



اهداف الصندوق

تتمثل أهداف الصندوق في تنمية رأس المال من خلال تحقيق قيمة مضافة إيجابية مقارنة بالمؤشر الاسترشادي مع تحمل أدنى مستوى ممكن من المخاطر وذلك من خلال الاستثمار في الإصدارات الأولية للشركات السعودية المساهمة وكذلك أسمع الشركات المدرجة حيثاً خلال أول خمس سنوات من إدراجها أو أخر 20 شركة مدرجة في السوق، كما يجوز لمدير الصندوق أن يستثمر بما لا يزيد عن 50% من صافي قيمة أصوله في أسهم الشركات المعودية الصغيرة والمتوسطة، وبما لا يزيد عن 30 %من صافي قيمة أصوله في الوحدات العقارية المتداولة ومالا يزيد عن 30 % من صافي قيمة أصوله في السوق الموازية نمو. حيث تكون جميع الاستثمارات متوافقة مع المبدئ الشرعية للصندوق.

	سمات الصندوق
3.22 M	حجم الصندوق (ريال سعودي)
15/12/2015	تاريخ بدء الصندوق
1.00	سعر الوحدة عند الانشاء (ريال سعودي)
1.70	سعر الوحدة عند نهاية الربع (ريال سعودي)
70.41%	التغير في سعر الوحدة %
-2.38%	التغير في سعر الوحدة (مقارنة بالربع السابق)
دارات الأولية المتوافقة مع الضوابط الشرعية	المؤشر الارشادي مؤشر أصول و بخيت للمتاجرة بأسهم الإص
ريال سعودي	عملة الصندوق
عالي المخاطر	مستوى المخاطر
مفتوح	نوع الصندوق

%	القيمة	معلومات الصندوق
0.29%	9,218.96	نسبة الاتعاب الاجمالية
0.00%	لا يوجد	نسبة الاقتراض
0.01%	407	مصاريف التعامل
0.00%	لا يوجد	استثمار مدير الصندوق
0.00%	لا يوجد	الأرباح الموزعة
	1.89 M	عدد الوحدات
	3.22 M	اجمالي صافي الأصول
حق المنفعة	ملكية تامة	بيانات ملكية استثمار الصنده ق

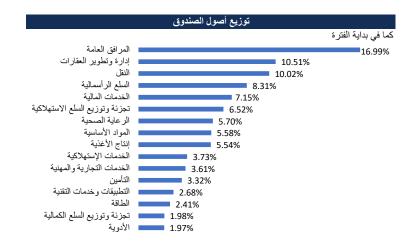
ملکیه	بيانات ملكية استنمار الصندوق	
00%		

السعودية.	العربية	المملكة	ات داخل	الاستثمار	جميع

	لصندوق	أداء اا	
القا	المؤشر الإرشادي	الصندوق	
(0.75%)	3.57%	2.82%	شهر
2.90%	-5.28%	-2.38%	ثلاثة أشهر
2.52%	-16.87%	-14.35%	منذ بداية السنة
3.69%	-20.95%	-17.26%	سنة
16.30%	7.24%	23.54%	ثلاث سنوات
▲ 31.33%	34.13%	65.46%	خمس سنوات

			4 1		
		ات الصندوق	إحصائي		
مؤشر المعلومات	خطأ التتبع	بيتا	مؤشر شارب	الانحراف المعياري	
-0.53	1.42%	0.82	-0.69	4.10%	شهر
1.05	2.76%	0.78	-1.38	5.78%	ثلاثة أشهر
0.51	4.97%	0.85	-1.30	15.32%	منذ بداية السنة
0.61	6.04%	0.82	-1.43	15.93%	سنة
1.47	11.05%	0.78	0.80	22.21%	ثلاث سنوات
2.40	13.03%	0.80	2.18	28.14%	خمس سنوات
		ىفحة (2)	وق موضح في الص	شرات وإحصائيات الصند	توضيح احتساب مؤ





Saudi Arabia - Riyadh 11526





P.O.Box 63762 Info@obic.com.sa www.obic.com.sa F. +966 11 419 1899 T. +966 920028287

شركة مساهمة مدرجة برأس مال 81 مليون ريال مدفوعة بالكامل ومقرها الرئيسي بالرياض, ترخيص هيئة السوق المالية رقم (60-08120), سجل تجاري رقم 1010219805, رقم العضوية في الغرفة التجارية: 67366

