كما في بداية الفترة

17.74%



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 أسهم الشركات السعودية المساهمة المتوافقة مع الضوابط الشرعية ، كما يمكن أن يستثمر الصندوق ما لا يزيد عن 30 % من صافي قيمة أصوله في أسهم الشركات المدرجة في السوق الموازية

%	القيمة	معلومات الصندوق
0.30%	58,585.49	نسبة الاتعاب الاجمالية
0.00%	لا يوجد	نسبة الاقتراض
0.05%	8,688.00	مصاريف التعامل
0.00%	لا يوجد	استثمار مدير الصندوق
0.00%	لا يوجد	الأرباح الموزعة
4.2	28 M	عدد الوحدات
19.27 M		اجمالي صافي الأصول
حق المنفعة	ملكية تامة	بيانات ملكية استثمار الصندوق
0%	100%	

السعودية.	الع سة	المملكة	ات داخل	الاستثمار	حميه
	77.		<u></u>	,,	<u> </u>

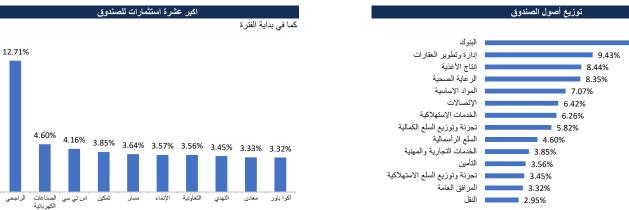
سمات الصندوق	
19.27 M	حجم الصندوق (ريال سعودي)
06/05/2007	تاريخ بدء الصندوق
1.00	سعر الوحدة عند الانشاء (ريال سعودي)
4.51	سعر الوحدة عند نهاية الشهر (ريال سعودي)
350.59%	التغير في سعر الوحدة %
0.65%	التغير في سعر الوحدة (مقارنة بالشهر السابق)
ِ الأسهم السعودية المتوافق مع ضوابط اللجنة الشرعية المزود من قبل شركة ايديل ريتنغ	المؤشر الارشادي مؤشر
ريال سعو دي	عملة الصندوق
عالى المخاطر	مستوى المخاطر
مفتوح	نوع الصندوق

أداء الصندوق			
القا	المؤشر الإرشادي	الصندوق	
(0.78%)	1.43%	0.65%	شهر
(0.62%)	7.08%	6.46%	ثلاثة أشهر
(0.06%)	-3.36%	-3.42%	منذ بداية السنة
2.24%	-3.74%	-1.50%	سنة
1 9.68%	2.54%	22.22%	ثلاث سنوات
21.91%	53.41%	75.32%	خمس سنوات

		الصندوق	إحصائيات		
مؤشر المعلومات	خطأ التتبع	بيتا	مؤشر شارب	الانحراف المعياري	
-0.71	1.09%	0.86	-2.03	2.25%	شهر
-0.27	2.30%	0.87	0.17	6.12%	ثلاثة أشهر
-0.01	4.40%	0.90	-0.70	12.86%	منذ بداية السنة
0.43	5.26%	0.87	-0.53	13.16%	سنة
1.96	10.02%	0.82	0.81	20.28%	تُلاث سنوات
1.70	12.86%	0.81	2.60	27.31%	خمس سنوات
		بة (2)	موضح في الصفد	شرات وإحصائيات الصندوق	توضيح احتساب مؤا

أداء الصندوق





P.O.Box 63762 Info@obic.com.sa www.obic.com.sa F. +966 11 419 1899 T. +966 920028287 Saudi Arabia - Riyadh 11526 مدرجة يرأس مال 81 مليون ريال مدفوعة بالكامل ومقر ها الرئيسي بالرياض بترخيص هيئة السوق الملية رقم (8126-07), سجل تجاري رقم 1010219805 رقم العضوية في الغرفة التجارية:

إخلام المسوولية. بذلت شركة أصول و بخين الاستثمارية أقصى جيد ممكن للتأكد من أن محتوى المعلومات المذكورة أعلاه صحيحة ودقيقة ومع ذلك فإن شركة أصول و بخيث الاستثمارية لا تتم أي ضمائت بشان محتويا المعلومات المدخورة أعلاه صحيحة ودقيقة ومع ذلك فإن شركة أصول و بخيث الاستثمارية المرتبطة بها كصداديق الاستثمارية المرتبطة بها كصداديق الاستثمارية المرتبطة بها كصداديق الاستثمارية المرتبطة بها كصداديق المستقبلي ولا تتحمل مستولية وحدو الي مستثمار المستثماري مؤهل قبل الاستثمارية بأن هذه الأدوات الاستثمارية لم يخلل مؤشرة للأداء المستقبلي ولا تضمن شركة أصول و بخيث الاستثمارية بأن هذه الأدوات الاستثمارية بمن هذه الأدوات الاستثمارية بن هذا الأدوات الاستثمارية بن هذا الأدوات الاستثمارية بن هذا الأداء المستقبلي ولا تضمن شركة أصول و بخيث الاستثمارية بن هذا الأداوت الاستثمارية بن هذا الأداء المستقبل المستقبل المصول على الشروة الراحية ومع كلفة التفاصيل المتعلقة بصداديق ومنتجات أصول و بخيث الاستثمارية برجى التكرم بزيارة العوقع الإلكتروني www. obic. com. s



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 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: ($= \frac{1}{2}$ (
$TE = V(\Sigma(R_p - R_m)^2/(N-1))$ $TE = V(\Sigma(R_p - R_m))^2/(N-1)$ $TE = V(\Sigma(R_p - R_m))^2/(N-1)$ $TE = V(\Sigma(R_p - R_m))^2/(N-1)$ $TE = V(\Sigma(R_p - R_m))$ $TE = V(\Sigma($	
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