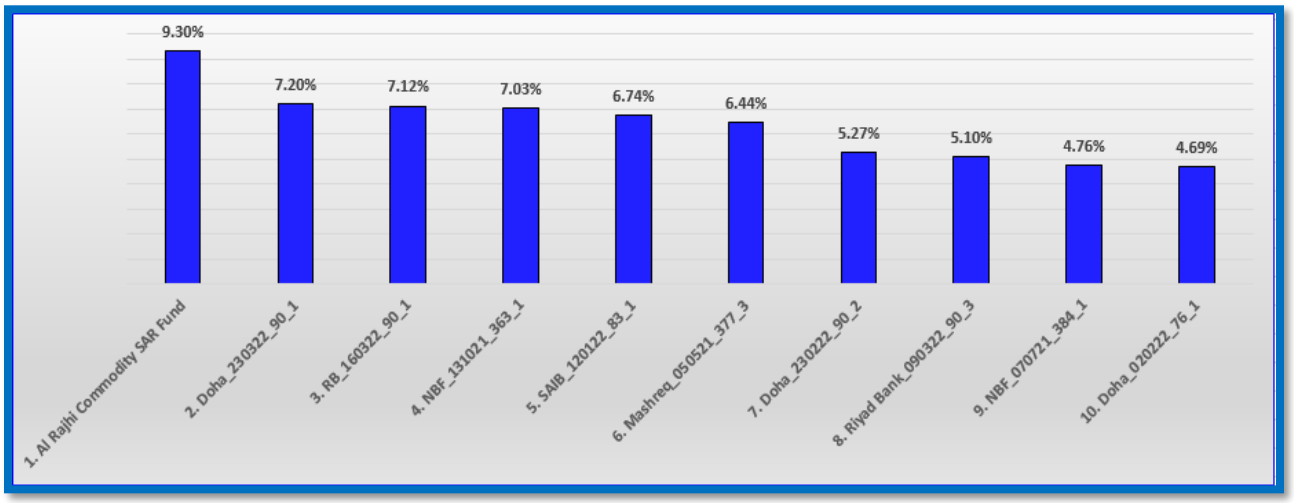
ز. معلومات الصندوق كما في نهاية الربع المعني (الشهر/ السنة):

البند	قيمة*	%*
1-نسبة الأتعاب الإجمالي (TER)	292,262.70	%0.04
2- نسبة الاقتراض (إن وُجدت)	لا يوجد	لا يوجد
3-مصاريف التعامل	1,117.54	%0.0002
4-استثمار مدير الصندوق (إن وُجدت)	لا يوجد	لا يوجد
5-الأرباح الموزعة	لا يوجد	لا يوجد

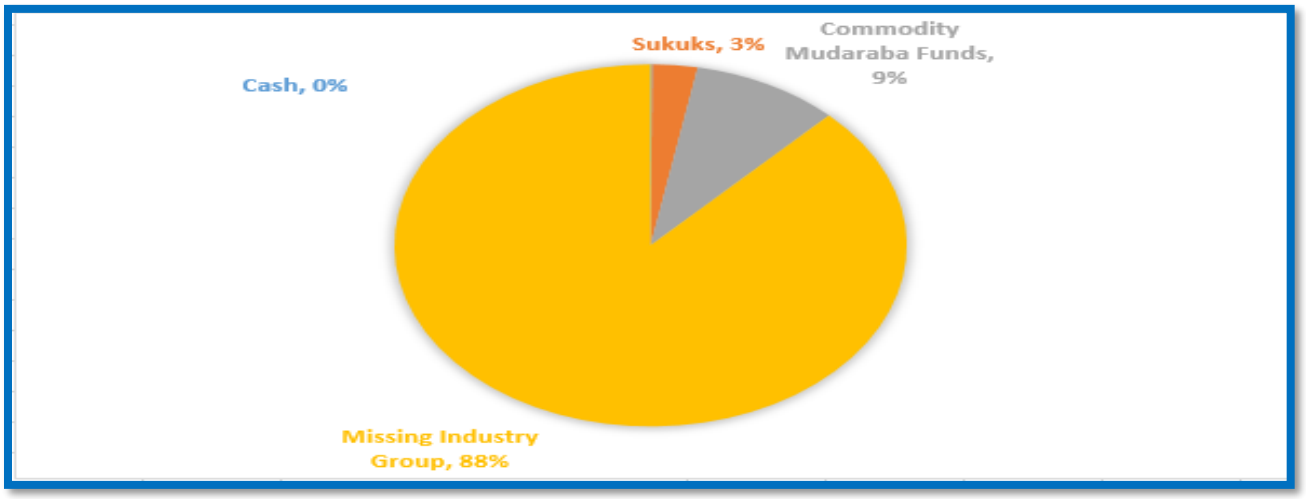
ح. بيانات ملكية استثمارات الصندوق:

