

معلومات عن الصندوق

مستوى المخاطرة	عالي
النطاق الجغرافي	الأسهم الخليجية
تركيز القطاع	متنوع
عملة الصندوق	الريال السعودي
سعر الوحدة الحالي	SAR 9.69
حجم أصول الصندوق (مليون)	SAR 207.32
تاريخ الإنشاء	فبراير 2006
المؤشر الإرشادي	Ideal Ratings GCC ex Saudi Islamic index - Saudi Investor

معلومات إدارية

الحد الأدنى للاشتراك أو الرصيد	SAR 5,000.00
الحد الأدنى للاشتراك الإضافي أو الاسترداد	SAR 1,000.00
التقييم / أيام التعامل	الأثنين والأربعاء
أيام التسوية	أيام عمل 5
الرسوم الإدارية	1.85%
رسوم الاشتراك	2.00%

أوزان أكبر الأسهم المستثمر بها	المؤشر	الصندوق
EMAAR PROPERTIES	7.1%	14.0%
DUBAI ISLAMIC BANK	3.4%	12.4%
ETISALAT	11.9%	10.6%
ARAMEX	1.1%	9.1%
Commodity Trading Fund (SAR)	8.7%	7.7%
KUWAIT FINANCE HOUSE	1.1%	7.2%
ABU DHABI NATIONAL OIL CO FO	0.2%	5.4%
AGTHIA GROUP ORD	4.3%	5.3%
EMIRATES INTEGRATED TELECOMM	3.4%	4.3%
AGILITY	63.0%	3.4%
أخرى		20.6%

الأداء بعملية الصندوق

العائد على المدى القصير	شهر 1	3 أشهر	6 أشهر	9 أشهر	منذ بداية العام
الصندوق	-0.35%	-3.16%	-0.41%	-3.53%	-2.41%
المؤشر الإرشادي	2.64%	1.00%	2.37%	-2.36%	3.36%
العوائد حسب التقويم	2017	2016	2015	2014	2013
الصندوق	-3.57%	3.91%	-7.19%	6.80%	36.31%
المؤشر الإرشادي	-0.15%	1.05%	-18.65%	0.90%	15.80%
العائد السنوي	سنة 1	3 سنوات	5 سنوات	10 سنوات	من الإنشاء
الصندوق	-7.63%	-2.86%	0.46%	2.11%	-0.25%
المؤشر الإرشادي	1.00%	-1.47%	-2.68%	-5.21%	-3.14%
العائد التراكمي	شهر 1	3 أشهر	6 أشهر	9 أشهر	منذ بداية العام
الصندوق	-7.63%	-8.35%	2.31%	23.24%	-3.12%
المؤشر الإرشادي	1.00%	-4.36%	-12.69%	-41.46%	33.35%

تحليل إحصائي

الأداء	سنة 1	3 سنوات	5 سنوات	10 سنوات	من الإنشاء
العائد الفاض	-8.62%	-1.39%	3.13%	7.32%	2.89%
معامل ألفا	-8.12%	-2.01%	2.31%	5.73%	6.60%
مخاطر السوق	سنة 1	3 سنوات	5 سنوات	10 سنوات	من الإنشاء
معامل بيتا	0.40	0.67	0.74	0.70	0.75
معامل الارتباط	62.22%	75.61%	84.98%	81.94%	84.07%
معدل إنجاز المدير	25.00%	47.22%	55.00%	57.50%	60.45%
الانحراف المعياري	7.19%	12.75%	14.80%	15.91%	18.11%
الانحراف الهبوطي	5.69%	9.03%	10.43%	11.39%	13.76%
عائد المخاطر	سنة 1	3 سنوات	5 سنوات	10 سنوات	من الإنشاء
معدل شارب	-1.29	-0.29	0.00	0.11	-0.04
مؤشر المعلومات	-0.90	-0.17	0.42	0.80	0.94
نسبة الانحراف عن المؤشر	9.56%	8.41%	7.49%	9.20%	9.03%

الأداء الشهري التراكمي ■ الصندوق ■ المؤشر



الانحراف عن المؤشر

أوزان المؤشر

أوزان الدول

