



صندوق الراجحي للأسهم السعودية

البيان الربع السنوي الثاني للعام 2022م

شركة الراجحي المالية هي شركة مرخص لها بالعمل وفق الترخيص رقم 07068-37 الصادر من هيئة السوق المالية ويقع المقر الرئيسي للشركة في مدينة الرياض



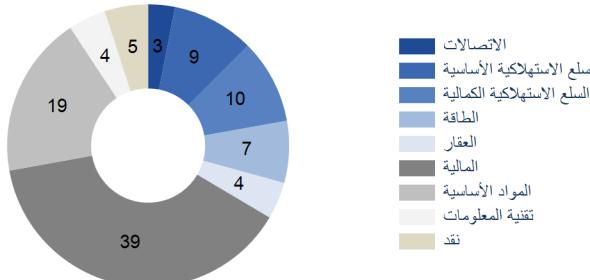
تحقيق نمو مستمر في رأس المال من خلال توفير قدر معقول من العائد والسيولة المحققة من استثمارات تجارية قصيرة الأجل تقيم بالدولار الأمريكي وتنفذ وفق المعايير الشرعية المقررة من الهيئة الشرعية للراجحي المالية.

معلومات الأسعار - نهاية يونيو 2022

▼ 937.0871	صافي قيمة الأصول الوحدة
% 10.61- 111.2131-	التغير (للشهر مقارنة بالسابق)
683.736	أجمالي وحدات الصندوق
640,719,978.53	أجمالي صافي الأصول
	أداء الصندوق (الرسم البياني)



تقسيم القطاعات (نسبة اجمالي صافي الأصول)



تحليل الاحصائي

الإداء	الإذاعة					
	منذ التأسيس	عشر سنوات	خمس سنوات	ثلاث سنوات	سنة واحدة	العام
العائد الإضافي (%)	0.44	3.23	4.60	9.51	15.57	(%)
العائد (%)	1.78	3.72	4.71	8.90	15.05	(%)
المخاطرة	منذ التأسيس	عشر سنوات	خمس سنوات	ثلاث سنوات	سنة واحدة	
الحد الأقصى للانخفاض (%)	62.47-	43.10-	23.53-	19.32-	16.11-	(%)
انحراف المعياري (%)	20.31	17.93	17.22	19.32	20.68	(%)
مخاطر الانخفاض (%)	14.34	13.50	13.11	15.17	16.97	(%)
حساسية السوق	منذ التأسيس	عشر سنوات	خمس سنوات	ثلاث سنوات	سنة واحدة	
بيانا	0.81	0.91	0.96	0.97	1.01	
عوائد المخاطرة	منذ التأسيس	عشر سنوات	خمس سنوات	ثلاث سنوات	سنة واحدة	
نسبة شارب	0.47	0.73	1.06	1.21	0.97	
مؤشر المعلومات	-	0.58	0.89	1.84	3.83	
نسبة الانحراف عن المؤشر	10.28	4.65	4.49	4.46	3.87	

المؤشر	أداء الصندوق (الجدول)					
	منذ التأسيس	عشر سنوات	خمس سنوات	ثلاث سنوات	سنة واحدة	العام
عد أشهر الأداء الإيجابي	203.00	76.00	41.00	26.00	9.00	
عد أشهر الأداء المتفوق على المؤشر القاسي	186.00	71.00	39.00	28.00	11.00	
العائد قصير الأجل (%)	منذ بداية العام حتى تاريخه	ستة أشهر	ثلاثة أشهر	شهر واحد	سنة واحدة	العام
الصندوق	7.35	11.39-	7.35	11.39-	10.61-	
المؤشر القاسي	1.25-	14.84-	1.25-	14.84-	12.18-	
عائد كل سنة (%)	2021	2020	2019	2018	2017	
الصندوق	48.62	19.41	10.46	11.44	2.75	
المؤشر القاسي	37.33	11.93	12.35	11.37	3.89	
العائد التراكمية (%)	منذ التأسيس	عشر سنوات	خمس سنوات	ثلاث سنوات	سنة واحدة	العام
الصندوق	837.19	213.79	129.62	89.26	19.42	
المؤشر القاسي	728.71	134.26	88.26	48.87	3.85	
العائد السنوية (%)	منذ التأسيس	عشر سنوات	خمس سنوات	ثلاث سنوات	سنة واحدة	العام
الصندوق	7.77	12.12	18.09	23.70	19.42	
المؤشر القاسي	7.32	8.89	13.49	14.18	3.85	