إلحاج المستولية. بذلت شركة أصول و بخيت الاستثمارية أقصى جهد ممكن للتأكد من أن محترى المعلومات المذكورة أعلاه صحيحة ودقيقة ومع ذلك فإن شركة أصول و بخيت الاستثمارية لا تقدم أي ضمانات بشأن مختويات اللتقرير و كما نالقت المعلومات ليست مخصصة للأغراض الدعائية ولا تشكل توصية بشراء أو بيع أوراق مالية أو لاتخذا قرار استثماري . ويجب الانتباه ابن الاستثمار في الأسهم أو الأدوات الاستثمار فياته المن يتطبق المستثمار المتثمارية تنطوي على تنذيذبت في القيمة تعكن درجة عالية من المخاطر وقد لا تكون مناسبة لكل مستثمر للاستثمار في المنتفلي ولا تضمن شركة أصول و بخيت الاستثمارية بأن هذا الأداء سبتكرر أو منابعة مناسبة لكل مستثمر للاستثمار فيهوا للأسائل المتعلقة بصناديق ومنتجت أصول و بخيت الاستثمارية برج الانتباه أن الأداء السائق إلى ورقاع مالية أو للمؤشر الاسترشادي لا يشكل مؤشر أللاداء المستقبلي ولا تضمن شركة أصول و بخيت الاستثمارية بأن هذا الأداء سبتكرن ممثلاً في المستقبل بلوحوط المي الشركة : الرياض، طريق الملك فهة، برج البحرين، دور الميزانين.



بيان المعادلات المستخدمة لاحتساب معايير الأداء والمخاطر:

