



صندوق الراجحي المرن للأسهم السعودية

البيان الربع السنوي الأول للعام 2023م

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



أ. هدف الصندوق:

صندوق الراجحي المرن للأسهم السعودية هو صندوق استثماري مفتوح يهدف إلى تحقيق نمو عالي في رأس المال على المدى المتوسط إلى الطويل من خلال الاستثمار وإدارة المحفظة بشكل فعال ومركز في مجموعة مختارة من أسهم الشركات المدرجة في أسواق الأسهم السعودية والطروحات الأولية وحقوق الأولوية والصناديق العقارية المتداولة بما يتوافق مع ضوابط الهيئة الشرعية للصندوق.

ب. بيانات الصندوق:

1- تاريخ بدء الصندوق:

الصندوق يعتبر صندوق مفتوح غير محدد المدة وقد بدأ الصندوق عمله في 7 صفر 1443هـ. الموافق 15 سبتمبر 2021م.

2- سعر الوحدة عند الطرح.

سعر الوحدة عند الطرح 10 ريال سعودي.

3- حجم الصندوق.

317,304,061.18

4- نوع الصندوق.

صندوق عام مفتوح من فئة الأسهم.

5- عملة الصندوق.

عملة الصندوق بالريال سعودي.

6- مخاطر الصندوق.

عالية.

7- المؤشر الاسترشادي.

مؤشر (ستاندرز أند بورز) للأسهم السعودية المتوافقة مع الضوابط الشرعية) لأغراض مقارنة أداء الصندوق.

8- عدد مرات التوزيع.

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

9- نسبة رسوم الإدارة للصناديق المستثمر فيها.

لا يستثمر الصندوق في أي صناديق أخرى

10- مستشار الاستثمار ومدير الصندوق من الباطن.

لا يوجد.

11- عدد أيام المتوسط المرجح.

لا يوجد

12- حجم الصندوق (قبل خصم المصاريف).

319,463,304.22

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 الاستراتيجي 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 الاستراتيجي 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 فإنه 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 الاستراتيجي. 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 الاستراتيجي، 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):

11.5404	1. سعر الوحدة كما في نهاية الربع المعني.
%7.07-	2. التغير في سعر الوحدة (مقارنة بالربع السابق).
لا يوجد	3. سعر الوحدة المزدوج لصناديق أسواق النقد، وصناديق أدوات الدين ذات الدخل الثابت (إن وُجد)
27,495,073.95	4. إجمالي وحدات الصندوق
317,304,061.18	5. إجمالي صافي الأصول
لا يوجد	6. مكرر الربحية (P/E) (إن وُجد)

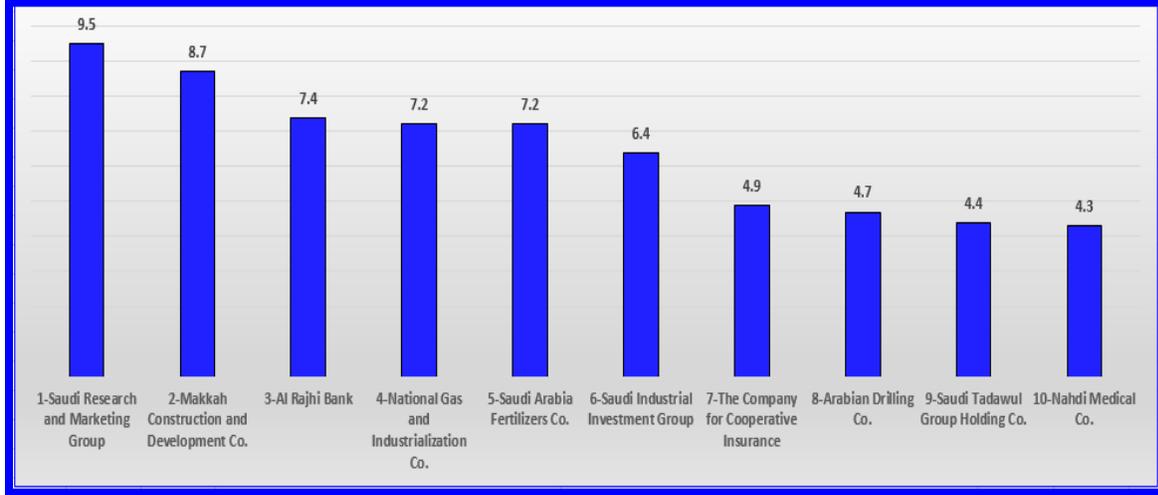
ز. معلومات الصندوق كما في نهاية الربع المعني (الشهر/ السنة):

