

اهداف الصندوق

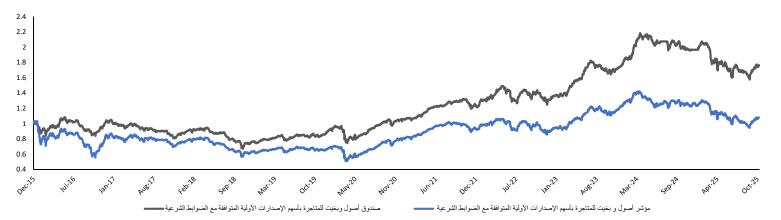
تتمثل أهداف الصندوق في تنمية رأس المال من خلال تحقيق قيمة مضافة إيجابية مقارنة بالمؤشر الاسترشادي مع تحمل أننى مستوى ممكن من المخاطر وذلك من خلال الاستثمار في الإصدارات الأولية للشركات السعودية المساهمة وكذلك أسهم الشركات المدرجة حديثاً خلال أول خمس سنوات من إدراجها أو آخر 20 شركة مدرجة في السوق، كما يجوز لمدير الصندوق أن يستثمر بما لا يزيد عن 50% من صافي قيمة أصول الصندوق في أسهم الشركات المدرجة في السوق الموازية نمو. حيث تكون جميع الاستثمارات متوافقة مع المبدئ الشرعية المستدوق.

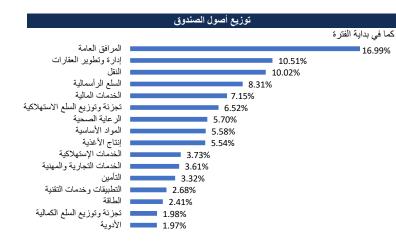
%	القيمة	معلومات الصندوق	سمات الصندوق	
0.30%	10,086.43	نسبة الاتعاب الاجمالية	3.33 M	حجم الصندوق (ريال سعودي)
0.00%	لا يوجد	نسبة الاقتراض	15/12/2015	تاريخ بدء الصندوق
0.03%	874	مصاريف التعامل	1.00	سعر الوحدة عند الانشاء (ريال سعودي)
0.00%	لا يوجد	استثمار مدير الصندوق	1.76	سعر الوحدة عند نهاية الشهر (ريال سعودي)
0.00%	لا يوجد	الأرباح الموزعة	76.26%	التغير في سعر الوحدة %
	1.89 M	عدد الوحدات	3.4361%	التغير في سعر الوحدة (مقارنة بالشهر السابق)
	3.33 M	اجمالي صافي الأصول	ول و بخيت للمتاجرة بأسهم الإصدارات الأولية المتوافقة مع الضوابط الشرعية	المؤشر الارشادي مؤشر أص
حق المنفعة	ملكية تامة	بيانات ملكية استثمار الصندوق	ريال سعو دي	عملة الصندوق
0%	100%		عالي المخاطر	مستوى المخاطر
	سعودية.	جميع الاستثمارات داخل المملكة العربية ال	مفتوح	نوع الصندوق

أداء الصندوق							
اثقا	المؤشر الإرشادي	الصندوق					
(1.44%)	4.88%	3.44%	شهر				
(1.00%)	5.99%	4.99%	ثلاثة أشهر				
1.41%	-12.81%	-11.40%	منذ بداية السنة				
3.10%	-13.39%	-10.29%	سنة				
16.49%	10.26%	26.75%	ثلاث سنوات				
2 9.88%	50.99%	80.87%	خمس سنوات				

إحصائيات الصندوق							
	الانحراف المعياري	مؤشر شارب	بيتا	خطأ التتبع	مؤشر المعلومات		
شهر	2.79%	-0.64	0.82	0.80%	-1.79		
ثلاثة أشهر	5.45%	-0.08	0.78	2.30%	-0.43		
منذ بداية السنة	15.59%	-1.09	0.85	5.03%	0.28		
سنة	15.80%	-1.00	0.84	5.58%	0.56		
ثلاث سنوات	22.08%	0.95	0.78	11.01%	1.50		
خمس سنوات	27.65%	2.77	0.80	12.97%	2.30		
توضيح احتساب مؤث	ئىرات وإحصائيات الصندو	ِق موضح في الصا	حة (2)				

