

صندوق الراجحي للأسهم السعودية للدخل

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 استثمار مفتوح يهدف إلى توزيع الدخل والنمو في المدى الطويل من خلال الاستثمار في الأسهم السعودية المتوافقة مع ضوابط الهيئة الشرعية.

ب. بيانات الصندوق:

1- تاريخ بدء الصندوق:

صندوق مفتوح غير محدد المدة وقد بدأ الصندوق في استلام الاشتراكات بتاريخ 1437/04/15 هـ الموافق 2016/01/25 م. وبدأ التشغيل بتاريخ 1437/04/16 هـ الموافق 2016/01/26 م.

2- سعر الوحدة عند الطرح.

سعر الوحدة عند الطرح 10 ريال سعودي.

3- حجم الصندوق.

248,601,256.41

4- نوع الصندوق.

صندوق عام مفتوح من فئة الأسهم

5- عملة الصندوق.

عملة الصندوق بالريال سعودي.

6- مخاطر الصندوق.

عالية.

7- المؤشر الاسترشادي.

مؤشر ستاندرد أند بورز للأسهم السعودية ذات التوزيعات النقدية المطابق للشريعة الإسلامية.

8- عدد مرات التوزيع.

تستحق التوزيعات النقدية إن وجدت في آخر يوم تقويمي من شهري أبريل وأكتوبر من الأرباح المستلمة من الشركات المستثمر بها والأرباح الرأسمالية المحققة أو إحداهما.

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 ينطبق

12- حجم الصندوق (قبل خصم المصاريف).

250,927,233.09

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):

22.3119	1. سعر الوحدة كما في نهاية الربع المعني.
%9.97	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)
11,142,107.98	4. إجمالي وحدات الصندوق
248,601,256.41	5. إجمالي صافي الأصول
لا يوجد	6. مكرر الربحية (P/E) (إن وُجد)

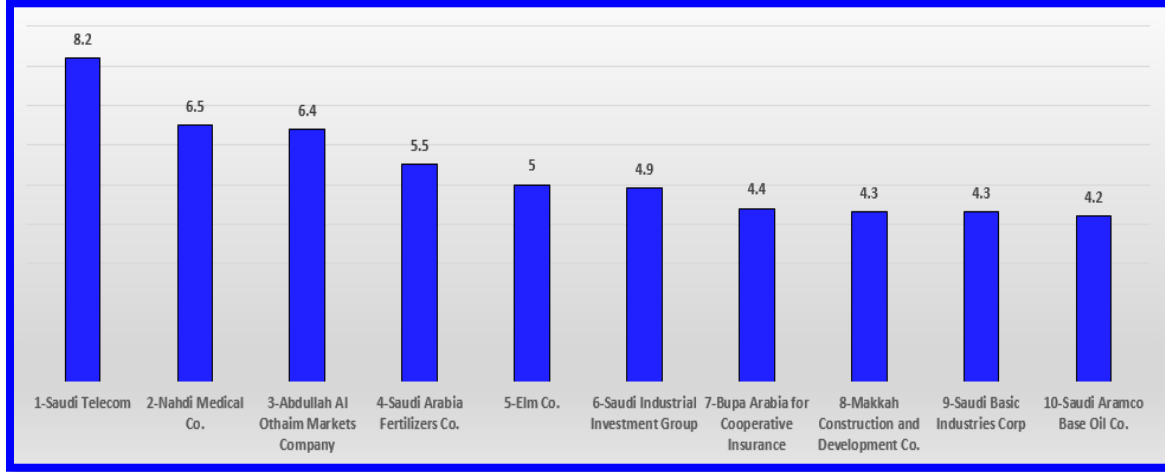
ز. معلومات الصندوق كما في نهاية الربع المعني (الشهر/ السنة):

البند	قيمة*	%
1-نسبة الأتعاب الإجمالي (TER)	1,437,450.21	%0.60
2- نسبة الاقتراض (إن وُجدت)	لا يوجد	لا يوجد
3-مصاريف التعامل	104,647.39	%0.04
4-استثمار مدير الصندوق (إن وُجدت)	لا يوجد	لا يوجد
5-الأرباح الموزعة	0.00	%0.00