البند	قيمة*	%
1-نسبة الأتعاب الإجمالي (TER)	1,770,773.69	%0.58
2- نسبة الاقتراض (إن وُجدت)	لا يوجد	لا يوجد
3-مصاريف التعامل	109,634.34	%0.04
4-استثمار مدير الصندوق (إن وُجدت)	5,770,200.00	%1.82
5-الأرباح الموزعة	لا يوجد	لا يوجد

ح. بيانات ملكية استثمارات الصندوق:

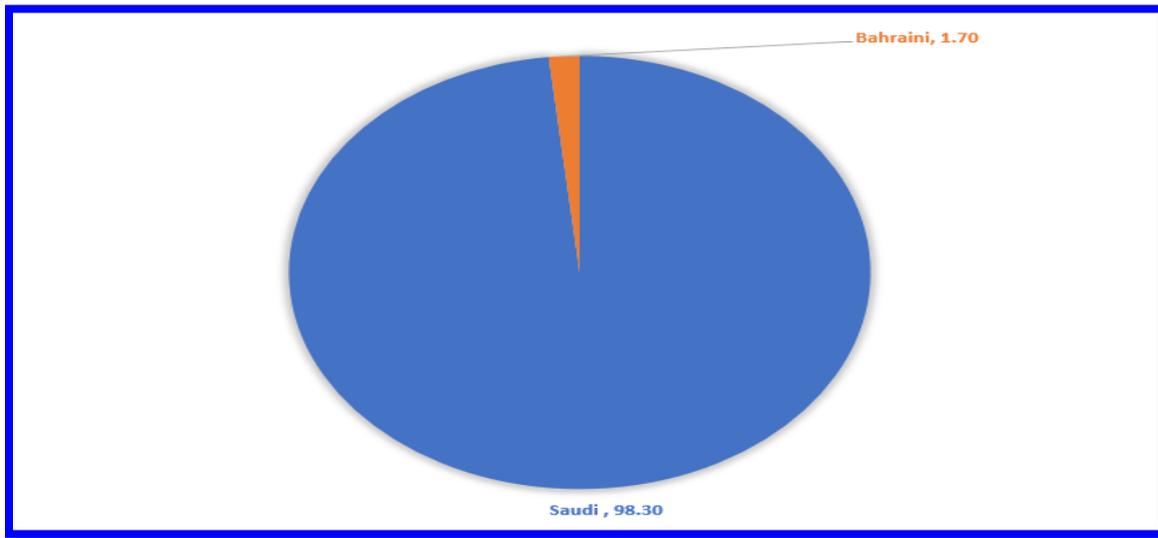
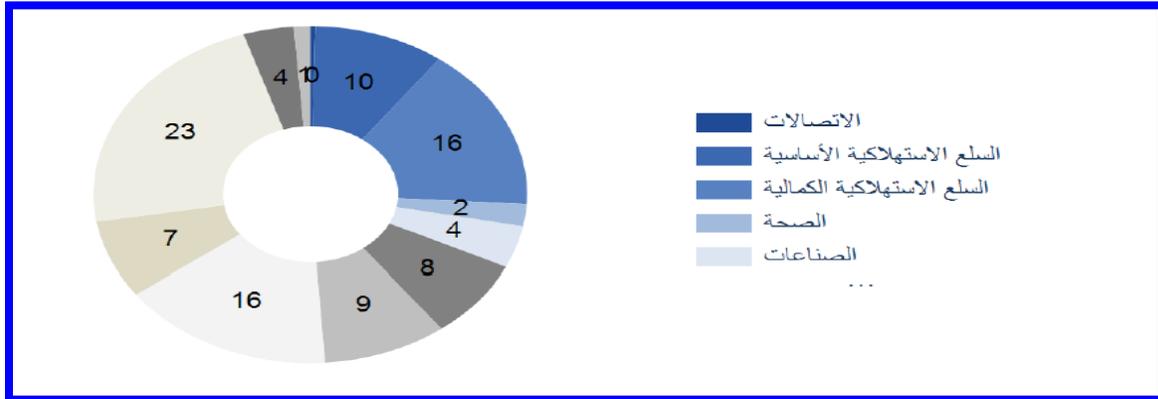
%100	1- ملكية تامة
%100	2- حق منفعة

