

اهداف الصندوق

يستثمر الصندوق في أسهم الشركات السعودية المدرجة في "تمو – السوق الموازية"، كما يجوز لمدير الصندوق أن يستثمر بما لا يزيد عن 75% من صافي قيمة أصول الصندوق في أسهم الشركات السعودية الصغيرة والمتوسطة المدرجة في السوق الرئيسية ، وله صلاحية الاستثمار بالصناديق الاستثمارية المطروحة وحداتها طرحاً عاماً ومرخصة من قبل هيئة السوق المالية (بما في ذلك وحدات الصناديق المدارة من قبل مدير الصندوق) . بالإضافة إلى إمكانية استثمار السيولة النقدية المتوفرة في ودائع آجلة بالريال السعودي لدى المصارف المرخصة في المملكة العربية السعودية على أن تكون جميع الاستثمارات متوافقة مع الضوابط الشرعية التي تقرها الهيئة الشرعية للصندوق.

معلومات الصندوق	القيمة	%
نسبة الاتعاب الاجمالية	47,047.54	0.34%
نسبة الاقتراض	لا يوجد	0.00%
مصاريف التعامل	5,829.00	0.04%
استثمار مدير الصندوق	3,682,162.96	26.25%
الأرباح الموزعة	لا يوجد	0.00%
عدد الوحدات	3,682.162.00	
اجمالي صافي الأصول	14.03 M	
بيانات ملكية استثمار الصندوق	ملكية تامة	حق المنفعة
	100%	0%

جميع الاستثمارات داخل المملكة العربية السعودية.

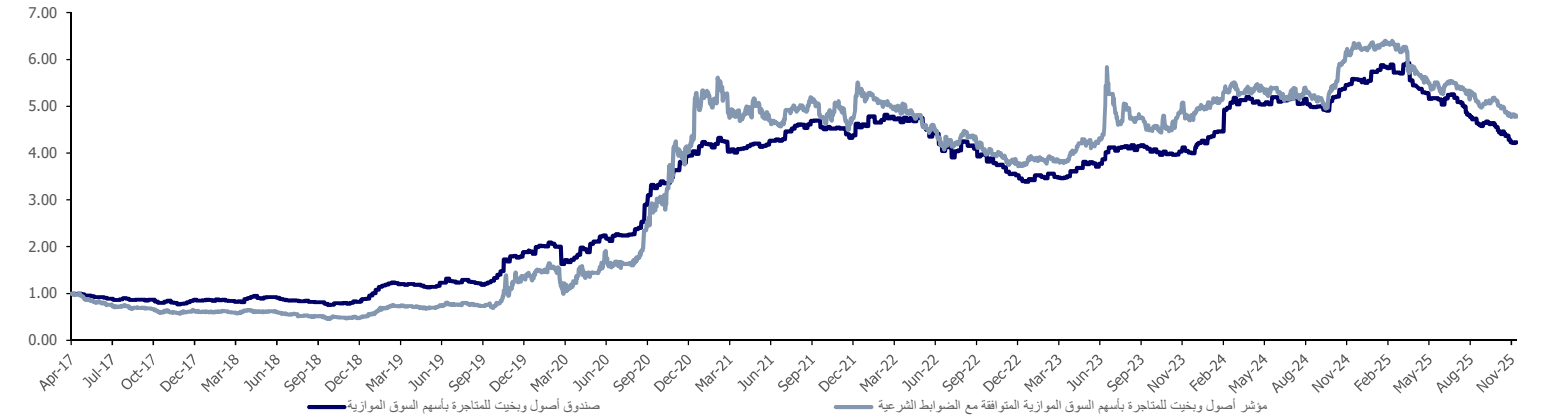
أداء الصندوق	الصندوق	المؤشر الإرشادي	الفا
شهر	-5.17%	-4.18%	(0.99%)
ثلاثة أشهر	-10.45%	-9.13%	(1.32%)
منذ بداية السنة	-24.26%	-23.00%	(1.26%)
سنة	-22.70%	-22.08%	(0.62%)
ثلاث سنوات	18.90%	23.95%	(5.05%)
خمس سنوات	11.05%	20.08%	(9.03%)

