

### اهداف 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 الإصدارات الأولية للشركات السعودية المساهمة وكذلك أسهم الشركات المدرجة حديثاً خلال أول خمس سنوات من إدراجها أو آخر 20 شركة مدرجة في السوق، كما يجوز لمدير الصندوق أن يستثمر بما لا يزيد عن 50% من صافي قيمة أصول الصندوق في أسهم الشركات السعودية الصغيرة والمتوسطة، وبما 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. نمو. حيث تكون جميع الاستثمارات متوافقة مع المبادئ الشرعية المعتمدة من قبل الهيئة الشرعية للصندوق.

معلومات الصندوق	القيمة	%
نسبة الاعتاب الاجمالية	8,615.33	0.29%
نسبة الافتراض	لا يوجد	0.00%
مصاريف التعامل	612.00	0.02%
استثمار مدير الصندوق	لا يوجد	0.00%
الأرباح الموزعة	لا يوجد	0.00%
عدد الوحدات	1.88 M	
اجمالي صافي الأصول	2.96 M	

بيانات ملكية استثمار الصندوق	ملكية تامة	حق المنفعة
جميع الاستثمارات داخل المملكة العربية السعودية.	100%	0%

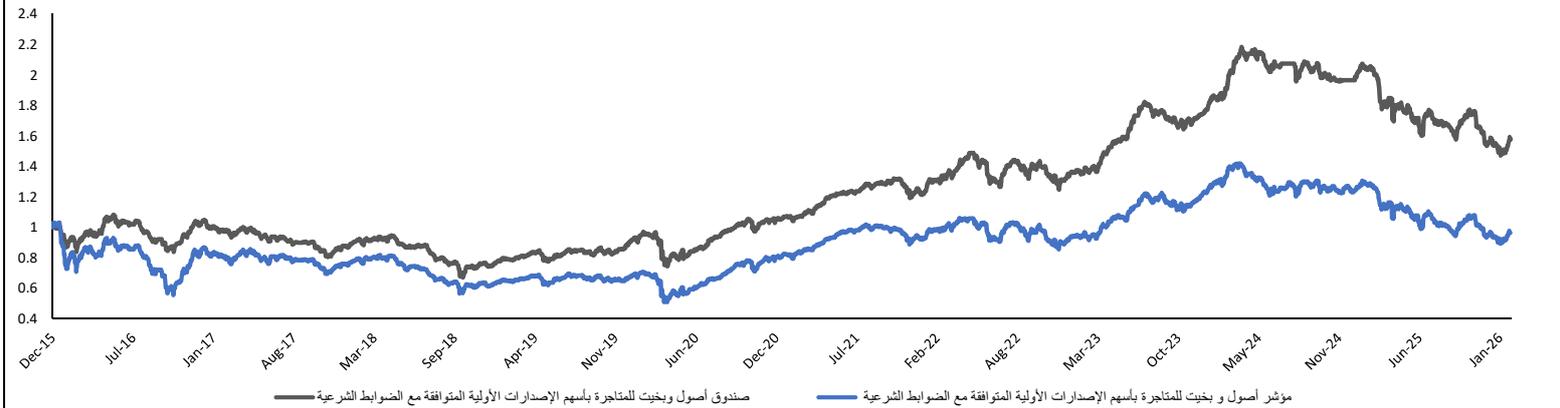
اداء الصندوق	المؤشر الإرشادي	الصندوق	الفقا
شهر	4.97%	4.22%	▼ (0.75%)
ثلاثة أشهر	-10.62%	-10.49%	▲ 0.13%
منذ بداية السنة	4.97%	4.22%	▼ (0.75%)
سنة	-24.98%	-22.74%	▲ 2.24%
ثلاث سنوات	2.12%	15.19%	▲ 13.07%
خمس سنوات	18.25%	48.05%	▲ 29.80%

سمات الصندوق	حجم الصندوق (ريال سعودي)
2.96 M	حجم الصندوق (ريال سعودي)
15/12/2015	تاريخ بدء الصندوق
1.00	سعر الوحدة عند الانشاء (ريال سعودي)
1.58	سعر الوحدة عند نهاية الشهر (ريال سعودي)
57.76%	التغير في سعر الوحدة %
4.22%	التغير في سعر الوحدة (مقارنة بالشهر السابق)
مؤشر أصول و بخيت للمتاجرة بأسهم الإصدارات الأولية المتوافقة مع الضوابط الشرعية	المؤشر الإرشادي
ريال سعودي	عملة الصندوق
عالي المخاطر	مستوى المخاطر
مفتوح	نوع الصندوق

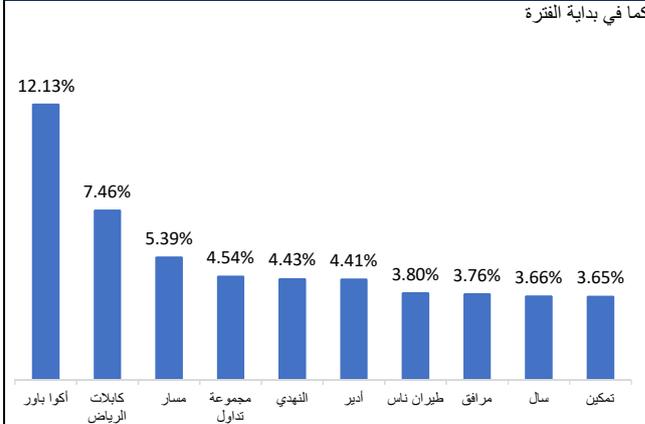
إحصائيات الصندوق	مؤشر المعلومات	خطا التتبع	بيتا	مؤشر شارب	الاتحاف المعياري
شهر	-0.77	0.97%	0.88	-0.13	4.70%
ثلاثة أشهر	0.09	1.40%	0.92	-1.91	8.05%
منذ بداية السنة	-0.77	0.97%	0.88	-0.13	4.70%
سنة	0.45	4.98%	0.87	-1.61	17.40%
ثلاث سنوات	1.22	10.69%	0.79	0.42	22.55%
خمس سنوات	2.34	12.75%	0.82	1.54	28.43%

توضيح احتساب مؤشرات وإحصائيات الصندوق موضع في الصفحة (2)

### اداء الصندوق



### أكبر عشرة استثمارات للصندوق



### توزيع أصول الصندوق



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 $\rightarrow \Delta R_m$