ي. رسم بياني يوضح أكبر عشرة استثمارات للصندوق:



كما هو أول يوم في الربع المعني.

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



ل. العائد:

البند	3 أشهر	سنة حتى تاريخه (YTD)	سنة واحدة	3 سنوات	5 سنوات
1- أداء الصندوق.	12.66	12.66	6.60-	-	-
2- أداء المؤشر الاسترشادي	4.52	4.52	16.21-	-	-
3- فارق الأداء	8.14	8.14	9.61	-	-

*بدأ الصندوق عمله في تاريخ 15 سبتمبر 2021م.

م. الأداء والمخاطر:

معايير الأداء والمخاطر	3 أشهر	سنة حتى تاريخه (YTD)	سنة واحدة	3 سنوات	5 سنوات
1- الانحراف المعياري	12.21	12.21	23.67	-	-
2- مؤشر شارب	4.04	4.04	0.17-	-	-
3- خطأ التتبع	9.40	9.40	7.43	-	-
4- بيتا (Beta)	0.57	0.57	1.04	-	-
5- ألفا (Alpha)	45.28	45.28	12.51	-	-
6- مؤشر المعلومات	3.13	3.13	1.58	-	-

*بدأ الصندوق عمله في تاريخ 15 سبتمبر 2021م.

ه. للاتصال:

1- رقم الهاتف.

الاتصال على هاتف 8001245858

ومن خارج المملكة الاتصال على +966920005856

2- الموقع الإلكتروني.

www.alrajhi-capital.com

3- البريد الإلكتروني.

customerservice@alrajhi-capital.sa

البيان الربع السنوي الأول للعام 2023م لصندوق الراجحي المرن للأسهم
السعودية متاح عند الطلب بدون مقابل ومتوفر في موقعنا الإلكتروني

www.alrajhi-capital.com

معلومات الأسعار - نهاية مارس 2023

▲ 11.5411	ريال سعودي	صافي قيمة الأصول للوحدة
0.8420	ريال سعودي	التغير (الشهر مقارنة بالسابق)
27,495,074		اجمالي وحدات الصندوق
317,323,398.02	ريال سعودي	اجمالي صافي الأصول

داء الصندوق (الرسم البياني)



تقسيم القطاعات (نسبة اجمالي صافي الأصول)



التحليل الاحصائي

الأداء	سنة واحدة	ثلاث سنوات	خمس سنوات	عشر سنوات	منذ التأسيس
العوائد الإضافية (%)	9.47	-	-	-	11.60
أفدا (%)	12.52	-	-	-	12.01
المخاطرة	سنة واحدة	ثلاث سنوات	خمس سنوات	عشر سنوات	منذ التأسيس
الحد الأقصى لتخفيض (%)	21.88	-	-	-	21.88
الانحراف المعياري (%)	23.67	-	-	-	22.70
معايير الانخفاض (%)	17.98	-	-	-	17.84
حساسية السوق	سنة واحدة	ثلاث سنوات	خمس سنوات	عشر سنوات	منذ التأسيس
بيتا	1.04	-	-	-	1.03
عوائد المخاطرة	سنة واحدة	ثلاث سنوات	خمس سنوات	عشر سنوات	منذ التأسيس
نسبة شارب	0.17	-	-	-	0.47
مؤشر المعلومات	1.58	-	-	-	1.56
نسبة الانحراف عن المؤشر	7.43	-	-	-	7.33

الهدف

تتمية رأس المال لأجل طويل عن طريق الاستثمار في أسهم الشركات العمالية المتوافقة مع أحكام الشريعة الإسلامية في بلدان العالم المختلفة، ويوفر الصندوق السيولة للمستثمرين.

