

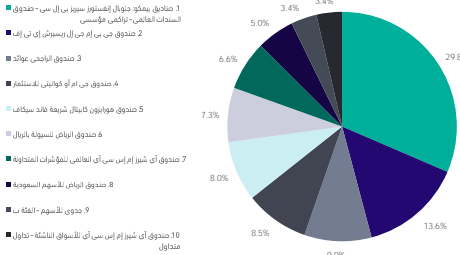
هدف الصندوق

هو صندوق قابل عام مفتوح يستثمر في مجموعة من الصناديق بهدف إلى تحقيق التوازن بين نمو وحماية رأس المال على المدى المتوسط والطويل في ظل مخاطر متوسطة.

معلومات الصندوق

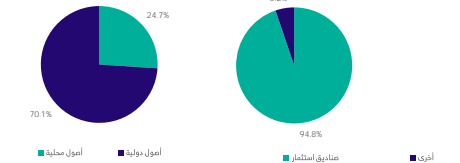
تاريخ بدء الصندوق	10 يونيو 2001
سعر الوحدة عند الطرح	10.00
حجم الصندوق	28,689,559.30
نوع الصندوق	صندوق قابل عام مفتوح يستثمر في مجموعة من الصناديق
عملة الصندوق	الريال السعودي
مستوى المخاطر	متوسطة المخاطر
المؤشر الاسترشادي	الريال السعودي مؤشر البازيل السعودي لمدة شهر
عدد مرات التوزيع	--
% رسوم الإدارة للصندوق المستثمر 0.4	1.85 - 0.50
مستشار الاستثمار ومدير الصندوق من الجانبين	--
عدد أيام التغطية المرحب	--
نسبة الأرباح العائلية	70.474.73
نسبة الأرباح	0.247%
مطابقة التكاليف	--
استثمار مدير الصندوق	--
الأرباح الموزعة	--

أكثر 10 استثمارات



توزيع الأصول الجغرافي

توزيع الأصول القطاعي



معلومات الأسعار كما في نهاية الربع

سعر الوحدة نهاية الربع	29.28
التغير في سعر الوحدة	-9.00%
إجمالي وحجم الصندوق	974,428.25
إجمالي صافي الأصول	28,527,769.95
مركز الربحية (P/E)	--

بيانات ملكية استثمارات الصندوق

ملكية تامة	100.00%
حق منقحة	--

العائد التراكمي (%)

مدة	عائد الصندوق	عائد المؤشر	عائد الأداء
ثلاثة أشهر (نهاية الربع الحالي)	-9.90%	-9.90%	0.00%
سنة واحدة	6.72%	8.12%	-1.41%
ثلاث سنوات	23.75%	28.23%	-4.48%
خمس سنوات	20.86%	25.74%	-4.88%

معايير الأداء والمخاطر

المعيار	القيمة
1. الانحراف المعياري	1.92%
2. مؤشر شارب	-0.95
3. خطأ التبع	0.13%
4. بيتا	1.07
5. ألفا	-0.26%
6. مؤشر المعلومات	-5.59

ملاحظة: تم إيراد بيان المقادير المستخدمة لحساب معايير الأداء والمخاطر أسفل الرسم البياني.

مقارنة الأداء بين الصندوق والمؤشر الاسترشادي



معادلات معايير الأداء والمخاطر:

$$IR = \frac{E(r_p - r_f)}{\sigma_{excess}} \quad (1) \quad \alpha = r_p - [r_f + \beta * (r_m - r_f)] \quad (2) \quad \beta = \frac{Cov(r_p, r_m)}{Var(r_m)} \quad (3) \quad \sigma = \sqrt{\frac{n \sum_{i=1}^n r_i^2 - (\sum_{i=1}^n r_i)^2}{n^2 - 1}} \quad (4) \quad SR = \frac{r_p - r_f}{\sigma_p} \quad (5) \quad s = \sqrt{\frac{n \sum_{i=1}^n r_i^2 - (\sum_{i=1}^n r_i)^2}{n^2 - n}} \quad (6)$$

n: عدد فترات العائد في العينة؛ r_f: العائد الخالي من مخاطر؛ r_m: متوسط العائد السنوي للمحفظة (المؤشر)؛ r_p: متوسط العائد السنوي الحالي من المخاطر؛ σ: الانحراف المعياري السنوي؛ σ_{excess}: الانحراف المعياري السنوي للمحفظة الخالية من مخاطر المؤشر؛ β: معامل بيتا للمحفظة بالنسبة للمؤشر

تفاصيل الاتصال

مكتب الرياض المالية الرئيسي
3128 البوlevard - الرياض 13519 المملكة العربية السعودية
اتصال: 920012299 | البريد الإلكتروني: ask@riyadcapital.com |
http://www.riyadcapital.com/ar/

أهداف استراتيجية
الهدف الأساسي من هذا الاستثمار الاستراتيجي هو تحقيق عائد استثمار جيد مع تقليل المخاطر. يتم تحقيق هذا الهدف من خلال الاستثمار في مجموعة متنوعة من الأصول المالية بما في ذلك الأسهم والسندات والأوراق المالية المدعومة بالرهن العقاري. يتم توزيع الاستثمارات بين مختلف القطاعات والأصول المالية لتقليل المخاطر وزيادة العائد. يتم تحديث الاستراتيجية بانتظام لتعكس التغيرات في السوق والظروف الاقتصادية.