

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 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 الارتفاع الإجمالية	52,749.07	0.30%
نسبة الاقتراض	لا يوجد	0.00%
مصاريف التعامل	9,474.00	0.05%
استثمار مدير الصندوق	لا يوجد	0.00%
الأرباح الموزعة	لا يوجد	0.00%
عدد الوحدات	4.15 M	
إجمالي صافي الأصول	17.66 M	

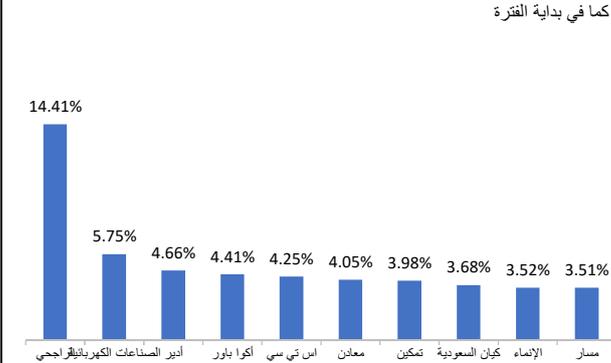
بيانات ملكية استثمار الصندوق	ملكية تامة	حق المنفعة
جميع الاستثمارات داخل المملكة العربية السعودية.	100%	0%

أداء الصندوق	المؤشر الإرشادي	الفا
شهر	7.84%	▼(1.96%)
ثلاثة أشهر	-4.28%	▼(1.36%)
منذ بداية السنة	7.84%	▼(1.96%)
سنة	-10.43%	▼(1.70%)
ثلاث سنوات	3.42%	▲16.13%
خمس سنوات	32.64%	▲17.96%

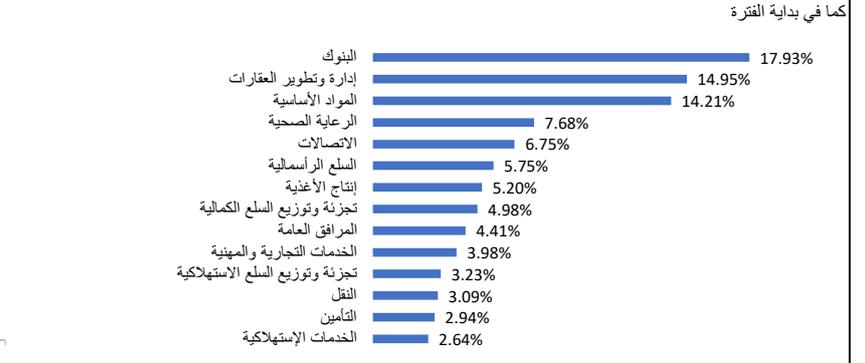
أداء الصندوق



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: $Sharpe = (R_p - R_f) / \sigma_p$
	عائد الصندوق $\rightarrow R_p$
	العائد الخالي من المخاطر $\rightarrow R_f$
	مخاطر الصندوق الكليه $\rightarrow \sigma_p$
البيتا	
	المعادلة: $\beta = Cov(R_p, R_m) / Var(R_m)$
	حساسية الصندوق لتغيرات السوق $\rightarrow \beta$
	عائد الصندوق $\rightarrow R_p$
	عائد المؤشر السوقي $\rightarrow R_m$
	التباين المشترك بين الصندوق والسوق $\rightarrow Cov$
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 $\rightarrow \Delta R_m$