

صندوق الراجحي إم إس سي أي لمؤشر الأسهم السعودية متعدد العوامل

البيان الربع السنوي الثالث 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 استثمار عام مفتوح يهدف إلى تحقيق نمو متوسط إلى طويل الأجل لرأس المال من خلال تتبع أداء مؤشر إم إس سى أي للأسهم السعودية متعدد العوامل المتوافقة مع ضوابط الهيئة الشرعية للصندوق

ب. بيانات الصندوق:

1- تاريخ بدء الصندوق:

يعتبر صندوق مفتوح غير محدد المدة وقد بدأ تشغيل الصندوق بتاريخ28 / 05 /1440 هـ الموافق 03 / 02 /2019 م .

2- سعر الوحدة عند الطرح.

سعر الوحدة عند الطرح 10 ريال سعوى.

3- حجم الصندوق.

52,157,192.50

4- نوع الصندوق.

صندوق عام مفتوح من فئة الأسهم.

5- عملة الصندوق.

عملة الصندوق بالريال سعودي.

6- مخاطر الصندوق.

عالىة.

7- المؤشر الاسترشادي.

مؤشر إم إس سي أي للأسهم السعودية متعدد العوامل) المتوافق مع ضوابط الهيئة الشرعية للصندوق.

8- عدد مرات التوزيع.

لن يقوم الصندوق بتوزيع أي أرباح أو توزيعات نقدية على المستثمرين 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 پوجد

11-عدد أيام المتوسط المرجح.

لا ينطبق

12-حجم الصندوق (قبل خصم المصاريف).

52,325,089.51



ج. تعریفات:

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.

(Tracking Error)خطأ التتبع

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.

(Beta) -4

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 فى 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.	16.4868
.2	التغير في سعر الوحدة (مقارنة بالربع السابق).	%2.40-
.3	سعر الوحدة المزدوج لصناديق أسواق النقد، وصناديق أدوات الدين ذات الدخل الثابت (إن وُجد)	لا يوجد
.4	إجمالي وحدات الصندوق	3,163,565.20
.5	إجمالي صافي الأصول	52,157,192.50
.6	مكرر الربحية (P/E) (إن وُجد)	لا يوجد

ز. معلومات الصندوق كما في نهاية الربع المعنى (الشهر/ السنة)؛

البند	قيمة*	*%
1-نسبة الأتعاب الإجمالي (TER)	172,719.20	%0.33
2- نسبة الاقتراض (إن وُجدت)	لا يوجد	لا يوجد
3-مصاريف التعامل	2,960.18	%0.01
4-استثمار مدير الصندوق (إن وُجدت)	لا يوجد	لا يوجد
5-الأرباح الموزعة	لا يوجد	لا يوجد

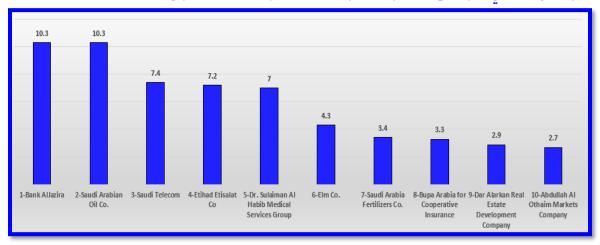
ح. بيانات ملكية استثمارات الصندوق:

 %100
 ملكية تامة
 -1

 %100
 حق منفعة
 -2

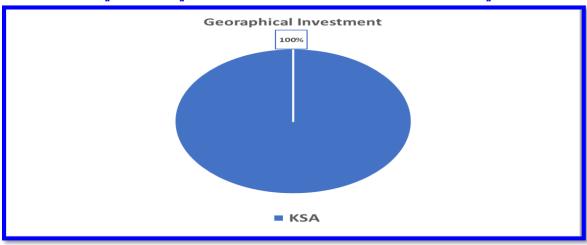


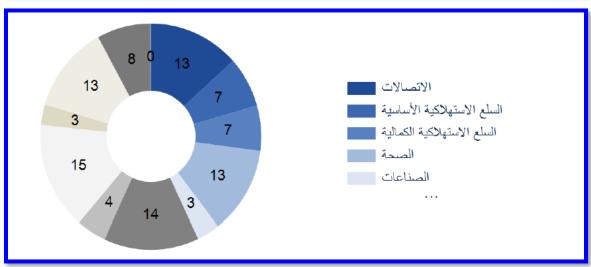
ي. رسم بياني يوضح أكبر عشرة استثمارات للصندوق:



كما هو أول يوم في الربع المعني.