$ $ المعادلة: $(1 - R_1 N_1 N_1 R_1 R_2 R_2 R_3 N_2 R_3 R_3 R_4 R_4 R_4 R_4 R_5 $	بيان المعادلات المستخدمة لاحتساب معايير الأداء والمخاطر:
$\sigma = V(\Sigma(R_1 - R)^2/(N - 1))$ قياس تذبذب العوائد σ قياس تذبذب العوائد σ عائد كل فترة σ عائد كل فترة σ المعادلة: σ مؤسط العائد كل فترة σ مؤشر شارب عدد الفترات σ	إحصائيات الصندوق
قياس تذبذب العوائد σ عائد كل فترة γ الدرة γ متوسط العائد كل فترة γ متوسط العائد γ متوسط العائد γ المعادلة: γ	الانحراف المعياري
قياس تذبذب العوائد $\leftarrow \sigma$ عائد كل فترة $\leftarrow \beta$ عائد كل فترة $\leftarrow \beta$ متوسط العائد $\leftarrow \beta$ متوسط العائد $\rightarrow \beta$ عدد الفترات $\rightarrow \beta$ Sharpe = $(R_p - Rf) / \sigma_p$ المعادلة: $\rightarrow \beta$ Sharpe = $(R_p - Rf) / \sigma_p$ المعادلة: $\rightarrow \beta$	$\sigma = V(\Sigma(R_i - \bar{R})^2 / (N - 1))$ المعادلة:
متوسط العائد $\leftarrow R$ عدد الفترات $\sim N$ عدد الفترات $\sim N$ عدد الفترات $\sim N$ عدد الفترات $\sim N$ عائد الصندوق $\sim N$ المعادلة: $\sim N$ $\sim N$ Sharpe = $\sim N$ $\sim N$ Sharpe = $\sim N$ $\sim N$ Sharpe = \sim	
عدد الفترات $N \rightarrow o$ مؤشر شارب موشر شارب مالد الصندوق $P_p - R_p / P_m - R_p / P_m$ عائد الصندوق $P_p - R_m / P_m - R_m / P_m$ العائد الخالي من المخاطر $P_m - R_m / P_m / P_m / P_m$ مخاطر الصندوق الكليه $P_m - R_m / P_m / $	عائد کل فترة <i>→</i> عائد
مؤشر شارب Sharpe = $(R_p - Rf) / \sigma_p$ المعادلة: $G_p - Rf / \sigma_p - Rf$ المعادلة العالى من المخاطر $R_p - Rf$ العائد الخالى من المخاطر $R_p - Rf$ المعادلة الغالى من المخاطر الصندوق الكليه $\sigma_p - Rf$ المعادلة الغيرات السوق $\sigma_p - Rf / rf$ المعادلة الغيرات المشترك بين الصندوق والسوق $\sigma_f - Rf / rf$ المعادلة المعادلة الموقى المعادلة الموقى عن الصندوق $\sigma_f - Rf / rf$ المعادلة المؤشر المرجعي $\sigma_f - Rf / rf$ المعادلة المؤشر المرجعي $\sigma_f - Rf / rf$ عائد المؤشر الموقى مقارنة بالمؤشر $\sigma_f - Rf / rf$ العائد الإضافي للصندوق مقارنة بالمؤشر $\sigma_f - Rf / rf$ العائد الإضافي للصندوق مقارنة بالمؤشر $\sigma_f - Rf / rf$ العائد الإضافي للصندوق مقارنة بالمؤشر $\sigma_f - Rf / rf$ العائد الإضافي للصندوق مقارنة بالمؤشر $\sigma_f - Rf / rf$ العائد الإضافي الصندوق مقارنة بالمؤشر $\sigma_f - Rf / rf$ العائد الإضافي الصندوق مقارنة بالمؤشر $\sigma_f - Rf / rf$	متوسط العائد→ R̄
$Sharpe = (R_p - Rf) / \sigma_p > Il Narle Legi \leftarrow R_p - Rf Apple 10 Sharpe Sharpe Rep - R$	
عائد الصندوق R_p مخاطر الصندوق الكليه R_p العيائد الخالي من المخاطر R_p مخاطر الصندوق الكليه R_p	
Rf العائد الخالي من المخاطر Rf σ_p مخاطر الصندوق الكليه σ_p البيتا σ_p البيتا σ_p حساسية الصندوق لتفيرات السوق σ_p عائد الموشر السوق σ_p عائد المؤشر السوق σ_p عائد المؤشر السوق σ_p عائد المؤشر السوق σ_p عائد المؤشر السوق σ_p عائد المؤثر السوق σ_p عائد المؤثر السوق σ_p عائد المؤثر السوق σ_p عائد المؤثر السوق σ_p عائد المندوق والسوق σ_p عائد الصندوق والسوق σ_p عائد الصندوق σ_p عائد الصندوق σ_p عائد المؤثر σ_p عائد المؤثر σ_p عائد المؤثر σ_p عائد المؤثر المعلومات عائد المؤثر المحادلة: σ_p عائد المؤثر المرجعي σ_p عائد المؤثر المورديق مقارنة بالمؤثر σ_p المعادلة: σ_p عائد المندوق σ_p مقارنة بالمؤثر σ_p المعادلة: σ_p مقارنة بالمؤثر σ_p	Sharpe = $(R_p - Rf) / \sigma_p$ المعادلة:
$\sigma_{p} ightarrow color by the proof of th$	<u> </u>
$ \textbf{لبيتا} \\ \textbf{ المعادلة: } \textbf{ B} = Cov(R_p, R_m) / Var(R_m) Interval in the proof of the proof o$	
$\beta = \text{Cov}(R_p, R_m) \ / \text{Var}(R_m)$ Narletie N	
حساسية الصندوق لتفيرات السوق \in R $_{\rm R}$ عائد الصندوق لتفيرات السوق \in R $_{\rm R}$ عائد المؤشر السوق \in R $_{\rm m}$ عائد المؤشر السوق \in Cov عائد المؤشر السوق \in والسوق \in Cov التباين المشترك بين الصندوق والسوق \in $=$ $=$ $=$ $=$ $=$ $=$ $=$ $=$ $=$ $=$	
عائد الصندوق \leftarrow R_m عائد المؤشر السوقي \leftarrow R_m عائد المؤشر السوقي \leftarrow R_m التباين المشترك بين الصندوق والسوق \leftarrow Cov خطأ التتبع	
عائد المؤشر السوقي \leftarrow R_m التباين المسترك بين الصندوق والسوق \leftarrow Cov \rightarrow \leftarrow	
