



صندوق الراجحي للمضاربة بالبضائع – دولار أمريكي

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:

السعي لتحقيق نمو في رأس المال متناسب مع مستوى المخاطر المحدد للصندوق عن طريق الاستثمار في المضاربة بالبيضائع.

ب. بيانات الصندوق:

1- تاريخ بدء الصندوق:

يعتبر صندوق مفتوح غير محدد المدة بدأ الصندوق عمله في 27 جماد الأول 1411هـ الموافق 14 ديسمبر 1990م.

2- سعر الوحدة عند الطرح.

سعر الوحدة عند بداية الطرح يساوي 1000 دولار أمريكي.

3- حجم الصندوق.

780,427,566.94

4- نوع الصندوق.

صندوق عام مفتوح من فئة أسواق النقد.

5- عملة الصندوق.

عملة الصندوق بالدولار الأمريكي.

6- مخاطر الصندوق.

منخفضة.

7- المؤشر الاسترشادي.

المؤشر الاسترشادي للصندوق هو مؤشر سعر التمويل المضمون ليوم واحد (SOFR) فترة شهر واحد - TSFR1M.

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.

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

10- مستشار الاستثمار ومدير الصندوق من الباطن.

لا يوجد

11- عدد أيام المتوسط المرجح.

(144.20 يوما)

12- حجم الصندوق (قبل خصم المصاريف).

781,501,210,81

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):

9,035.08	1. سعر الوحدة كما في نهاية الربع المعني.
%2.45	2. التغير في سعر الوحدة (مقارنة بالربع السابق).
لا يوجد	3. سعر الوحدة المزودج لصناديق أسواق النقد، وصناديق أدوات الدين ذات الدخل الثابت (إن وُجد)
86,377.46	4. إجمالي وحدات الصندوق
780,427,566.94	5. إجمالي صافي الأصول
لا يوجد	6. مكرر الربحية (P/E) (إن وُجد)

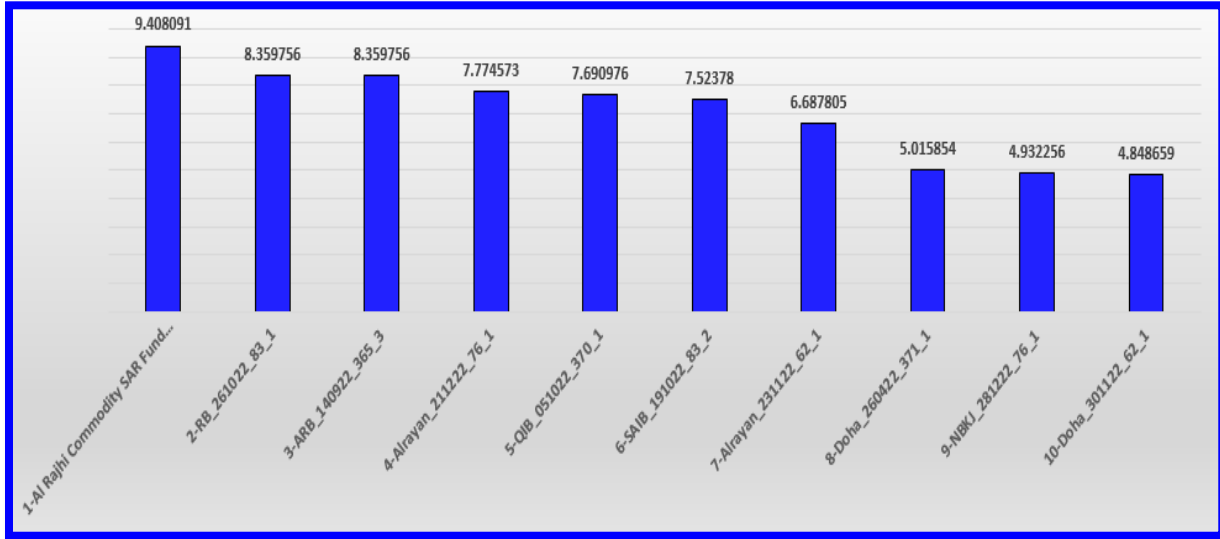
ز. معلومات الصندوق كما في نهاية الربع المعني (الشهر/ السنة):