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







ل. العائد:

5 سنوات	3 سنوات	سنة	سنة حتى تاريخه	3 أشهر	البند
		واحدة	(YTD	(نهاية الربع الحالي)	
-	49.76	3.72	12.86	2.35-	1-أداء الصندوق.
-	43.98	2.48	11.15	2.70-	2-أداء المؤشر الاسترشادي
					1,511 - 12 -
-	5.78	1.24	1.71	0.35	3- فارق الأداء
				طر:	م. الأداء والمخاد
5 سنوات	3 سنوات	سنة واحدة	سنة حتى تاريخه (YTD)	3 أشهر	معايير الأداء والمخاطر
			(110)	(نهاية الربع الحالي)	
-	18.74	16.68	4.82	2.36	1-الانحراف المعياري
-	0.82	0.30	0.30	1.12-	2- مؤشر شارب
-	0	0	1.06	2.36	3- خطأ التتبع
-	1.01	1.02	0.99	46.63	4-بيتا(Beta)
-	1.23	1.19	0.21	24.69-	5-ألفا (Alpha)

0.69

1.14

1.68

هـ للاتصال:

6-مؤشر المعلومات

1– رقم الماتف.

الاتصال على هاتف 8001245858

ومن خارج المملكة الاتصال على+966920005856

1.87-

2–الموقع الالكتروني.

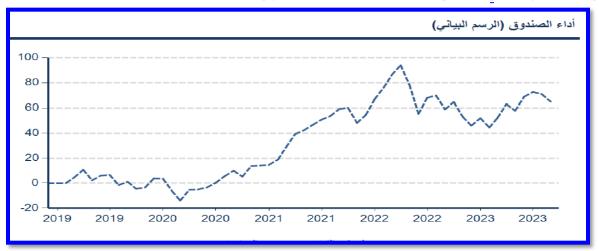
www.alrajhi-capital.com

3-البريد الالكتروني.

customerservice@alrajhi-capital.sa



ن – رسم بيانى يوضح الأداء منذ بداية الصندوق:



إخلاء مسؤولية:

شركة الراجحي المالية، وهي شركة مرخصة من قبل هيئة السوق المالية بموجب الترخيص رقم 37–07068، ويقع مقرها الرئيسي في مدينة الرباض. ولأغراض الاطلاع والتوضيح فقط وليس لإظهار نتائج فعلية تم تحضير هذا المحتوى وينبغى ان لا تعتبر مشورة استثمارية أو أقناع أو توصية بشأن ورقة مالية أو اتخاذ أو عدم اتخاذ قرار معين فيما يتعلق بأى عقد أو التزام أيا كان شكله او أى مشورة استثمارية ويراعي أن الأداء السابق لا يعتبر مؤشراً ولا ضماناً لتحقيق العوائد في المستقبل. وبما أن الاستثمار في أسواق الأسهم عرضة للتذبذب، فقيمة الوحدات والدخل المتحقق 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 او قيمة الأوراق المالية قابلة للتذبذب والتغيير والاسعار أو القيمة او الدخل يمكن أن ينخفض ويمكن أن يسترد المستثمر مبلغا أقل من المبلغ الذي استثمره ، وبذلك تكون الاستثمارات في هذه الصناديق معرضة للخسارة الجزئية أو الكلية وأن دخل الورقة المالية يمكن أن يتغير و يمكن استخدام جزء من رأس المال المستثمر لدفع ذلك الدخل. بالإضافة إلى ذلك، إن الرسوم المغروضة على الصناديق كرسوم الاشتراك ورسوم الإدارة والأداء قد تنطبق وعليه كما ان هذه الرسوم قد تنطبق عليها ضريبة القيمة المضافة بمقدار %15، علماً ان 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 الغردية والمالية كما ينبغى 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 مركزا استثماريا أو حصة في الأوراق المالية ذات العلاقة ويمكن أن تكون قد قدمت الراجحي المالية خلال الاثني عشر شهرآ 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 الالكتروني. 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 الالكتروني www.alrajhi-capital.com

البيان الربع السنوي الثالث للعام 2023م لصندوق الراجحي إم إس سي أي لمؤشر الأسهم السعودية متعدد العوامل متاح عند الطلب بدون مقابل ومتوفر في موقعنا الإلكتروني www.alrajhi-capital.com