خصائص الصندوق

نوع الصندوق	صندوق أسهم مفتوح المدة
مقر الصندوق	المملكة العربية السعودية
مستوى المخاطرة	عالي
تاريخ التأسيس	1992 يونيو
السعر عند التأسيس	100 ريال سعودي للوحدة
عملة الصندوق	ريال سعودي
المؤشر القاسي	إبن آدم بي لأسهم الشركات السعودية المتفقة مع أحكام الشريعة
رسم الاشتراك	2.00%
أتعاب الإدارة	1.75% سنويًا
الحد الأدنى للاشتراك	5,000 ريال سعودي
الحد الأدنى للاشتراك الإضافي	2,000 ريال سعودي
الحد الأدنى للاسترداد	2,000 ريال سعودي يومياً - من الأحد حتى يوم الخميس
أيام التقديم	قبل الساعة الخامسة مساءً - قبل يوم التقديم
آخر موعد لاستلام طلبات الإشتراك والاسترداد	اليوم التالي لليوم التقديم
موعد الإعلان والسداد	ثلاث يوم عمل
تنفيذ التداول	الراجحي المالية
مدير الصندوق	شركة البلاد للاستثمار
أمين الحفظ	clientservices@albilad-capital.com

آخر الجوائز وترتيب



للاتصال

شركة الراجحي المالية الإدارية العامة،
طريق الملك عبد الله بن عبد العزيز،
الرياض 11432،
المملكة العربية السعودية.
هاتف: 920005856
بريد الإلكتروني: www.alrajhi-capital.com
العنوان الإلكتروني: salessupport@alrajhi-capital.com

الأخلاقي المسؤولية

شركة الراجحي المالية هي شركة مرخصة من هيئة السوق المالية بالترخيص رقم: 37-07068. وتحسب العروض حسب أسلوب الأشهر المنتهية ولا يغدر أداء الصندوق في الماضي مؤثراً على الأداء المستقبلي. كما أن الاستثمار في وحدات الصندوق مغامر وقد يتضمن للزيارة أو التنصاص. ومن الممكن أن تبيط قيمة الاستثمار ويسقط المستثمر ميلماً عن المبلغ المستثمر، وكذلك الأتعاب التي تترتبت على الصندوق وعلى سعر صرف العملة الأجنبية قد تبيط عامل معاكس للاستثمار. وعلى المستثمرين أن ياخذوا بعين الاعتبار وضعهم المالي، وكذلك عليهمأخذ الصيحة من خبراء في الاستثمار والشئون القانونية قبل دخولهم في أي منتج مالي أو صندوق استثماري. إن المعلومات المفصلة عن هذا الاستثمار توجد بوضوح وعلى المستثمر أن يقرأ ويتناول من يستعاب جميع المعلومات المفصلة عن هذا الاستثمار في اللائحة الواردة في الشروط والمواصفات الخاصة بهذا الصندوق.



١- تاريخ بدء الصندوق:

الصندوق يعتبر صندوق مفتوح غير محدد المدة وقد بدأ الصندوق عمله في 6 صفر 1413هـ الموافق 5 أغسطس 1992م.

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

٢- عدد مرات التوزيع.

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

٣- نسبة رسوم الإدارة للصناديق المستثمر فيها.

لا يستثمر الصندوق في أي صناديق أخرى.

٤- مستشار الاستثمار ومدير الصندوق من الباطن.

لا يوجد

٥- عدد أيام المتوسط المرجح.

لا يوجد

٦- حجم الصندوق (قبل خصم المصاري).

646,076,281,97

ج. تعریفات:

١- 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 للتباین ويسمى الانحراف المعياري بتحديد تأرجح أداء الصندوق في رقم واحد.



٢- مؤشر شارب.

مؤشر شارب أو Sharpe Ratio، يعبر عنه برقم عددي ويعبّر عن مدى الارتفاع أو الانخفاض الذي يمكن أن يتوقعه المستثمر مقارنة مع المعدل الحالي للمخاطر (مثل السنادات الحكومية) لكل وحدة مخاطرة (تقلب). علماً أن المعدل الحالي للمخاطر 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.

٣- 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 أكبر.

٤- بيتا (Beta)

معامل بيتا أو Beta، يعبر عنه برقم عددي وهي أدلة إحصائية لمقياس المخاطرة الذي يدل على حساسية الاستثمار ما تجاه تذبذبات السوق ككل، ويمثله في ذلك المؤشر الاسترشادي ذو الصلة. وعلى سبيل المثال، يخبرنا بيتا 1.20 بأنه يمكننا أن نتوقع أن تغير قيمة الصندوق الاستثماري بنسبة 20% أعلى من نسبة التحرك المتوقعة للسوق، وفي حال كانت بيتا 0.80 فإنه من المتوقع أن تغير قيمة الصندوق الاستثماري بنسبة 20% أقل من نسبة التحرك المتوقعة للسوق.