سمات الصندوق	حجم الصندوق (ريال سعودي)
تاريخ بدء الصندوق	14.03 M
سعر الوحدة عند الانشاء (ريال سعودي)	05/04/2017
التغير في سعر الوحدة (مقارنة بالشهر السابق)	1.00
المؤشر الارشادي	4.23
عملة الصندوق	322.86%
مستوى المخاطر	-5.17%
نوع الصندوق	مؤشر أصول وبخيت للمتاجرة بأسهم السوق الموازية المتوافقة مع الضوابط الشرعية
	ريال سعودي
	عالي المخاطر
	مفتوح

إحصائيات الصندوق	مؤشر المعلومات	خطأ التتبع	بيتا	مؤشر شارب	الانحراف المعياري
شهر	-0.44	2.26%	0.83	-3.60	2.82%
ثلاثة أشهر	-0.38	3.48%	0.68	-3.60	4.37%
منذ بداية السنة	-0.15	8.23%	0.81	-2.55	11.66%
سنة	-0.07	8.44%	0.80	-2.36	11.92%
ثلاث سنوات	-0.17	29.87%	0.36	0.57	22.94%
خمس سنوات	-0.20	45.15%	0.32	0.21	31.63%

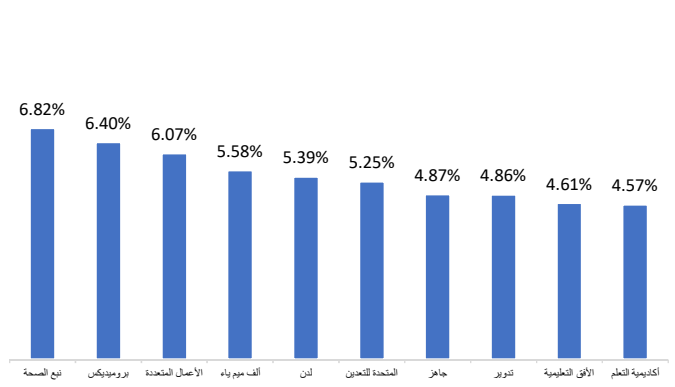
توضيح احتساب مؤشرات وإحصائيات الصندوق موضع في الصفحة (2)

أداء الصندوق



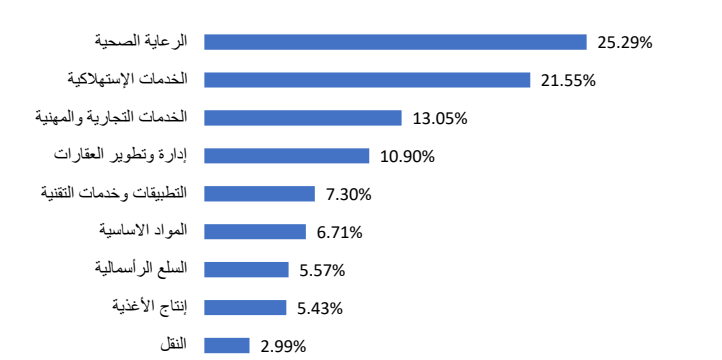
أكبر عشرة استثمارات للصندوق

كما في بداية الفترة



توزيع أصول الصندوق

كما في بداية الفترة



P.O.Box 63762 Info@obic.com.sa www.obic.com.sa F. +966 11 419 1899 T. +966 920028287 Saudi Arabia - Riyadh 11526
شركة مساهمة مدرجة برأس مال 81 مليون ريال مدفوعة بالكامل ومقرها الرئيسي بالرياض. ترخيص هيئة السوق المالية رقم (08126-07)، سجل تجاري رقم 1010219805، رقم العضوية في الغرفة التجارية: 167366

