

اهداف الصندوق

تمثل 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 المتداولة 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

القيمة	معلومات الصندوق	سمات الصندوق
54,295.32	نسبة الاتساع الإجمالية	حجم الصندوق (ريال سعودي)
لا يوجد	نسبة الافتراض	تاريخ بدء الصندوق
6,242.00	مصاريف التعامل	سعر الوحدة عند الانشاء (ريال سعودي)
لا يوجد	استثمار مدير الصندوق	سعر الوحدة عند نهاية الشهر (ريال سعودي)
لا يوجد	الأرباح الموزعة	التغير في سعر الوحدة % (مقارنة بالشهر السابق)
4.26 M	عدد الوحدات	مؤشر الأسهم السعودية المتافق مع ضوابط اللجنة الشرعية المزود من قبل شركة ايديل ريتينغ
17.31 M	اجمالي صافي الأصول	المؤشر الارشادي
100%	بيانات ملكية استثمار الصندوق	عملة الصندوق
حق المنفعة	ملكية تامة	مستوى المخاطر
0%	جميع الاستثمارات داخل المملكة العربية السعودية.	نوع الصندوق

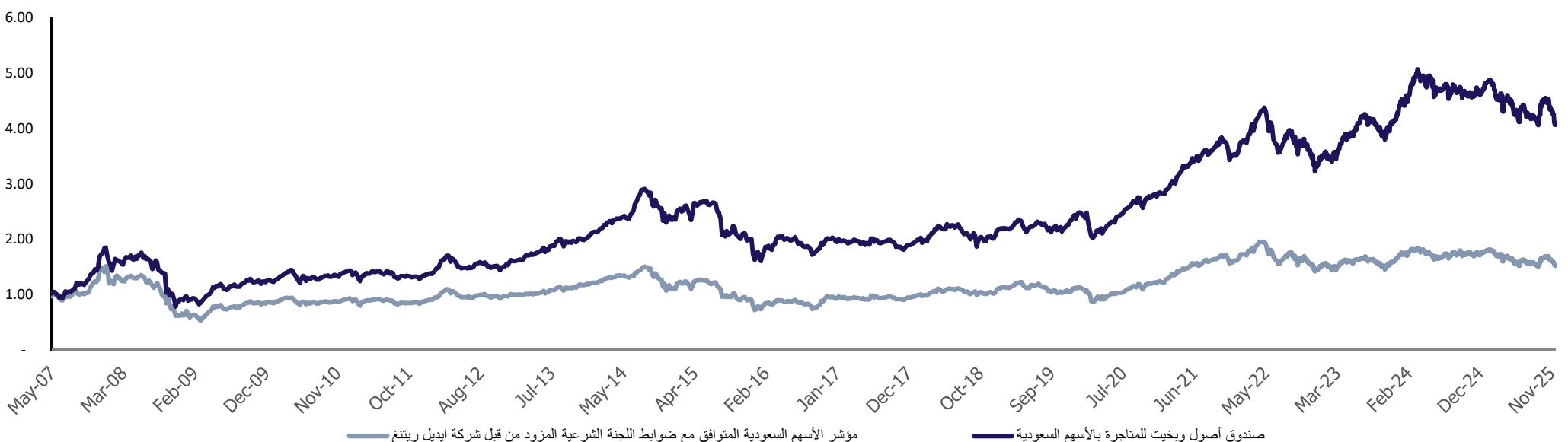
اداء الصندوق

الفترة	المؤشر الارشادي	الصندوق
ـ(0.08%)	-9.78%	-9.86% شهر
ـ(0.90%)	-1.67%	-2.57% ثلاثة أشهر
ـ(0.14%)	-12.81%	-12.95% منذ بداية السنة
ـ(1.13%)	-10.40%	-11.53% سنة
▲ 16.27%	-0.93%	15.34% ثلاث سنوات
▲ 20.47%	25.60%	46.07% خمس سنوات

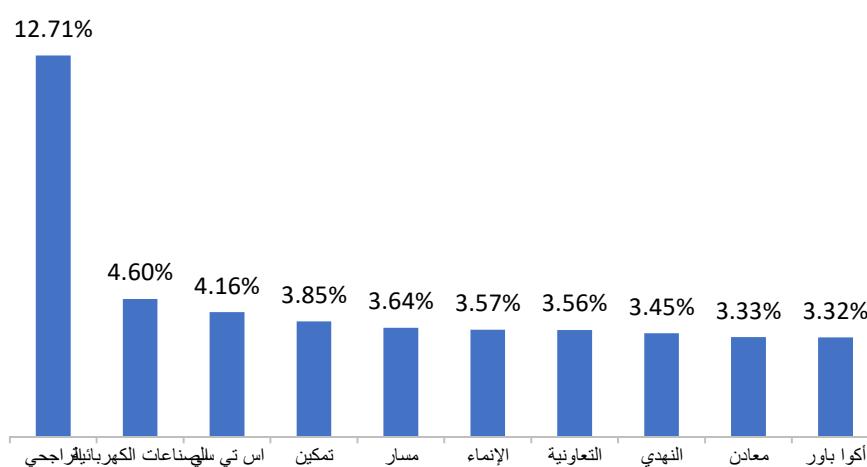
توضيح احتساب مؤشرات وإحصائيات الصندوق موضح في الصفحة (2)

اداء الصندوق

الاحرف المعياري	مؤشر شارب	بيتا	خطأ التتبع	مؤشر المعلومات	الصندوق
شهر	3.20%	-4.65	1.08%	-0.08	ـ9.86%
ثلاثة أشهر	6.80%	-1.16	2.25%	-0.40	-2.57%
منذ بداية السنة	13.36%	-1.38	0.90	-0.03	-12.95%
سنة	13.52%	-1.26	5.06%	-0.22	-11.53%
ثلاث سنوات	20.38%	0.47	9.94%	1.64	15.34%
خمس سنوات	27.38%	1.53	12.88%	1.59	46.07%

**أكبر عشرة استثمارات للصندوق**

كما في بداية الفترة

**توزيع أصول الصندوق**

كما في بداية الفترة



بيان المعادلات المستخدمة لاحتساب معايير الأداء والمخاطر:

إحصائيات الصندوق

الإنحراف 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 $\rightarrow R_m$

التبان 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 $\rightarrow \Delta R_m$