٥- ألفا (Alpha)

ألفا أو Alpha، يعبر عنه بنسبة مئوية وهو مقياس الفارق بين العائد بعد تعديل المخاطر في الاستثمار 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.

٦- مؤشر المعلومات.

مؤشر المعلومات أو Information Ratio، يعبر عنه بنسبة مئوية وهي أدلة 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 مدرب الصناديق الآخرين وحقق عوائد إيجابية خلال فترة محددة.



و. معلومات الأسعار كما في نهاية الربع المعنوي (الشهر/ السنة):

937,0871	1. سعر الوحدة كما في نهاية الربع المعنوي.
-0.11%	2. التغير في سعر الوحدة (مقارنة بالربع السابق).
لا يوجد	3. سعر الوحدة المزدوج لصناديق أسواق النقد، وصناديق أدوات الدين ذات الدخل الثابت (إن وجد)
683,735.78	4. إجمالي وحدات الصندوق
640,719,978.78	5. إجمالي صافي الأصول
لا يوجد	6. مكرر الربحية (P/E) (إن وجد)

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

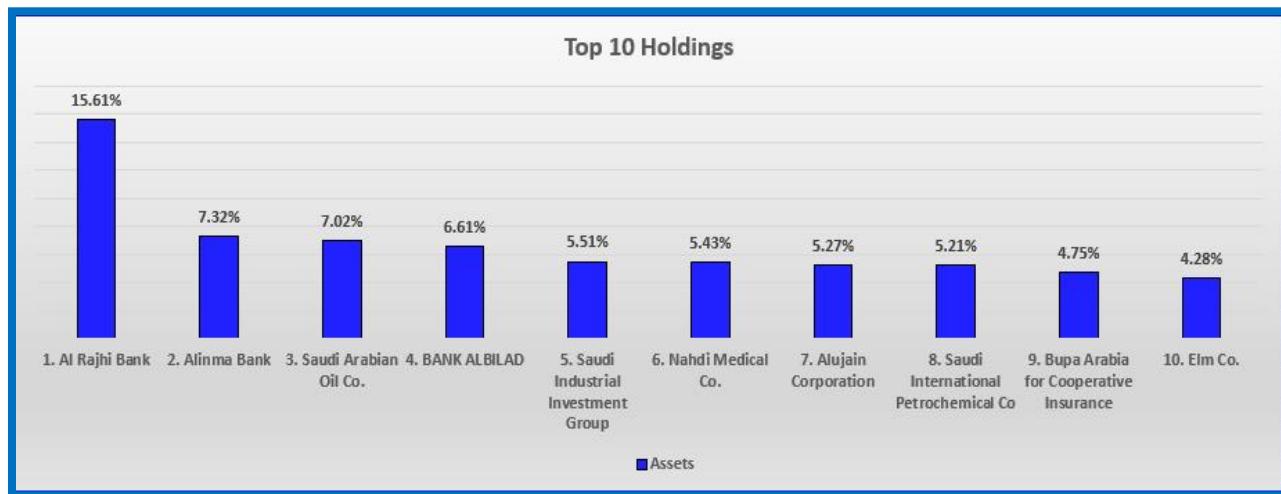
%	قيمة	البند
%0.56	3,968,737.37	1-نسبة الأتعاب الإجمالي (TER)
لا يوجد	لا يوجد	2- نسبة الاقتراض (إن وجدت)
%0.03	210,954.20	3-مصاريف التعامل
لا يوجد	لا يوجد	4-استثمار مدير الصندوق (إن وجدت)
لا يوجد	لا يوجد	5-الأرباح الموزعة

ح. بيانات ملكية استثمارات الصندوق:

