

اهداف الصندوق

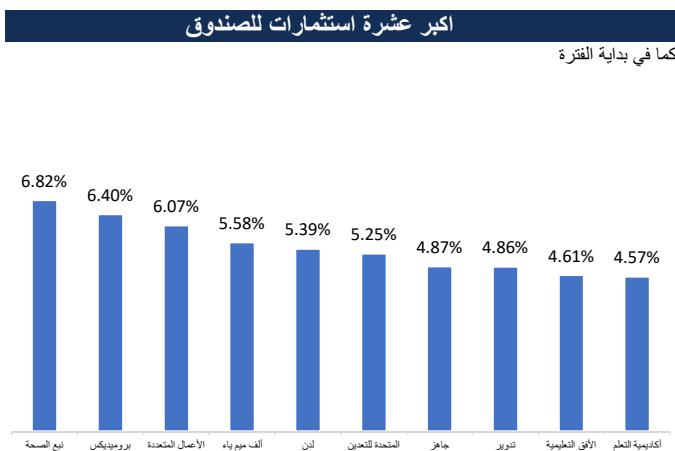
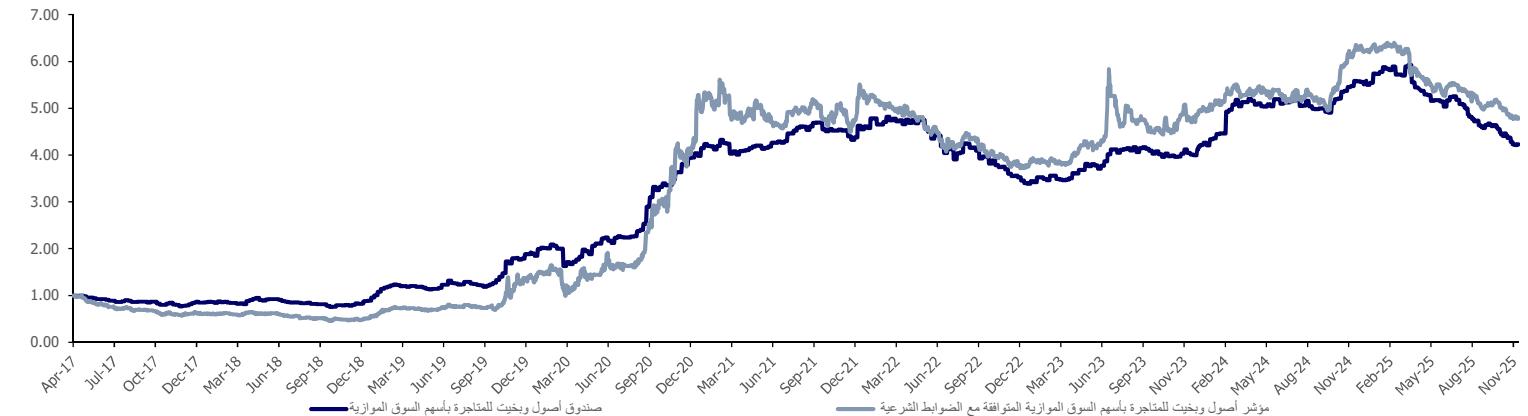
يسنّم الصندوق في أسم الشركات السعودية المدرجة في "نمو - السوق الموازية"، كما يجوز لمدير الصندوق أن يصنف قيمة أصول الصندوق في مصافي 75% من صافي قيمة الشركات السعودية الصغيرة والمتوسطة المدرجة في السوق الرئيسية، وله صلاحية الاستثمار بالصناديق الاستثمارية المطروحة واحتياطها رطحاً عاماً ومرخصة من قبل هيئة السوق المالية (بما في ذلك وحدات الصناديق المدارنة من قبل مدير الصندوق). بالإضافة إلى إمكانية استثمار السيولة النقدية المتوفرة في ودائع أجلة بالريال السعودي لدى المصادر المرخصة في المملكة العربية السعودية على أن تكون جميع الاستثمارات متوفقة مع الضوابط الشرعية التي تقرها الهيئة الشرعية للصندوق.

معلومات الصندوق	القيمة	%
نسبة الاتساع الاجمالي	47,047.54	0.34%
نسبة الافرقاء	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
بيانات ملكية استثمار الصندوق	100%	0%

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

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

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



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: $Sharpe = (R_p - R_f) / \sigma_p$

عائد الصندوق $\rightarrow R_p$

عائد الحالي من المخاطر $\rightarrow R_f$

مخاطر الصندوق الكلية $\rightarrow \sigma_p$

البيتا

المعادلة: $\beta = \text{Cov}(R_p, R_m) / \text{Var}(R_m)$

حساسية الصندوق لنفירותات السوق $\rightarrow \beta$

عائد الصندوق $\rightarrow R_p$

عائد المؤشر السوقي $\rightarrow R_m$

التبالين المشترك بين الصندوق والسوق $\rightarrow Cov$

خطأ التتبع

المعادلة: $TE = \sqrt{(\sum (R_p - R_m)^2) / (N - 1)}$

مدى إنحراف أداء السوق عن الصندوق $\rightarrow TE$

عائد الصندوق $\rightarrow R_p$

عائد المؤشر $\rightarrow R_m$

عدد الفترات $\rightarrow N$

مؤشر المعلومات

المعادلة: $IR = (R_p - R_m) / TE$

كفاءة تحقيق العوائد النشطة $\rightarrow IR$

عائد الصندوق $\rightarrow R_p$

عائد المؤشر المرجعي $\rightarrow R_m$

خطأ التتبع $\rightarrow TE$

ألفا

المعادلة: $Alpha = \Delta R_p - \Delta R_m$

العائد الإضافي للصندوق مقارنة بالمؤشر $\rightarrow Alpha$

التغير في أداء الصندوق $\rightarrow \Delta R_p$

التغير في أداء المؤشر $\rightarrow \Delta R_m$