%	قيمة	البند
%0.21	1,362,050.93	1-نسبة الأتعاب الإجمالي (TER)
لا يوجد	لا يوجد	2- نسبة الاقتراض (إن وُجدت)
%0.0004	2,802.94	3-مصاريف التعامل
لا يوجد	لا يوجد	4-استثمار مدير الصندوق (إن وُجدت)
لا يوجد	لا يوجد	5-الأرباح الموزعة

ح. بيانات ملكية استثمارات الصندوق:

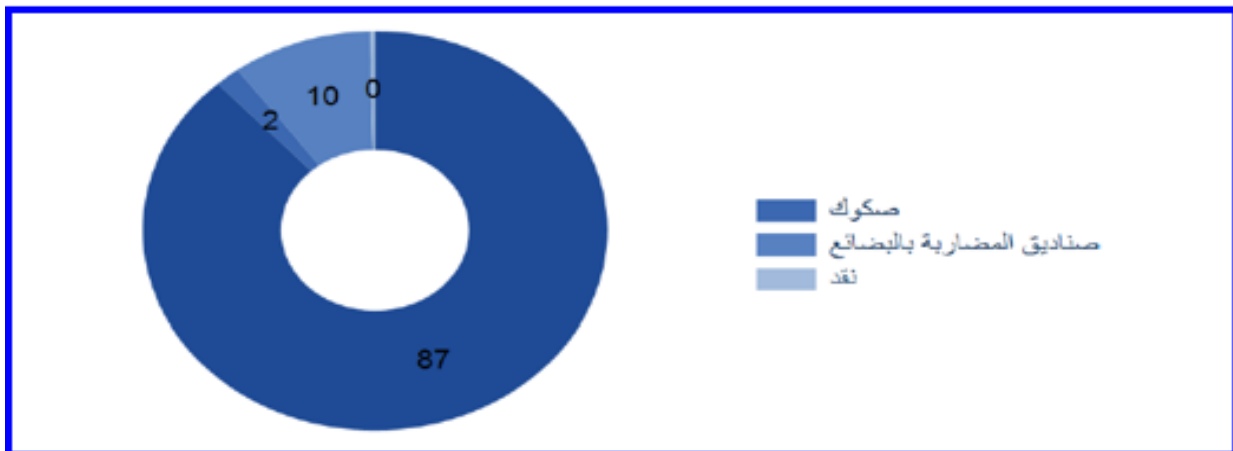
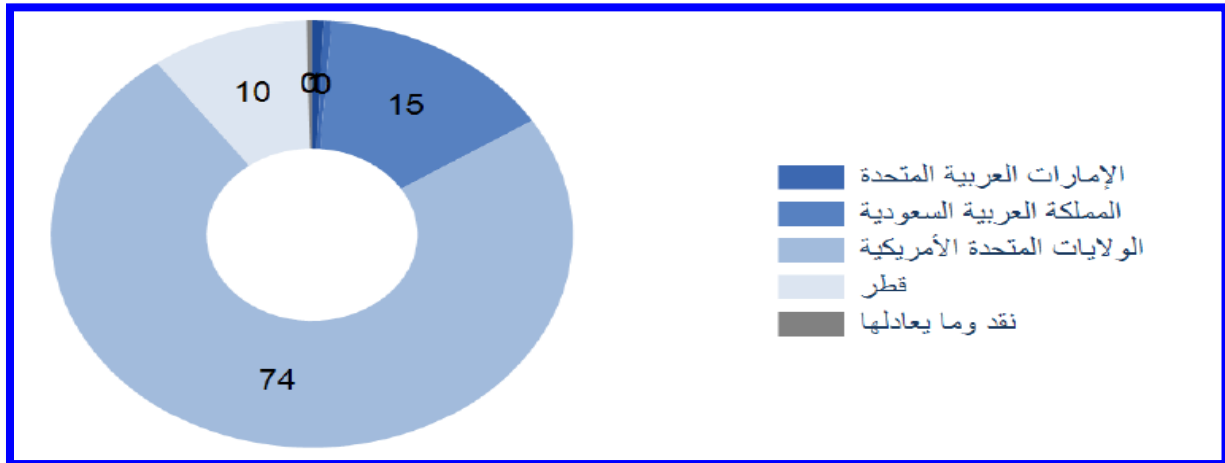
%100	1- ملكية تامة
%100	2- حق منفعة