Cov التباين المشترك بين الصندوق والسوق \leftarrow Cov خطأ التتبع خطأ التتبع خطأ التتبع $= V(\Sigma(R_p - R_m)^2 / (N-1))$ المعادلة: $= V(\Sigma(R_p - R_m)^2 / (N-1))$ $= V(\Sigma(R_p - R_m)^2 / (N-1))$ عائد الصندوق $= V(\Sigma(R_p - R_m))$ عائد المؤشر $= V(\Sigma(R_m - R_m))$ عائد المؤشر $= V(\Sigma(R_m - R_m))$ كفاءة تحقيق العوائد النشطة $= V(\Sigma(R_m - R_m))$ $= V(\Sigma(R_m - R_m))$ عائد المؤشر المرجعي $= V(\Sigma(R_m - R_m))$ $= V(\Sigma(R_m - R_m)$	
خطأ التتبع خطأ التتبع خطأ التتبع $= \frac{1}{2}$ المعادلة: ($= \frac{1}{2}$ (
$TE = V(\Sigma(R_p - R_m)^2/(N-1))$ $TE = V(\Sigma(R_p - R_m))^2/(N-1)$ $TE = V(\Sigma(R_p - R_m))$ $TE = V(\Sigma$	
مدى إنحراف أداء السوق عن الصندوق \leftarrow R $_{\rm p}$ عائد الصندوق \leftarrow R $_{\rm m}$ عائد المؤشر \leftarrow R $_{\rm m}$ عدد الفترات \leftarrow N مؤ شر المعلومات مؤشر المعادلة: $=$ N مؤشر المعلومات مؤشر المعادلة: $=$ N مؤشر المعلومات مؤشر المعادلة: $=$ N المعادلة: $=$ N المعادلة: $=$ N المؤشر المرجعي $=$ N عائد المؤشر المرجعي $=$ N عائد المؤشر المرجعي $=$ N عائد المؤشر المرجعي $=$ N المعادلة: $=$ N المعادلة: $=$ Alpha $=$ AR $=$ Alpha $=$ A	
عائد الصندوق $\left\langle R_{\rm m} \right\rangle$ عائد المؤشر $\left\langle R_{\rm m} \right\rangle$ عدد الفترات $\left\langle N \right\rangle$ المعادلة: $\left\langle N \right\rangle$ $\left\langle N $	
$R_{\rm m} ightarrow R_{\rm m}$ عدد الفترات $\sim N$ عدد الفترات $\sim N$ عدد الفترات $\sim N$	
عدد الفترات $ ho N$ مؤ شر المعلومات مؤشر المعادلة: $ ho R_p - R_m ho$ $ ho R_m = (R_p - R_m) / TE$ المعادلة: $ ho R_p = R_m$ عائد الصندوق $ ho R_p = R_m$ عائد المؤشر المرجعي $ ho R_m = R_m$ عائد المؤشر المرجعي $ ho R_m = R_m$ خطأ التتبع $ ho R_m = R_m$ ألفا $ ho R_m = R_m = R_m$ المعادلة: $ ho R_m = R_m = R_m$ المائد الإضافي للصندوق مقارنة بالمؤشر $ ho R_m = R_m$ التغير في أداء الصندوق $ ho R_p = R_m$	·
مؤ شر المعلومات $IR = (R_p - R_m) / TE$ المعادلة: $IR = (R_p - R_m) / TE$ كفاءة تحقيق العوائد النشطة \leftarrow IR $R_p \rightarrow S$ عائد الصندوق \leftarrow R_p a structure $R_m \rightarrow S$ عائد المؤشر المرجعي $TE \rightarrow S$ خطأ التتبع $TE \rightarrow S$ خطأ التتبع $TE \rightarrow S$ المعادلة: $Alpha = \Delta R_p - \Delta R_m$ العائد الإضافي للصندوق مقارنة بالمؤشر \leftarrow Alpha $Alpha \rightarrow S$ التغير في أداء الصندوق $\rightarrow S$	
$IR = (R_p - R_m) / TE$ المعادلة: $IR = (R_p - R_m) / TE$ كفاءة تحقيق العوائد النشطة $\leftarrow R_p$ عائد الصندوق $\leftarrow R_m$ عائد المؤشر المرجعي $\leftarrow R_m$ عائد المؤشر المرجعي $\leftarrow TE$ خطأ التتبع $\leftarrow TE$ المعادلة: $\Delta R_p - \Delta R_m = R_m$ المعادلة: $\Delta R_p - \Delta R_m = R_m$ العائد الإضافي للصندوق مقارنة بالمؤشر $\leftarrow Alpha$	
$egin{align*} \begin{subarray}{c} su$	
عائد الصندوق \leftarrow R_p عائد المؤشر المرجعي \leftarrow R_m عائد المؤشر المرجعي \leftarrow \rightarrow	
عائد المؤشر المرجعي $R_{\rm m}$ خطأ النتبع TE خطأ النتبع TE الفا $Alpha = \Delta R_{\rm p} - \Delta R_{\rm m}$ المعادلة: $\Delta R_{\rm p} - \Delta R_{\rm m}$ العائد الإضافي للصندوق مقارنة بالمؤشر $Alpha$ التغير في أداء الصندوق $AR_{\rm p}$	
خطأ النتبع \leftarrow TE ${}$ ألفا $Alpha = \Delta R_p - \Delta R_m$ المعادلة: $\Delta R_p - \Delta R_m = \Delta R_p$ Alpha العائد الإضافي للصندوق مقارنة بالمؤشر $\Delta R_p = \Delta R_p$ التغير في أداء الصندوق $\Delta R_p = \Delta R_p$	
ألفا Alpha = $\Delta R_p - \Delta R_m$ المعادلة: $\Delta R_p - \Delta R_m$ Alpha $+ \Delta R_p - \Delta R_m$ العائد الإضافي للصندوق مقارنة بالمؤشر $+ \Delta R_p$ التغير في أداء الصندوق $+ \Delta R_p$	
العائد الإضافي للصندوق مقارنة بالمؤشر \leftarrow Alpha التغير في أداء الصندوق \rightarrow $\Delta R_{ m p}$	· ·
العائد الإضافي للصندوق مقارنة بالمؤشر \leftarrow Alpha التغير في أداء الصندوق \rightarrow $\Delta R_{ m p}$	Alpha = $\Delta R_p - \Delta R_m$ المعادلة:
التغير في أداء الصندوق→ ΔR _p	
	$\Delta \hat{R}_{ m m}$ التغير في أداء المؤشر