داء الصندوق (الجدول)

المؤشر	سنة واحدة	ثلاث سنوات	خمس سنوات	عشر سنوات	منذ التأسيس
عدد أشهر الأداء الإيجابي	6.00	-	-	-	12.00
عدد أشهر الأداء المتفوق على المؤشر القياسي	8.00	-	-	-	14.00
التعدد قصير الأجل (%)	شهر واحد	ثلاثة أشهر	سنة أشهر	منذ بداية العام حتى تاريخه	منذ بداية العام حتى تاريخه
الصندوق	7.87	12.85	5.60	12.66	12.66
المؤشر القياسي	6.09	4.52	2.87	4.52	4.52
عوائد على سنة (%)	2018	2019	2020	2021	2022
الصندوق	-	-	-	-	2.44
المؤشر القياسي	-	-	-	-	7.04
العوائد التراكمية (%)	سنة واحدة	ثلاث سنوات	خمس سنوات	عشر سنوات	منذ التأسيس
الصندوق	6.41	-	-	-	15.41
المؤشر القياسي	15.89	-	-	-	2.83
العوائد السنوية (%)	سنة واحدة	ثلاث سنوات	خمس سنوات	عشر سنوات	منذ التأسيس
الصندوق	6.41	-	-	-	9.78
المؤشر القياسي	15.89	-	-	-	1.85

خصائص الصندوق

نوع الصندوق	صندوق مفتوح
مقر الصندوق	العائلة العربية السعودية
مستوى المخاطرة	عالي
تاريخ التأسيس	سبتمبر 2021
السعر عند التأسيس	10 ريال سعودي للوحدة
عقبة الصندوق	ريال سعودي
المؤشر القياسي	إس آند بي لأسهم الشركات السعودية المتوافقة مع أحكام الشريعة
رسم الإشتراك	2.00%
أتعاب الإدارة	1.75% سنويا
أتعاب الأداء	-
الحد الأدنى للإشتراك	1,000 ريال سعودي
الحد الأدنى للإشتراك الإضافي	500 ريال سعودي
الحد الأدنى للاسترداد	500 ريال سعودي
أيام التقييم	يومياً - من يوم الأحد حتى يوم الخميس
آخر موعد لاستحقاق طلبات الإشتراك والاسترداد	قبل الساعة الخامسة مساءً - قبل يوم التقييم
موعد الإعتان والسداد	يوم العمل التالي يوم التعامل
تنفيذ التداول	ثالث يوم عمل
مدير الصندوق	الراجحي المالية
أمين الحفظ	شركة ألبيلد للاستثمار
	clientservices@albilad-capital.com

أخر الجوائز والترتيبات



لتواصل

شركة الراجحي المالية - إدارة العامة
طريق الملك فهد س.ب. 5561
الرياض 11432
العائلة العربية السعودية
مف: 920005856
البريد الإلكتروني: salesupport@alrajhi-capital.com
www.alrajhi-capital.com

إخلاء المسؤولية

شركة الراجحي المالية هي شركة تُرخّص من قبل هيئة السوق المالية بالرقم 37-07068. وتعدت العوالم حسب السعر المتغير المتغيرة ولا تعبر أداء الصندوق في العامين بدمياً على الأداء المستقر. كما أن هيئة الإحصاء في وحدات الصندوق متغير وقد تضمنت زيادة أو نقصان ومن الممكن أن يتبدل قيمة الإشتراك وسعر المساهم مبدئاً قبل من إتمام المساهم، وبذلك الإلتزام المترتب على الصندوق وعلى صرف أهله الإلتزام كد ثقل عمل مكتب الاستثمار وعلى المستثمر أن يتخلى عن الإلتزام ويصعبه المالي، ويخلف عليهم أخذ التصحية من خبراء في الإحصاء والشؤون القانونية قبل تعويلهم في أي منتج مالي أو صندوق استثماري. إن المعلومات المتصلة عن هذا الإلتزام توجد بوضوح وعلى المستثمر أن يقرأ ويتأكد من استيفاء جميع المعلومات المتصلة عن هذا الإلتزام في الصفحة الفردي في الشروط والخصائص الخاصة بهذا الصندوق.