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	سنة واحدة	3 سنوات	5 سنوات
	(نهاية الربع الحالي)	(YTD)			
1- أداء الصندوق.	1.00	1.00	2.51	4.37	9.38
2- أداء المؤشر الاسترشادي	1.16	1.16	3.48	4.02	8.85
3- فارق الأداء	0.16-	0.16-	0.97-	0.35	0.53

م. الأداء والمخاطر:

معايير الأداء والمخاطر	3 أشهر	سنة حتى تاريخه	سنة واحدة	3 سنوات	5 سنوات
	(نهاية الربع الحالي)	(YTD)			
11- الانحراف المعياري	0.06	0.06	0.33	0.30	0.27
2- مؤشر شارب	66.14	66.14	7.44	4.78	6.66
3- خطأ التتبع	0.02	0.02	0.15	0.24	0.20
4- بيتا (Beta)	0.75	0.75	0.89	0.57	0.61
5- ألفا (Alpha)	0.15-	0.15-	0.55-	0.68	0.77
6- مؤشر المعلومات	69.14-	69.14-	6.44-	0.46	0.49

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

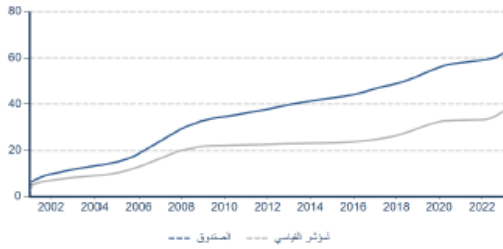
البيان الربع السنوي الأول للعام 2023م لصندوق الراجحي للمضاربة بالبضائع –
دولار أمريكي متاح عند الطلب بدون مقابل ومتوفر في موقعنا الإلكتروني

www.alrajhi-capital.com

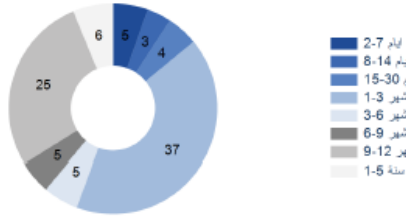
معلومات الأسعار – نهاية مارس 2023

▲	2,409,3566	دولار أمريكي	صافي قيمة الأصول للوحدة
%	0.35	دولار أمريكي	التغير (الشهر مقارنة بالسابق)
	86,377		اجمالي وحدات الصندوق
	208,114,018.31	دولار أمريكي	اجمالي صافي الأصول

إداء الصندوق (الرسم البياني)



تقسيم المحصن (نسبة إجمالي صافي الأصول)



التحليل الإحصائي

مؤشر التأسيس	عشر سنوات	خمس سنوات	ثلاث سنوات	سنة واحدة	الأداء
0.56	0.38	0.10	0.11	0.97-	العوائد الإضافية (%)
0.91	0.89	0.77	0.68	0.55-	تأخر (%)
-	-	-	-	-	المخاطرة
0.46	0.21	0.27	0.30	0.33	الحد الأقصى لتخلفات (%)
0.29	0.12	0.18	0.14	0.22	الانحراف المعياري (%)
0.83	0.56	0.61	0.57	0.89	مخاطر الانخفاض (%)
5.94	7.11	6.66	4.78	7.44	حساسية السوق
2.74	2.11	0.49	0.46	6.44-	بيتا
0.20	0.18	0.20	0.24	0.15	عوائد المخاطرة
					نسبة شارب
					مؤشر المعلومات
					نسبة الانحراف عن المؤشر

الهدف

تتمية رأس المال لأجل طويل، عن طريق الاستثمار في أسهم الشركات العالمية المتوافقة مع أحكام الشريعة الإسلامية في بلدان النمو، والمحفظة، ويوفر الصندوق السيولة للمستثمرين.