ح. بيانات ملكية استثمارات الصندوق:

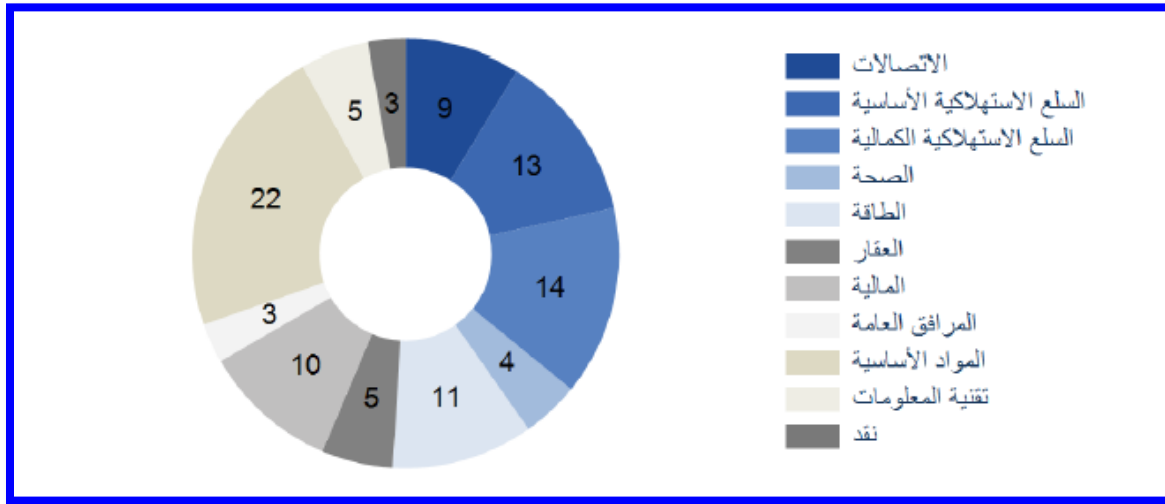
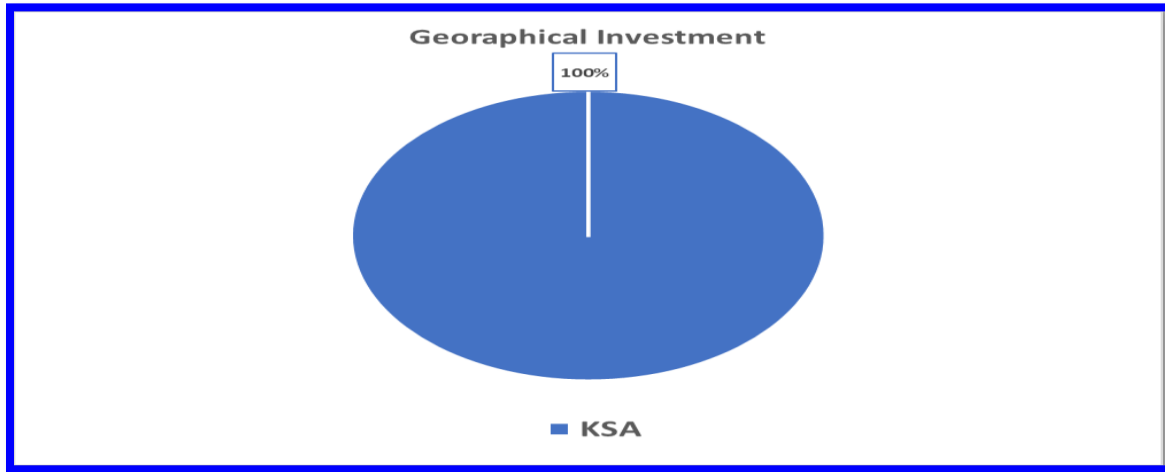
1- ملكية تامة	%100
2- حق منفعة	%100