إخلاء مسؤولية:

شركة الراجحي المالية، وهي شركة مرخصة من قبل هيئة السوق المالية بموجب الترخيص رقم 37-07068، ويقع مقرها الرئيسي في مدينة الرياض. ولأغراض الاطلاع والتوضيح فقط وليس لإظهار نتائج فعلية تم تحضير هذا المحتوى وينبغي أن لا تعتبر مشورة استثمارية أو أقتناع أو توصية بشأن ورقة مالية أو اتخاذ أو عدم اتخاذ قرار معين فيما يتعلق بأي عقد أو التزام أيا كان شكله أو أي مشورة استثمارية وبرايعي أن الأداء السابق لا يعتبر مؤشراً ولا ضماناً لتحقيق العوائد في المستقبل. وبما أن الاستثمار في أسواق الأسهم عرضة للتذبذب، فقيمة الوحدات والدخل المتوقع منها يكون عرضة للارتفاع والانخفاض أن قيمة الورقة المالية يمكن أن تتعرض لانخفاض مفاجئ وكبير قد يؤدي لخسارة تساوي المبلغ المستثمر وأن خسارة المستثمر قد لا تقتصر على كامل المبلغ الذي استثمره أو أودعه أصلاً، وأنه قد يضطر إلى دفع المزيد. قد تكون أسعار أو قيمة الأوراق المالية قابلة للتذبذب والتغيير والأسعار أو القيمة أو الدخل يمكن أن ينخفض ويمكن أن يسترد المستثمر مبلغاً أقل من المبلغ الذي استثمره، وبذلك تكون الاستثمارات في هذه الصناديق معرضة للخسارة الجزئية أو الكلية وأن دخل الورقة المالية يمكن أن يتغير ويمكن استخدام جزء من رأس المال المستثمر لدفع ذلك الدخل. بالإضافة إلى ذلك، إن الرسوم المفروضة على الصناديق كرسوم الاشتراك ورسوم الإدارة والأداء قد تنطبق وعليه كما أن هذه الرسوم قد تنطبق عليها ضريبة القيمة المضافة بمقدار 15%. علماً أن معدل الضرائب والاعفاءات قد يتغير مع الوقت، قد لا تكون ملائمة لجميع الأشخاص الذين يتلقون الإعلان، وأنه إذا كانت لديهم أي شكوك، فعليهم الرجوع إلى مستشارهم للاستثمار. حيث ينبغي أن ينظر المستثمرون في أوضاعهم الفردية والمالية كما ينبغي لهم الحصول على المشورة من الخبراء المختصين في مجالات الاستثمار والاستشارات القانونية قبل الدخول في منتج/صندوق معين. يمكن للراجحي المالية أن تستثمر في الصندوق أو في أوراق مالية ذات علاقة، إن شركة الراجحي المالية تملك أو قد تملك مركزاً استثمارياً أو حصة في الأوراق المالية ذات العلاقة ويمكن أن تكون قد قدمت الراجحي المالية خلال الاثني عشر شهراً السابقة مشورة مهمة أو خدمات أعمال أوراق مالية لمصدر الأوراق المالية المعنية أو أوراق مالية ذات علاقة. إن مصدر أي معلومات تتعلق بالأداء السابق للصندوق هو من شركة الراجحي المالية، مع العلم أنه يمكن التأكد من صحة هذه المعلومات عن طريق تقارير الأداء المتواجدة في موقع الشركة الإلكتروني. العائد الكلي بعد خصم جميع الرسوم والمصاريف. التغير في أسعار العملات يمكن أن يؤدي إلى تأثير سلبي على قيمة أو سعر أو دخل الورقة المالية. تتضمن شروط وأحكام كل صندوق من الصناديق معلومات تفصيلية ومحددة حول المنتج ومخاطرة وينبغي قراءة وتفهم هذه المعلومات قبل الدخول في أي اتفاقية من هذا القبيل. ويمكن الحصول على الشروط والأحكام والتقارير المالية لمالكي الوحدات بالإضافة إلى تقارير الأداء عن طريق المراكز الاستثمارية الخاصة بالراجحي المالية أو زيارة الموقع الإلكتروني www.alrajhi-capital.com