إداء الصندوق (الجدول)

المؤشر	سنة واحدة	ثلاث سنوات	خمس سنوات	عشر سنوات	مؤشر التأسيس
عدد أشهر الأداء الإيجابي	12.00	36.00	60.00	120.00	388.00
عدد أشهر الأداء المتفوق على المؤشر القياسي	-	23.00	37.00	90.00	308.00
العقد تعبير الأجل (%)	شهر واحد	ثلاثة أشهر	سنة أشهر	مؤشر بداية حتى تاريخه	مؤشر بداية العام
الصندوق	0.35	1.00	1.77	1.00	1.00
المؤشر القياسي	0.41	1.16	2.20	1.16	1.16
عائد على سنة (%)	2018	2019	2020	2021	2022
الصندوق	2.11	2.52	1.40	0.72	1.70
المؤشر القياسي	2.39	2.32	0.61	0.16	2.44
العوائد التراكمية (%)	سنة واحدة	ثلاث سنوات	خمس سنوات	عشر سنوات	مؤشر التأسيس
الصندوق	2.51	4.37	9.38	16.58	140.94
المؤشر القياسي	3.48	4.02	8.85	12.30	101.89
العوائد السنوية (%)	سنة واحدة	ثلاث سنوات	خمس سنوات	عشر سنوات	مؤشر التأسيس
الصندوق	2.51	1.44	1.81	1.55	2.76
المؤشر القياسي	3.48	1.32	1.71	1.17	2.20

خصائص الصندوق

نوع الصندوق	صندوق أسواق مالية مفتوح العائد
مقر الصندوق	العائلة العربية السعودية
مستوى المخاطرة	منخفض
تاريخ التأسيس	ديسمبر 1990
السرعة عند التأسيس	1000 دولار أمريكي للوحدة
عجلة الصندوق	دولار أمريكي
المؤشر القياسي	سرعة القفلة على القروض بصافرات لندن بالدولار - 3 شهور
رسم الإشتراك	لا يوجد
تأخر الإدارة	16.00% سنويا
تأخر الأداء	-
الحد الأدنى للإشتراك	دولار أمريكي 250
الحد الأدنى للإشتراك الإضافي	دولار أمريكي 100
الحد الأدنى للإسترداد	دولار أمريكي 100
أيام التقييم	يومياً - من يوم الأحد حتى يوم الخميس
آخر موعد لاستلام طلبات الإشتراك والإسترداد	قبل الساعة الخامسة مساءً - قبل يوم التقييم
موعد الإعلان والسداد	اليوم التالي ليوم التقييم
تنفيذ التداول	ثلاث يوم عمل
مدير الصندوق	الراجحي المالية
أمين الحفظ	شركة الحدد للاستثمار clientservices@albilad-capital.com

أخر الجوائز والترتيبات



لإيضاح

شركة الراجحي المالية إدارة العامة، طريق الملك فهد من بجدة، 5561 الرياض 11432، المملكة العربية السعودية، هاتف: 920005856، البريد الإلكتروني: salessupport@alrajhi-capital.com الموقع الإلكتروني: www.alrajhi-capital.com

إخلاء المسؤولية

شركة الراجحي المالية هي شركة فرعية تابعة لشركة الراجحي المالية العامة بالتصريح رقم 37-07068. وتحتب العروض حسب أسعار الأسهم المنتهية ولا يضمن أداء الصندوق في الماضي أو مستقبلياً على الأداء المستقبلي. كما أن قيمة الاستثمار في وحدات الصندوق متغير وقد تخضع لتقلبات أو التضخم. ومن الممكن أن تهمد قيمة الاستثمار ويحتمل انخفاضه بدلاً من ارتفاعه. وكذلك الأرباح التي تترتب على الصندوق وعلى سعر صرف العملة الأجنبية قد تتأثر بعمل معائن للاقتصاد وعلى المستثمرين أن يأخذوا بعين الاعتبار وضعهم المالي، وكذلك حجم أخذ التصعيد من خراف في الاستثمار والشؤون القانونية قبل دخولهم في أي منتج مالي أو صندوق استثماري. إن المعلومات المقدمة عن هذا الاستثمار توجد بوضوح وعلى المستثمر أن يقرأ ويحفظ من استيعاب جميع المعلومات المقدمة عن هذا الاستثمار في النسخة الواردة في الشروط والأحكام 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 أفناع 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 وبراغي 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 إن 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. التغيير 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