

هدف الصندوق

هو صندوق عام مفتوح يستثمر في الأسهم العالمية المتوافقة مع الشواهد الشرعية المقررة من اللجنة الشرعية بدار من الباطن ويهدف إلى تحقيق تنمية رأس المال على المدى الطويل.

معلومات الصندوق

تاريخ بدء الصندوق	17 مايو 1999
سعر الوحدة عند الطرح	10.00
حجم الصندوق	26,346,761.25
نوع الصندوق	صندوق استثماري عام مفتوح يستثمر في الأسهم العالمية المتوافقة مع الشواهد الشرعية.
عملة الصندوق	الدولار الأمريكي
مستوى المخاطر	عالي المخاطر
المؤشر الاسترشادي	داو جونز الإسلامي

عدد مرات التوزيع	--
% رسوم الإدارة الصندوق، الصندوق المستثمر	1.75
مستشار الاستثمار ومدير الصندوق من الجانب	جي بي مورجان
عدد أيام المتوسط المرجح	--
نسبة الأرباح الجمالية	42,058.65
نسبة الأرباح	--
معاريف التعامل	--
استثمار مدير الصندوق	--
الأرباح الموزعة	--

معلومات الأسعار كما في نهاية الربع

سعر الوحدة نهاية الربع	44.63
التغير في سعر الوحدة	-0.52%
إجمالي وحجم الصندوق	588,685.25
إجمالي حافلي الأصول	26,271,061.08
مركز الربحية (P/E)	--

بيانات ملكية استثمارات الصندوق

ملكية تامة	100.00%
حق منقبة	--

العائد التراكمي (%)

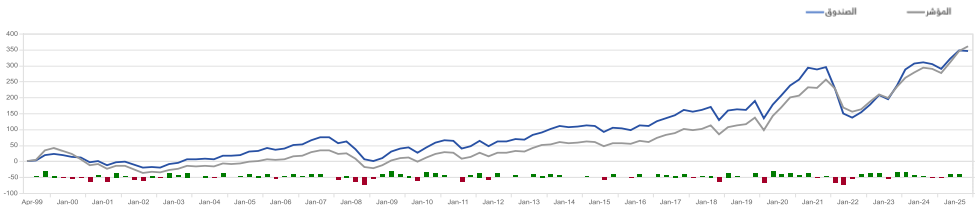
أداء الصندوق	ثلاثة أشهر نهاية الربع الحالي	منذ بداية السنة	سنة واحدة	ثلاث سنوات	خمس سنوات
-0.52	10.42	10.42	76.54	32.33	
3.52	18.24	18.24	75.58	54.07	
-4.04	-7.82	-7.82	0.95	-21.74	

معايير الأداء والمخاطر

المعيار	ثلاثة أشهر نهاية الربع الحالي	منذ بداية السنة	سنة واحدة	ثلاث سنوات	خمس سنوات
1 الانحراف المعياري	3.32%	13.67%	13.67%	13.70%	18.28%
2 مؤشر شارب	-0.46	0.44	0.44	1.16	0.13
3 خطأ التبع	1.03%	4.95%	4.95%	5.61%	8.23%
4 بيتا	1.16	1.15	1.15	1.02	1.13
5 ألفا	-1.51%	-8.92%	-8.92%	-0.04%	-3.58%
6 مؤشر المعلومات	-3.87	-1.51	-1.51	0.04	-0.39

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

مقارنة الأداء بين الصندوق والمؤشر الاسترشادي



معادلات معايير الأداء والمخاطر:

$$IR = \frac{E(r_p - r_f)}{\sigma_{excess}} \quad (6)$$

$$\alpha_t = r_t - [r_f + \beta * (r_s - r_f)] \quad (5)$$

$$\beta = \frac{Cov(r_p, r_s)}{Var(r_s)} \quad (4)$$

$$\sigma = \sqrt{\frac{n \sum_{i=1}^n r_i^2 - (\sum_{i=1}^n r_i)^2}{n^2 - 1}} \quad (3)$$

$$SR = \frac{r_p - r_f}{\sigma_p} \quad (2)$$

$$s = \sqrt{\frac{n \sum_{i=1}^n r_i^2 - (\sum_{i=1}^n r_i)^2}{n^2 - n}} \quad (1)$$

ن: عدد فترات الأداء في العينة | r: العائد لفترة معينة | r_p: متوسط العائد السنوي للصندوق (المؤشر) | r_f: متوسط العائد السنوي الخالي من المخاطر | σ: الانحراف المعياري السنوي | σ_{excess}: الانحراف المعياري السنوي للعائد فوق عائد المؤشر | β: معامل بيتا المحسطة بالنسبة للمؤشر

تفاصيل الاتصال

مكتب الرياض المالية الرئيسي
3128 الجوليفارد المالي | 671 حي العقيق، الرياض 13519 المملكة العربية السعودية
هاتف: 920012299 | البريد الإلكتروني: ask@riyadcapital.com | http://www.riyadcapital.com/ar/

أداء مسؤولية
أداء المنتج ليس مؤشرا على مصداقية المعلومات المستشفية. يمكن أن تظهر قيمة الوحدات والحدود التي قد يخلق المستثمرون أرباحا مع استثمروا، حيث لا يضمنه أي بنك. الرسوم المطلوبة على الأصول المالية يجب أن تكون لها آثار سلبية إضافية يجب على المستثمرين البقاء في وعيهم المالي والتي قبل الصندوق في منتج معين/صندوق معين يجب عليهم طلب المشورة من المهنيين في مجال الاستثمار والمقايير يتم توفير التصنيف والتعليق والحدود المتعلقة بالمنتج في الشواهد والأحكام والقانونية لإدارة المحفظة التقديرية المحفظة على الصندوق وإدارة المحفظة التقديرية التي يجب قراءتها وفهمها قبل الدخول فيها.