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.	11.54	11.54	6.17-	128.23	106.08
2- أداء المؤشر الاسترشادي	5.22	5.22	15.53-	61.61	52.38
3- فارق الأداء	6.32	6.32	9.36	66.62	53.7

م. الأداء والمخاطر:

معايير الأداء والمخاطر	3 أشهر	سنة حتى تاريخه (YTD)	سنة واحدة	3 سنوات	5 سنوات
1- الانحراف المعياري	12.53	12.53	18.51	16.70	17.22
2- مؤشر شارب	3.61	3.61	0.25-	1.75	0.93
3- خطأ التتبع	10.51	10.51	5.73	4.66	4.57
4- بيتا (Beta)	0.56	0.56	1.18	1.03	1.01
5- ألفا (Alpha)	40.06	40.06	14.64	11.95	6.28
6- مؤشر المعلومات	2.41	2.41	2.00	2.59	1.38

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 للأسهم السعودية
للدخل متاح عند الطلب بدون مقابل ومتوفر في موقعنا الإلكتروني

www.alrajhi-capital.com

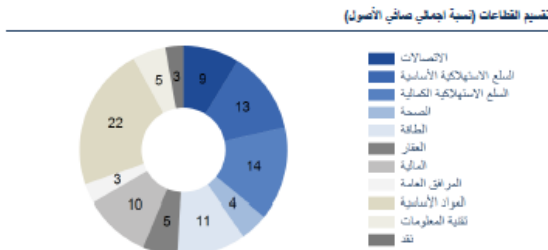
صندوق الراجحي للأسهم السعودية للدخل

للتبهر المنتهي مارس 2023

معلومات الأسعار - نهاية مارس 2023

صافي قيمة الأصول للوحدة	ريال سعودي	22.3132	▲
التغير (للتبهر مقارنة بالسابق)	ريال سعودي	1.6680	8.08 %
اجمالي وحدات الصندوق		11,142,108	
اجمالي صافي الأصول	ريال سعودي	248,816,083.77	

اداء الصندوق (الرسم البياني)



التبيل الاحصائي

الأداء	سنة واحدة	ثلاث سنوات	خمس سنوات	عشر سنوات	منذ التأسيس
العوائد الإضافية (%)	9.23	14.43	-	-	3.63
نقلا (%)	14.65	11.95	6.28	-	4.09
المخاطرة	سنة واحدة	ثلاث سنوات	خمس سنوات	عشر سنوات	منذ التأسيس
الحد الأقصى لاختلافات (%)	20.79	20.79	26.55	-	26.55
الانحراف المعياري (%)	18.52	16.70	17.22	-	16.56
مخاطر الانخفاض (%)	13.26	13.20	13.28	-	12.33
حساسية السوق	سنة واحدة	ثلاث سنوات	خمس سنوات	عشر سنوات	منذ التأسيس
بيتا	1.18	1.03	1.01	-	0.96
عوائد المخاطرة	سنة واحدة	ثلاث سنوات	خمس سنوات	عشر سنوات	منذ التأسيس
نسبة شارب	0.25	1.75	0.93	-	0.98
مؤشر المعلومات	2.00	2.59	1.38	-	0.71
نسبة الانحراف عن المؤشر	5.73	4.66	4.57	-	4.95

الهدف
تحقيق نمو مستمر في رأس المال من خلال توفير قدر مقبول من العائد والسوية المتخلقة من الاستثمارات تجارية قصيرة الأجل تلتزم بالمتطلبات الأمريكية وتتوافق المعيار الشرعية المقررة من الهيئة للشفرة للراجحي المالية.