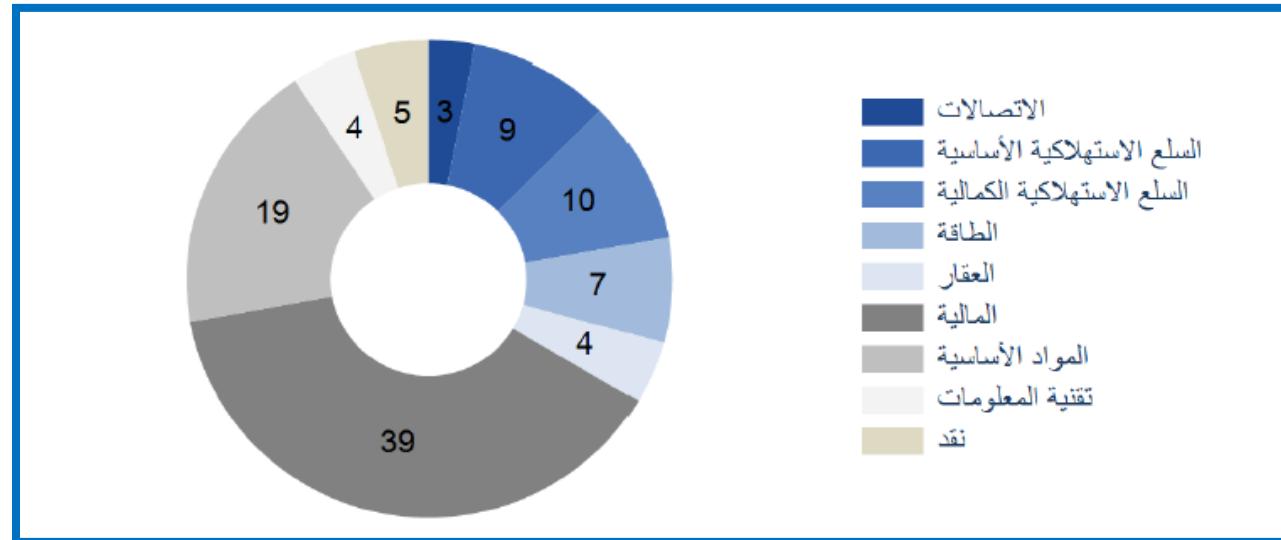
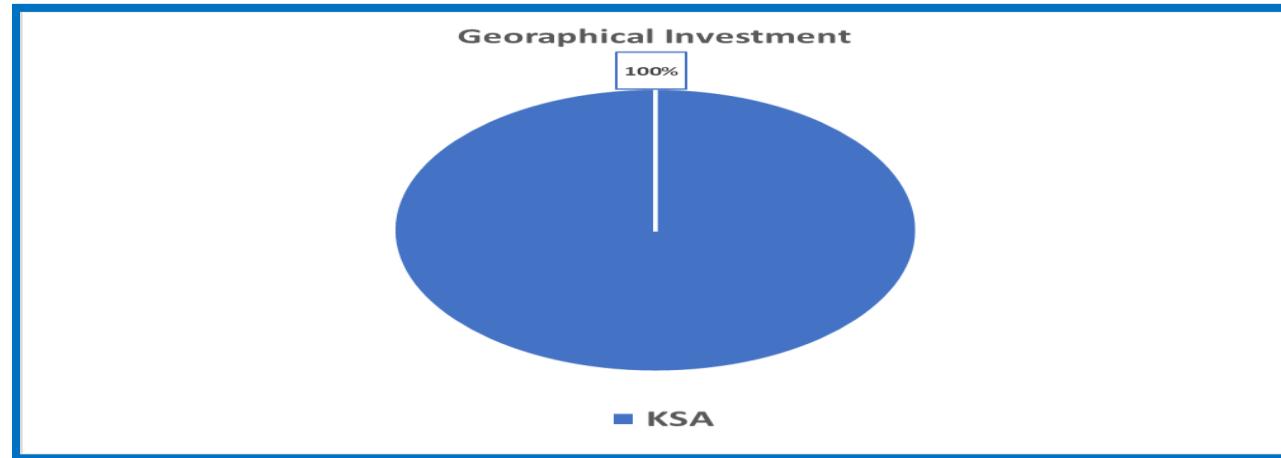
%100	-1 ملكية تامة
%100	-2 حق منفعة



ي. رسم بياني يوضح أكبر عشرة استثمارات للصندوق:



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





لـ. العائد:

البند	3 أشهر	سنة واحدة	سنة حتى تاريخه (YTD)	سنوات 3	سنوات 5
-أداء الصندوق.	11.39-	7.35	19.42	89.26	129.62

1-أداء الصندوق.	11.39-	7.35	19.42	89.26	129.62
2-أداء المؤشر الاسترشادي	14.84-	1.25-	3.85	48.87	88.26
3- فارق الأداء	-26.23	6.10	15.57	40.39	41.36

مـ. الأداء والمخاطر:

معايير الأداء والمخاطر	3 أشهر	سنة واحدة (YTD)	سنة حتى تاريخه	سنوات 3	سنوات 5
------------------------	--------	-----------------	----------------	---------	---------

1-الانحراف المعياري	23.74	25.30	20.68	19.32	17.22
2- مؤشر شارب	1.88-	0.69	0.97	1.21	1.06
3- خطأ التتبع	0.23	1.42	3.87	4.46	4.49
4-بيتا(Beta)	0.98	1.01	1.01	0.97	0.96
5-ألفا(Alpha)	14.90	18.27	15.05	8.90	4.71
6-مؤشر المعلومات	18.54	3.43	3.83	1.84	0.89

بيان الربع السنوي الثاني للعام 2022م لصندوق الراجحي للأسهم السعودية
متاح عند الطلب بدون مقابل ومتوفّر في موقعنا الإلكتروني

www.alrajhi-capital.com