

هدف الصندوق

هو صندوق قابض عام مفتوح يستثمر في مجموعة من الصناديق بهدف إلى المحافظة على رأس المال المستثمر وتحقيق معدل عائد مناسب على المدى القصير في ظل مخاطر محدودة

معلومات الصندوق

تاريخ بدء الصندوق	10 يونيو 2001
سعر الوحدة عند الطرح	10.00
حجم الصندوق	56,213,459.39
نوع الصندوق	هو صندوق قابض عام مفتوح يستثمر في مجموعة من الصناديق
عملة الصندوق	الريال السعودي
مستوى المخاطر	محدود المخاطر
المؤشر الاسترشادي	Barclays Bond Index ■ TASI ■ MSCI World Index ■ سعر تكلفة التمويل بين البنوك بالريال السعودي لمدة شهر
عدد مرات التوزيع	--
% رسوم الإدارة الصندوق, الصندوق المستثمر 0.1	0.1 - 1.85
مستشار الاستثمار ومدير الصندوق من الجاهن	--
عدد أيام التغطية المرحج	--
نسبة الأمانب اإجماليه	83,619.70 0.150%
نسبة الاقتراض	--
معاريف التاعلم	--
استثمار مدير الصندوق	--
الأرباح الموزعة	--

معلومات الأسعار كما في نهاية الربع

سعر الوحدة نهاية الربع	18.74
التغير في سعر الوحدة	1.35%
إجمالي وحجم الصندوق	2,993,574.83
إجمالي صافي الأصول	56,091,262.82
مؤشر الربحية (P/E)	--

بيانات ملكية استثمارات الصندوق

ملكية تامة	100.00%
حق منفعة	--

العائد التراكمي (%)

	ثلاثة اشهر نهاية الربع الحالي	منذ بداية السنة	سنة واحدة	ثلاث سنوات	خمس سنوات
أداء الصندوق	1.35	6.02	6.02	17.80	16.81
أداء المؤشر	1.17	6.42	6.42	21.59	20.15
عراق الأداء	0.18	-0.40	-0.40	-3.78	-3.34

معايير الأداء والمخاطر

	ثلاثة اشهر نهاية الربع الحالي	منذ بداية السنة	سنة واحدة	ثلاث سنوات	خمس سنوات
1. الانحراف المعياري	0.24%	0.87%	0.87%	1.40%	1.76%
2. مؤشر شارب	1.33	1.87	1.87	0.39	-0.09
3. حد التبع	0.07%	0.30%	0.30%	0.38%	0.62%
4. بيتا	1.13	0.93	0.93	0.95	0.85
5. ألفا	0.01%	0.04%	0.04%	-0.73%	-0.01%
6. مؤشر المعلومات	2.73	-1.30	-1.30	-2.89	-0.93

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

مقارنة الأداء بين الصندوق والمؤشر الاسترشادي

--



معادلات معايير الأداء والمخاطر:

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

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

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

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

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

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

n: عدد فترات الأداء في العينة ؛ r: العائد لفترة معينة ؛ r_p: متوسط العائد السنوي للمحفظة (المؤشر) ؛ f: متوسط العائد السنوي الداخلي 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 4671حي العقيق، الرياض 13519 المملكة العربية السعودية
هاتف: 920012299 | البريد الإلكتروني: ask@riyadcapital.com | http://www.riyadcapital.com/ar/

أغلب مسؤولي
الأداء السابق ليس مؤشرا على أداء الاستثمار المستقبلي. يمكن أن تشهد قيمة الوحدات والحدس منها أو تقل. قد يفتقر المستثمرون إلى معلوماتهم الخاصة بالفرصة التي تلك. الرسوم المتوقعة على الاستثمار ستنقص من صافي العائد. يرجى استشارة مستشارك الاستثماري قبل اتخاذ أي قرار استثماري. قد يكون هناك تأثير سلبي إضافي يجب على المستثمرين النظر في وضعهم المالي والخاص قبل اتخاذ أي منتج معين. صندوق يقبل عموم طلب المشورة من المهنيين في مجال الاستثمار والمقايير. يتم توفير التوضيحات التفصيلية والحدود المتعلقة بالمنتج في النشرات والأحكام وإقرارها بضرورة المحفظة التقديرية المحفظة على الصندوق وإدارة المحفظة التقديرية التي يجب إقرارها ومقومتها قبل الدخول فيها.