اداء الصندوق (الجدول)

المؤشر	سنة واحدة	ثلاث سنوات	خمس سنوات	عشر سنوات	منذ التأسيس
عدد أشهر الأداء الإيجابي	6.00	27.00	41.00	-	58.00
عدد أشهر الأداء المتفوق على المؤشر القياسي	8.00	26.00	36.00	-	48.00
العائد قصير الأجل (%)	شهور واحد	ثلاثة أشهر	سنة أشهر	منذ بداية الربع حتى تاريخه	منذ بداية العام
الصندوق	8.08	11.53	5.93	11.55	11.55
المؤشر القياسي	5.15	5.22	1.88	5.22	5.22
عوائد كل سنة (%)	2018	2019	2020	2021	2022
الصندوق	11.53	9.24	20.13	37.64	0.43
المؤشر القياسي	13.27	14.48	11.90	18.89	6.67
العوائد الرتبية (%)	سنة واحدة	ثلاث سنوات	خمس سنوات	عشر سنوات	منذ التأسيس
الصندوق	5.77	134.21	-	-	200.29
المؤشر القياسي	15.01	85.84	52.38	-	138.75
العوائد السنوية (%)	سنة واحدة	ثلاث سنوات	خمس سنوات	عشر سنوات	منذ التأسيس
الصندوق	5.77	32.80	-	-	16.40
المؤشر القياسي	15.01	18.37	8.79	-	12.77

خصائص الصندوق

نوع الصندوق	صندوق مفتوح
مقر الصندوق	العمالة العربية السعودية
مستوى المخاطرة	عالي
تاريخ التأسيس	يناير 2016
السعر عند التأسيس	10 ريال سعودي للوحدة
علة الصندوق	ريال سعودي
المؤشر القياسي	مؤشر ستاندر أند بورز للأسهم السعودية ذات التوزيعات النقدية
رسم الاشتراك	2.00%
أرباح الإثارة	1.75% سنويا
أرباح الأداء	-
الحد الأدنى لاشتراك	5,000 ريال سعودي
الحد الأدنى لاشتراك الإضافي	2,000 ريال سعودي
الحد الأدنى لامتداد	2,000 ريال سعودي
أيام التقييم	مربعين أسبوعياً - يومي الأحد والأربعاء
آخر موعد لاستلام طلبات الاشتراك والامتداد	قبل الساعة الخامسة مساءً - قبل يوم التقييم
موعد الإيجاز والسداد	يومي الاثنين والخميس
تفويض التداول	ثالث يوم عمل
مدير الصندوق	الراجحي المالية
أمين الحفظ	شركة البلاد للاستثمار
	clientservices@albilad-capital.com

آخر الجوائز والترتيب



للإتصال
شركة الراجحي المالية - الفرع العامة
طريق الملك فهد من - 5561
الرياض 11432
العمالة العربية السعودية
هاتف: 920005856
البريد الإلكتروني: saessupport@alrajhi-capital.com الموقع الإلكتروني: www.alrajhi-capital.com

إخلاء المسؤولية
شركة الراجحي المالية هي شركة برخصة من قبل هيئة السوق المالية بالترخيص رقم: 37-07068. وتحتد العروض حسب أسعار الأسهم الشهرية ولا يضمن أداء الصندوق في الماضي مؤثرا على الأداء المستقبلي كما أن قيمة الاستثمار في وحدات الصندوق متغيرة وقد تخضع لتقلبات أو التقلبات. ويرى العميل أن يحدد قيمة الاستثمار وحسب المستثمر سئلا كما من الشأن المستثمر. وتتخذ الأفعال التي تتخذ على الصندوق وعلى سعر صرف العملة الأجنبية كالتداول على أساس العمل مع المستثمر من أن يتخذوا على الإخبار وتقييم العمل، وتتخذ العمل بعد التصديق من خبراء في الإخبار والتداول القانونية قبل تداولهم في أي منتج مالي أو صندوق استثماري. إن المعلومات المقدمة من هذا الإخبار توجد بوضوح وعلى المستثمر أن يقرأ ويتأكد من استيعاب جميع المعلومات المقدمة عن هذا الاستثمار في لائحة قراراته في الشروط والمواصفات 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 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 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 للملكي الوحدات بالإضافة إلى تقارير الأداء عن طريق المراكز الاستثمارية الخاصة بالراجحي المالية أو زيارة الموقع الإلكتروني www.alrajhi-capital.com