

اهداف الصندوق

يستثمر الصندوق في أسهم الشركات السعودية المدرجة في "نمو - السوق الموازية"، كما يجوز لمدير الصندوق أن يستثمر بما لا يزيد عن 75% من صافي قيمة أصول الصندوق في أسهم الشركات السعودية الصغيرة والمتوسطة المدرجة في السوق الرئيسية، وله صلاحية الاستثمار بالصناديق الاستثمارية المطروحة وحداتها طرقاً عاماً ومخصصة من قبل هيئة السوق المالية (بما في ذلك وحدات الصناديق المدارة من قبل مدير الصندوق). بالإضافة إلى إمكانية استثمار السيولة النقدية المتوفرة في ودائع آجلة بالريال السعودي لدى المصارف المرخصة في المملكة العربية السعودية على أن تكون جميع الاستثمارات متوافقة مع الضوابط الشرعية التي تقرها الهيئة الشرعية للصندوق.

معلومات الصندوق	القيمة	%
نسبة الارتفاع الإجمالية	58,527.05	0.30%
نسبة الانقراض	لا يوجد	0.00%
مصاريف التعامل	8,038.00	0.04%
استثمار مدير الصندوق	4,041,406.93	20.77%
الأرباح الموزعة	لا يوجد	0.00%
عدد الوحدات	4.19 M	
اجمالي صافي الأصول	19.46 M	
بيانات ملكية استثمار الصندوق	ملكية تامة	حق المنفعة
	100%	0%

جميع الاستثمارات داخل المملكة العربية السعودية.

سمات الصندوق	معلومات
حجم الصندوق (ريال سعودي)	19.46 M
تاريخ بدء الصندوق	05/04/2017
سعر الوحدة عند الانشاء (ريال سعودي)	1.00
سعر الوحدة عند نهاية الربع (ريال سعودي)	4.64
التغير في سعر الوحدة %	364.11%
التغير في سعر الوحدة (مقارنة بالربع السابق)	-10.10%
المؤشر الإرشادي	مؤشر أصول وبخيت للمتاجرة بأسهم السوق الموازية المتوافقة مع الضوابط الشرعية
عملة الصندوق	ريال سعودي
مستوى المخاطر	عالي المخاطر
نوع الصندوق	مفتوح

أداء الصندوق	الصندوق	المؤشر الإرشادي	الفا
شهر	-1.71%	-3.60%	1.89%
ثلاثة أشهر	-10.10%	-6.99%	(3.11%)
منذ بداية السنة	-16.87%	-18.32%	1.45%
سنة	-7.14%	-1.57%	(5.57%)
ثلاث سنوات	21.72%	26.84%	(5.12%)
خمس سنوات	39.96%	73.70%	(33.74%)

إحصائيات الصندوق	مؤشر المعلومات	خطأ التتبع	بيتا	مؤشر شارب	الانحراف المعياري
شهر	1.00	1.89%	0.72	-2.73	2.70%
ثلاثة أشهر	-0.88	3.55%	0.78	-2.91	5.40%
منذ بداية السنة	0.19	7.67%	0.83	-2.01	11.16%
سنة	-0.57	9.77%	0.65	-0.98	12.94%
ثلاث سنوات	-0.17	29.80%	0.38	0.68	23.41%
خمس سنوات	-0.69	49.22%	0.31	1.09	32.81%

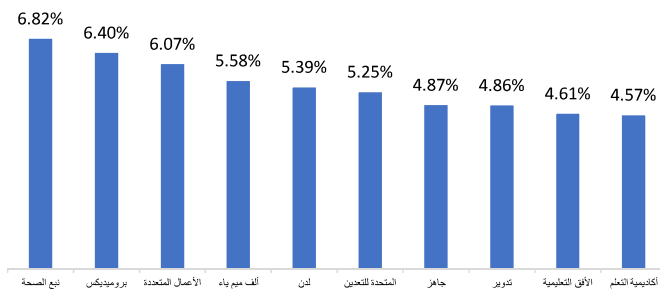
توضيح احتساب مؤشرات وإحصائيات الصندوق موضع في الصفحة (2)

أداء الصندوق



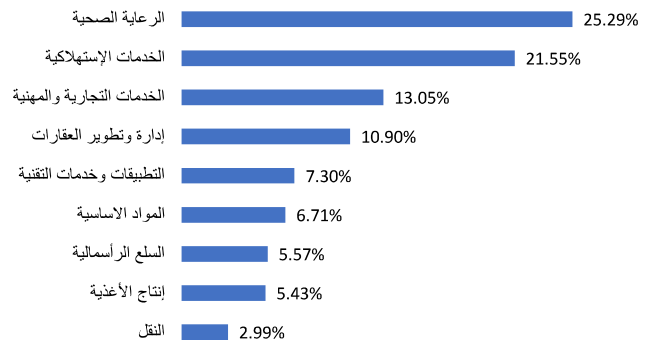
أكبر عشرة استثمارات للصندوق

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