

هدف الصندوق

هو صندوق عام مفتوح يستثمر في الأسهم المحلية المتوافقة مع الشواهد الشرعية المقررة من اللجنة الشرعية للرياض المالية ويهدف إلى توزيع الدخل وتحقيق تنمية رأس المال على المدى الطويل.

معلومات الصندوق

تاريخ بدء الصندوق	23 مارس 2014
سعر الوحدة عند الطرح	10.00
حجم الصندوق	29,633,817.95
نوع الصندوق	صندوق استثماري عام مفتوح يستثمر في الأسهم السعودية ذات التوزيعات النقدية المتوافقة مع الشواهد الشرعية.
عملة الصندوق	الريال السعودي
مستوى المخاطر	عالي المخاطر
المؤشر الاسترشادي	مؤشر صندوق الرياض للدخل المتوافق مع الشواهد الشرعية المقدم من شركة إيجيل ريتنيدز
عدد مرات التوزيع	مرتين في السنة
% رسوم الإدارة الصندوق، الصندوق المستثم	1.50
مستشار الاستثمار ومدير الصندوق من الجانب	--
عدد أيام التوسيد المرجح	--
نسبة الأتعاب الإجمالية	174,033.79
نسبة الأتعاب	--
معاريف التعامل	3,040.75
استثمار مدير الصندوق	--

معلومات الأسعار كما في نهاية الربع

سعر الوحدة نهاية الربع	8.75
التغير في سعر الوحدة	-11.12%
إجمالي وحجم الصندوق	3,376,938.35
إجمالي صافي الأصول	29,532,089.05
مركز الربحية (P/E)	--

بيانات ملكية استثمارات الصندوق

ملكية تامة	100.00%
حق منفعة	--

العائد التراكمي (%)

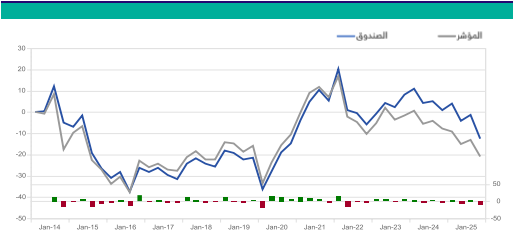
أداء الصندوق	ثلاثة أشهر (نهاية الربع الحالي)	منذ بداية السنة	سنة واحدة	ثلاث سنوات	خمس سنوات
-11.12	-13.19	-13.19	-7.06	-7.06	2.78
-9.08	-14.21	-14.21	-11.88	-11.88	-11.61
-2.04	1.03	1.03	4.83	4.83	14.39

معايير الأداء والمخاطر

المعيار	ثلاثة أشهر (نهاية الربع الحالي)	منذ بداية السنة	سنة واحدة	ثلاث سنوات	خمس سنوات
1 الانحراف المعياري	3.51%	11.26%	11.26%	11.56%	14.38%
2 مؤشر شارب	-3.46	-1.56	-1.56	-0.64	-0.19
3 حد التبع	1.39%	5.71%	5.71%	4.84%	4.49%
4 بيتا	0.77	0.80	0.80	0.85	0.96
5 ألفا	-1.47%	-1.82%	-1.82%	1.15%	3.00%
6 مؤشر المعلومات	-1.01	0.17	0.17	0.35	0.66

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

مقارنة الأداء بين الصندوق والمؤشر الاسترشادي



معادلات معايير الأداء والمخاطر:

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

$$\alpha_i = r_i - [r_f + \beta \cdot (r_m - r_f)] \quad (5)$$

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

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

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

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

n: عدد فترات العائد في العينة ؛ r: العائد لفترة معينة ؛ r_p: متوسط العائد السنوي للمحفظة (المؤشر) ؛ r_f: متوسط العائد السنوي الخالي من المخاطر ؛ σ: الانحراف المعياري السنوي ؛ σ_{excess}: الانحراف المعياري السنوي للعوائد فوق عائد المؤشر ؛ β: معامل بيتا للمحفظة بالنسبة للمؤشر

تفاصيل الاتصال

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