

أهداف 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 الوحدات العقارية المتداولة وما لا يزيد عن 30% من صافي قيمة أصوله في أسهم الشركات المدرجة في السوق الموازية

معلومات الصندوق	القيمة	%
نسبة الإعقاب الإجمالية	54,034.97	0.28%
نسبة الاقتراض	لا يوجد	0.00%
مصاريف التعامل	182.00	0.00%
استثمار مدير الصندوق	لا يوجد	0.00%
الأرباح الموزعة	لا يوجد	0.00%
عدد الوحدات	4.28 M	
إجمالي صافي الأصول	19.15 M	
بيانات ملكية استثمار الصندوق	ملكية تامة	حق المنفعة
	100%	0%

جميع الاستثمارات داخل المملكة العربية السعودية.

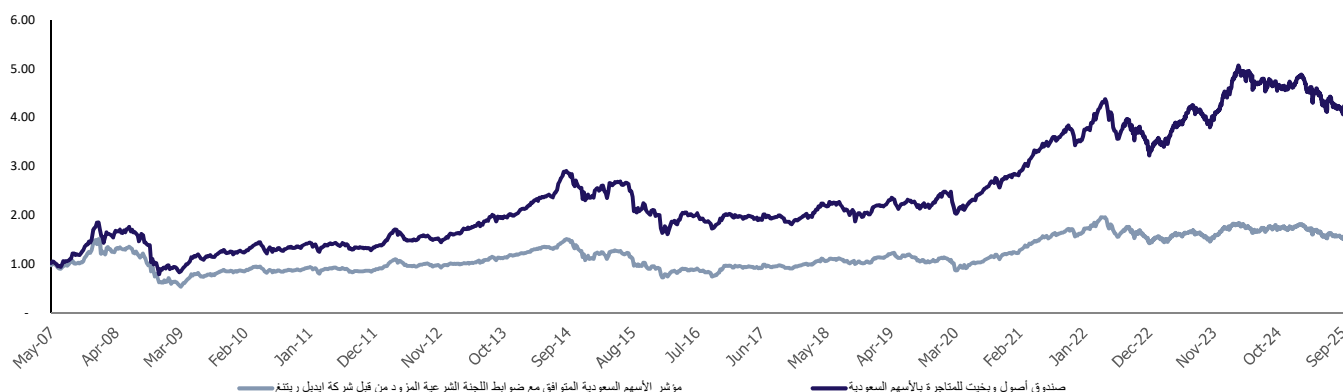
أداء الصندوق	المؤشر الإرشادي	الفا
شهر	7.39%	7.45%
ثلاثة أشهر	2.15%	3.29%
منذ بداية السنة	-4.05%	-4.72%
سنة	-4.50%	-6.44%
ثلاث سنوات	22.29%	4.09%
خمس سنوات	66.81%	44.76%

سمات الصندوق	حجم الصندوق (ريال سعودي)
19.15 M	
06/05/2007	تاريخ بدء الصندوق
1.00	سعر الوحدة عند الانشاء (ريال سعودي)
4.48	سعر الوحدة عند نهاية الربع (ريال سعودي)
347.69%	التغير في سعر الوحدة %
2.15%	التغير في سعر الوحدة (مقارنة بالربع السابق)
مؤشر الأسهم السعودية المتوافق مع ضوابط اللجنة الشرعية المزود من قبل شركة ايديل ريتنغ	المؤشر الارشادي
ريال سعودي	عملة الصندوق
عالي المخاطر	مستوى المخاطر
مفتوح	نوع الصندوق

إحصائيات الصندوق	مؤشر شارب	بيتا	خطأ التتبع	مؤشر المعلومات
شهر	0.34	0.86	1.63%	-0.04
ثلاثة أشهر	-0.53	0.89	2.51%	-0.45
منذ بداية السنة	-0.76	0.90	4.26%	0.16
سنة	-0.75	0.85	5.51%	0.35
ثلاث سنوات	0.81	0.81	10.06%	1.81
خمس سنوات	2.26	0.81	12.87%	1.71

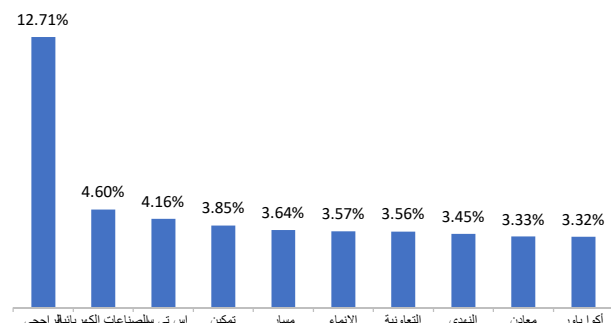
توضيح احساب مؤشرات وإحصائيات الصندوق موضع في الصفحة (2)

أداء الصندوق



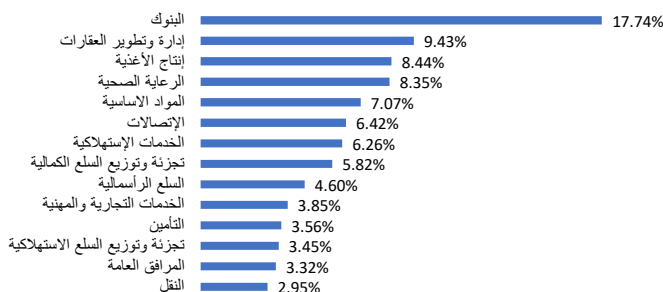
أكبر عشرة استثمارات للصندوق

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 8999 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: يملك شركة أصول وبخيت الاستثمارية أقصى جهد ممكن للتأكد من أن محتوى المعلومات المتكورة أعلاه صحيحة ودقيقة ومع ذلك فإن شركة أصول وبخيت الاستثمارية لا تقدم أي ضمانات بشأن محتويات التقرير ولا تتحمل مسؤولية وجود أي خطأ قد يرد في هذا التقرير بشكل غير مقصود. كما نلفت الانتباه بأن هذه المعلومات ليست مخصصة للأغراض 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 موثوق 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 وبخيت الاستثمارية بأن هذا الأداء سينتكر أو سيكون مماثلاً في المستقبل. للحصول على الشروط والأحكام والإطلاع على كافة التفاصيل المتعلقة بصناديق ومنتجات أصول وبخيت 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 $\rightarrow \Delta R_m$	