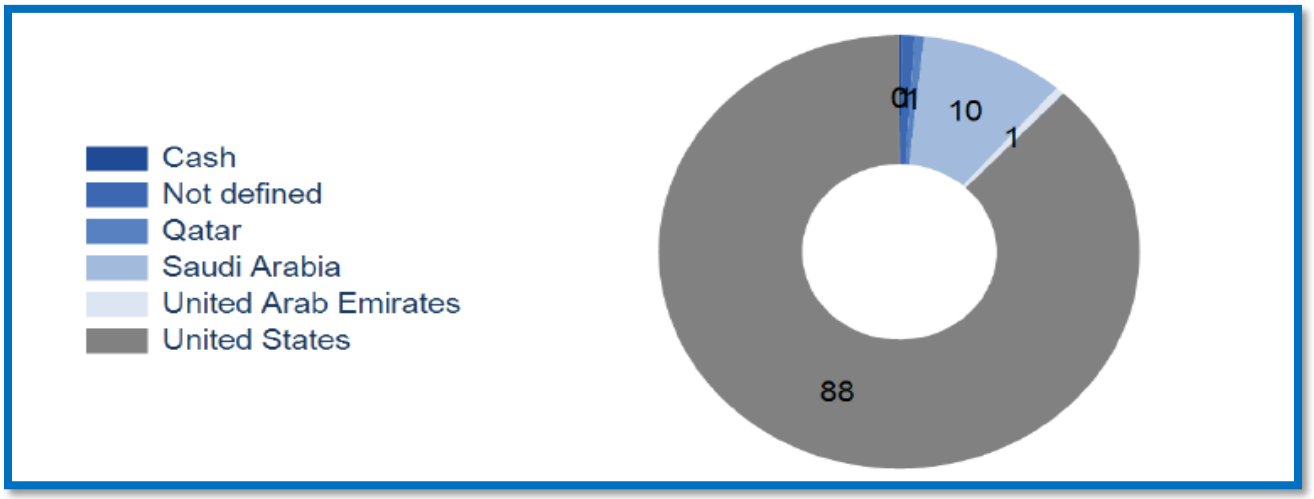
1-	ملكية تامة	%100
2-	حق منفعة	%100

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.	0.20	0.20	0.76	4.24	8.30
2-أداء المؤشر الاسترشادي	0.15	0.15	0.26	2.58	6.80
3- فارق الأداء	0.05	0.05	0.50	1.66	1.50

م. الأداء والمخاطر:

معايير الأداء والمخاطر	3 أشهر (نهاية الربع الحالي)	سنة حتى تاريخه (YTD)	سنة واحدة	3 سنوات	5 سنوات
1-الانحراف المعياري	8.63	8.63	0.02	0.21	0.20
2- مؤشر شارب	9.22	9.22	42.41	6.45	7.90
3- خطأ التتبع	0.08	0.08	0.06	0.08	0.12
4-بيتا(Beta)	1.43	1.43	0.21	0.81	0.67
5-ألفا (Alpha)	-6.99	-6.99	0.70	0.70	0.71
6-مؤشر المعلومات	2.73	2.73	8.90	6.45	2.35