أداء الصندوق







اكبر عشرة استثمارات للصندوق

P.O.Box 63762 Info@obic.com.sa www.obic.com.sa F. +966 11 419 1899 T. +966 920028287 Saudi Arabia - Riyadh 11526
167366 في الغرفة التجارية: 08126-07) بسجل آلا العنون والى منفوعة بالكامل ومقر ها اللرنيسي بالرياض ترخيص هيئة السوق المالية رقم (08126-07), سجل آلا ملك عليون ريال منفوعة بالكامل ومقر ها اللرنيسي بالرياض ترخيص هيئة السوق المالية رقم (08126-07)

كما في بداية الفترة

إخلاع المستوولية. بذلت شركة أصول و بخيت الاستثمارية أقصى جهد ممكن للناكد من أن محترى المعلومات المذكورة أعلاه صحيحة ودقيقة ومع ذلك فإن شركة أصول و بخيت الاستثمارية لا تقدم أي ضمائات بشأن مختويات اللتقوية وجود أي خطأ قد يرد في هذا التقوير بشكل غير مقصود ، كما نلفت الانتهاء بأن هذه الأدرات الاستثمار في الأسهم أو الأدرات الاستثمارية تعلوي على تنبذبات في القيمة تعكن درجة عالية من المخاطر وقد لا تكون مناسبة لكل مستثمل المستثمارية تنطوي على تنبذبات في القيمة تعكن درجة عالية من المخاطر وقد لا تكون مناسبة لكل مستثمل المستثملي ولا تضمن شركة أصول و بخيت الاستثمارية بأن هذا الأدرات الاستثمارية بي كذلك يجب الانتباه أن الأداء السابق لأي ورقة مالية أو للمؤشر الاستثمار فيها لذلك المستثمارية بأن هذا الأدرات الاستثمارية بي كذلك يجب الانتباه أن الأداء السابق لأي ورقة مالية أو للمؤشر الاسترشادي لا يشكل مؤشراً للأداء المستثملي ولا تضمن شركة أصول و بخيت الاستثمارية بأن هذا الأدرات الاستثمارية برجم التكوم بزيارة الموقع الإلكتروني ولائل فيها الموقع الإلكتروني (المتعلقة بصناديق ومنتجات أصول و بخيت الاستثمارية برجم التكوم بزيارة الموقع الإلكتروني www. obic. com. sa



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 متوسط العائد كل فترة σ مقشر 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 المعادلة الكنيه $\sigma_p - Rf / \sigma_p - Rf$ المعادلة الكنيه $\sigma_p - Rf / \sigma_p - Rf$	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 التباين المشترك بين الصندوق والسوق σ_p σ_p المعادلة: σ_p (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: ($= \frac{1}{2}$ (
$TE = V(\Sigma(R_p - R_m)^2/(N-1))$ $TE = V(\Sigma(R_p - R_m))^2/(N-1)$ $TE = V(\Sigma(R_p - R_m))^2/(N-1)$ $TE = V(\Sigma(R_p - R_m))^2/(N-1)$ $TE = V(\Sigma(R_p - R_m))$ $TE = V(\Sigma($	
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 \leftarrow R $_{\rm m}$ خطأ التتبع \leftarrow TE خطأ التتبع \leftarrow Alpha = Δ R $_{\rm p}$ – Δ R $_{\rm m}$ المعادلة: Δ R $_{\rm p}$ – Δ R $_{\rm m}$ العائد الإضافي للصندوق مقارنة بالمؤشر \leftarrow Alpha التغير في أداء الصندوق \rightarrow Δ R $_{\rm p}$	
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