إخلاء المسؤولية: يثلت شركة أصول و بخيت الاستثمارية أقصى جهد ممكن للتأكد من أن محتوى المعلومات المذكورة أعلاه صحيحة ودقيقة ومع ذلك فإن شركة أصول و بخيت الاستثمارية لا تقدم أي ضمانات بشأن محتويات التقرير ولا تتحمل مسؤولية وجود أي خطأ قد يرد في هذا التقرير بشكل غير مقصود . كما لفت الانتباه بأن هذه المعلومات ليست مخصصة لأغراض الدعائية ولا تشكل توصية بشراء أو بيع أوراق مالية أو لاتخاذ قرار استثماري . ويجب الانتباه دائماً بأن الاستثمار في الأسهم أو الأدوات الاستثمارية المرتبطة بها كصناديق الأسهم الاستثمارية تنطوي على تذبذبات في القيمة تعكس درجة عالية من المخاطر وقد لا تكون مناسبة لكل مستثمر للاستثمار فيها لذلك فإننا ننصح بالرجوع إلى مستشار استثماري موهل قبل الاستثمار في مثل هذه الأدوات الاستثمارية . كذلك يجب الانتباه أن الأداء السابق لأي ورقة مالية أو للمؤشر الاسترشادي لا يشكل مؤشراً للأداء المستقبلي ولا تضمن شركة أصول و بخيت الاستثمارية بأن هذا الأداء سينكرر أو سيكون مثلاً في المستقبل . للحصول على الشروط والأحكام وللاطلاع على كافة التفاصيل المتعلقة بصناديق ومنتجات أصول و بخيت الاستثمارية يرجى التكرم بزيارة الموقع الإلكتروني www. obic. com. sa أو التفضل بزيارة مقر الشركة : الرياض، طريق الملك فهد، برج البحرين، دور الميزانين.

بيان المعادلات المستخدمة لاحتساب معايير الأداء والمخاطر:

إحصائيات الصندوق	
الانحراف المعياري	
المعادلة:	$\sigma = \sqrt{(\sum (R_i - \bar{R})^2 / (N - 1))}$
قياس تذبذب العوائد $\rightarrow \sigma$	
عائد كل فترة $\rightarrow R_i$	
متوسط العائد $\rightarrow \bar{R}$	
عدد الفترات $\rightarrow N$	
مؤشر شارب	
المعادلة:	$\text{Sharpe} = (R_p - R_f) / \sigma_p$
عائد الصندوق $\rightarrow R_p$	
العائد الخالي من المخاطر $\rightarrow R_f$	
مخاطر الصندوق الكليه $\rightarrow \sigma_p$	
البيتا	
المعادلة:	$\beta = \text{Cov}(R_p, R_m) / \text{Var}(R_m)$
حساسية الصندوق لتغيرات السوق $\rightarrow \beta$	
عائد الصندوق $\rightarrow R_p$	
عائد المؤشر السوقي $\rightarrow R_m$	
التباين المشترك بين الصندوق والسوق $\rightarrow \text{COV}$	
خطأ التتبع	
المعادلة:	$\text{TE} = \sqrt{(\sum (R_p - R_m)^2 / (N - 1))}$
مدى إنحراف أداء السوق عن الصندوق $\rightarrow \text{TE}$	
عائد الصندوق $\rightarrow R_p$	
عائد المؤشر $\rightarrow R_m$	
عدد الفترات $\rightarrow N$	
مؤشر المعلومات	
المعادلة:	$\text{IR} = (R_p - R_m) / \text{TE}$
كفاءة تحقيق العوائد النشطة $\rightarrow \text{IR}$	
عائد الصندوق $\rightarrow R_p$	
عائد المؤشر المرجعي $\rightarrow R_m$	
خطأ التتبع $\rightarrow \text{TE}$	
ألفا	
المعادلة:	$\text{Alpha} = \Delta R_p - \Delta R_m$
العائد الإضافي للصندوق مقارنة بالمؤشر $\rightarrow \text{Alpha}$	
التغير في أداء الصندوق $\rightarrow \Delta R_p$	
التغير في أداء المؤشر $\rightarrow \Delta R_m$	