

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 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.

سمات الصندوق

حجم الصندوق (ريال سعودي)	3.25 M
تاريخ بدء الصندوق	15/12/2015
سعر الوحدة عند الإصدار (ريال سعودي)	1.00
سعر الوحدة عند نهاية الشهر (ريال سعودي)	1.46
التغير في سعر الوحدة %	45.86%
التغير في سعر الوحدة (مقارنة بالشهر السابق)	-7.54%
المؤشر الإرشادي	مؤشر أصول و بخيت للمتاجرة بأسهم الإصدارات الأولية المتوافقة مع الضوابط الشرعية
عملة الصندوق	ريال سعودي
مستوى المخاطر	عالي المخاطر
نوع الصندوق	مفتوح

إحصائيات الصندوق

الاتحاف المعياري	مؤشر شارب	بيتا	خطا التتبع	مؤشر المعلومات
شهر	-3.06	0.81	1.44%	1.60
ثلاثة أشهر	-1.31	0.86	2.00%	0.98
منذ بداية السنة	-1.31	0.84	1.80%	0.96
سنة	-1.76	0.87	5.14%	0.67
ثلاث سنوات	0.03	0.79	10.67%	1.23
خمس سنوات	1.11	0.82	12.76%	2.51

توضيح احتساب مؤشرات وإحصائيات الصندوق موضع في الصفحة (2)

بيانات ملكية استثمار الصندوق

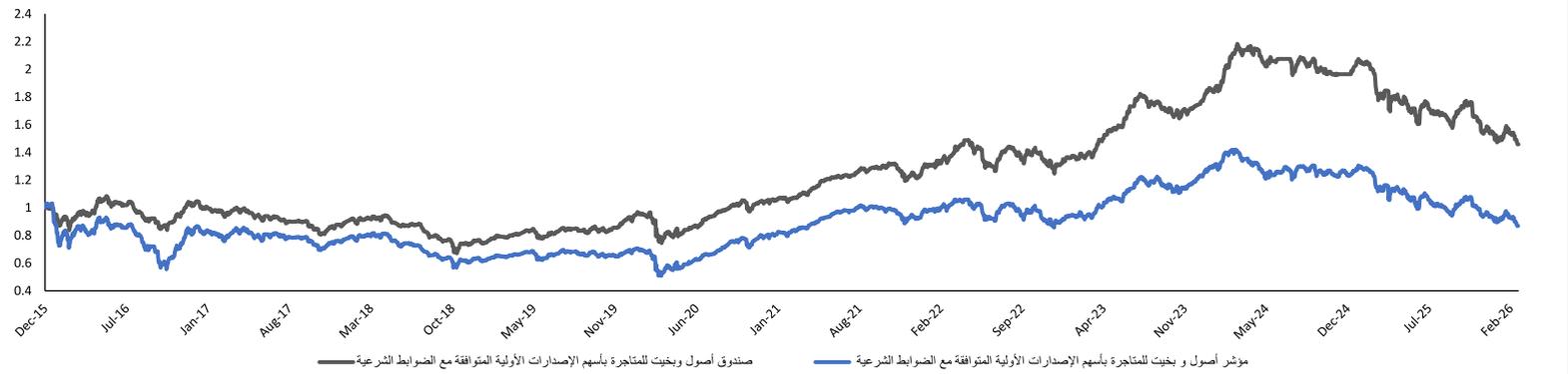
بيانات ملكية استثمار الصندوق	ملكية تامة	حق المتفعة
	100%	0%

جميع الاستثمارات داخل المملكة العربية السعودية.

اداء الصندوق

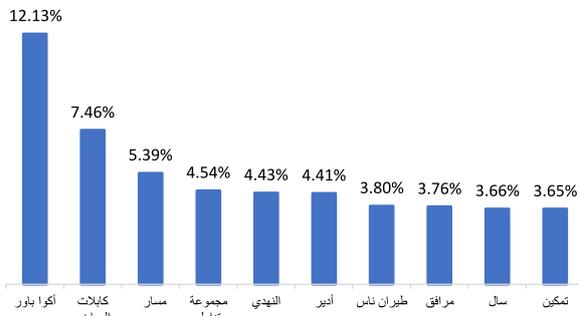
شهر	الصندوق	المؤشر الإرشادي	الفا
شهر	-7.54%	-9.84%	2.30%
ثلاثة أشهر	-5.24%	-7.20%	1.96%
منذ بداية السنة	-3.64%	-5.36%	1.72%
سنة	-25.93%	-29.40%	3.47%
ثلاث سنوات	6.41%	-6.72%	13.13%
خمس سنوات	36.41%	4.41%	32.00%

اداء الصندوق



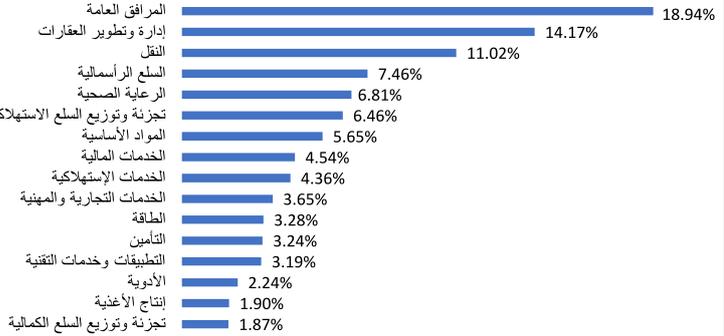
أكبر عشرة استثمارات للصندوق

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: $\text{Sharpe} = (R_p - R_f) / \sigma_p$
	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 $\rightarrow \Delta R_m$