

## اهداف الصندوق

يسنّر الصندوق في أسم الشركات السعودية المدرجة في "مو - السوق الموازية"، كما يجوز لمدير الصندوق أن ينفّذ قيمه لأيّ شركات سعودية صغيرة ومتوسطة المدرجة في السوق الرئيسية، بحسب مصلحة الاستثمار بالسندانق الاستثمارية المطروحة وحدها طرحاً عاماً ومرخصة من قبل هيئة السوق المالية ( بما في ذلك وحدات الصناديق المداربة من قبل مدير الصندوق ) . بالإضافة إلى إمكانية استثمار السيولة النقدية المتوفرة في وداخل أجنة باليزد السعودي لدى المصارف المرخصة في المملكة العربية السعودية على أن تكون جميع الاستثمارات متّفقة مع الضوابط الشرعية التي تقرّها الهيئة الشرعية للصندوق.

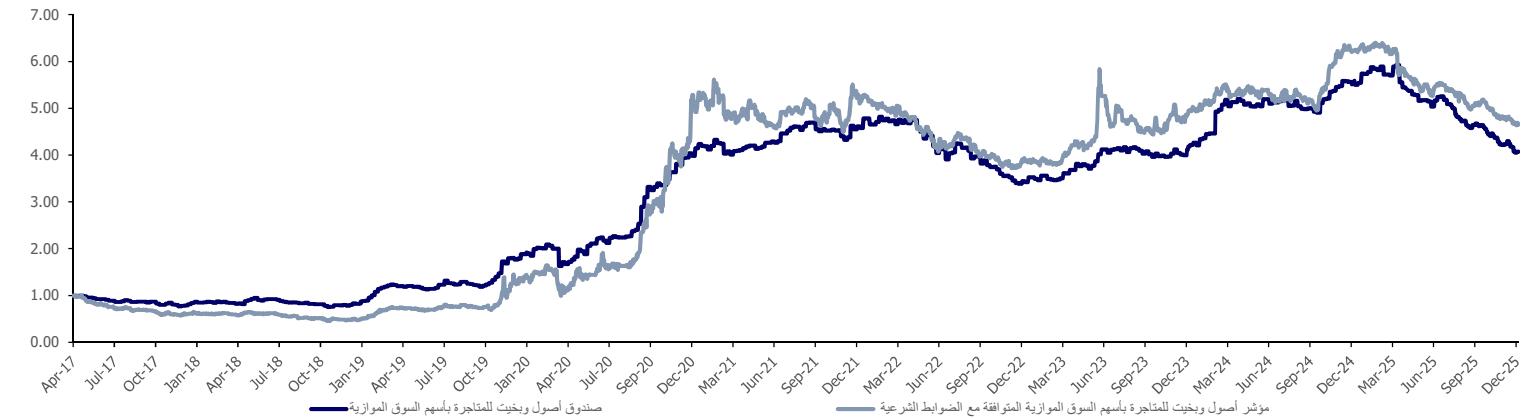
معلومات الصندوق	القيمة	%
نسبة الاتساع الاجماليية	162,428.33	1.06%
نسبة الافتراض	لا يوجد	0.00%
مصاريف التعامل	25,689.00	0.17%
استثمار مدير الصندوق	3,543,250.74	23.02%
الأرباح الموزعة	لا يوجد	0.00%
عدد الوحدات	3.31 M	
اجمالي صافي الأصول	15.39 M	
بيانات ملكية استثمار الصندوق	ملكية تامة	حق المنفعة
بيانات ملكية استثمار الصندوق	100%	0%

سمات الصندوق	
15.39 M	حجم الصندوق (ريال سعودي)
05/04/2017	تاريخ بدء الصندوق
1.00	سعر الوحدة عند الإنشاء (ريال سعودي)
4.07	سعر الوحدة عند نهاية الربع (ريال سعودي)
306.91%	التغير في سعر الوحدة %
-12.33%	التغير في سعر الوحدة (مقارنة بالربع السابق)
مؤشر أصول وبيخت المتاجرة بالسهم السوق الموازية المتوقعة مع الضوابط الشرعية	الموشير الإرشادي
ريال سعودي	عملة الصندوق
عالي المخاطر	مستوى المخاطر
مفتوح	نوع الصندوق

أداء الصندوق				
الفا	المؤشر الإرشادي	الصندوق	النهاية	النهاية
▼ (0.72%)	-3.05%	-3.77%	شهر	شهر
▼ (4.08%)	-8.25%	-12.33%	ثلاثة أشهر	ثلاثة أشهر
▼ (1.09%)	-25.05%	-26.14%	منذ بداية السنة	منذ بداية السنة
▼ (1.09%)	-25.05%	-26.14%	سنة	سنة
▼ (0.76%)	19.09%	18.33%	ثلاث سنوات	ثلاث سنوات
▲ 12.84%	-11.89%	0.95%	خمس سنوات	خمس سنوات

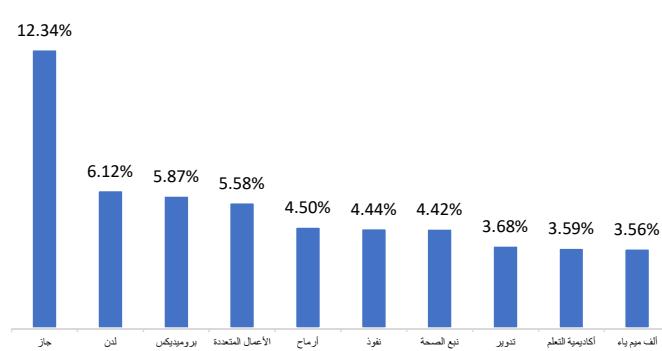
إحصائيات الصندوق					
مؤشر المعلومات	خطا التتبع	بيتا	مؤشر شارب	الانحراف المعياري	
-0.26	2.74%	0.80	-2.66	3.25%	شهر
-1.04	3.92%	0.70	-3.75	4.62%	ثلاثة أشهر
-0.13	8.68%	0.81	-2.61	12.08%	منذ بداية السنة
-0.13	8.68%	0.81	-2.61	12.08%	سنة
-0.03	29.85%	0.37	0.55	23.03%	ثلاث سنوات
0.29	44.41%	0.32	-0.11	31.13%	خمس سنوات

توضيح احتساب مؤشرات وإحصائيات الصندوق موضح في الصفحة (2)



اكبر عشرة استثمارات للصندوق

كما في بداية الفترة



## توزيع أصول الصندوق

## كما في بداية الفترة



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  $\rightarrow \text{Cov}$

#### 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  $\rightarrow \Delta R_m$