

هدف الصندوق

هو صندوق أسواق نقد عام مفتوح يستثمر في أدوات أسواق النقد المتوافقة مع الضوابط الشرعية المقررة من اللجنة الشرعية ويهدف إلى المحافظة على رأس المال المستثمر مع تحقيق معدل عائد مناسب.

معلومات الصندوق

تاريخ بدء الصندوق	1 يناير 1993
سعر الوحدة عند الطرح	1,000.0000
حجم الصندوق	1,324,032.43
نوع الصندوق	هو صندوق أسواق نقد عام مفتوح يستثمر في أدوات أسواق النقد المتوافقة مع الضوابط الشرعية
عملة الصندوق	الريال السعودي
مستوى المخاطر	منخفض المخاطر
المؤشر الاسترشادي	سعر تكلفة التحويل بين البنوك بالريال السعودية لمدة شهر
عدد مرات التوزيع	--
% رسوم الإدارة (الصندوق الحائزين المستمر فيها)	0.5 0.5
مستشار الاستثمار ومدير الصندوق من الجانب	--
عدد أيام المتوسط المرجح	1,744
نسبة الأتعاب الإجمالية	781,409.10
نسبة اقتراض	--
معاملة التأمين	--
استثمار مدير الصندوق	409,892,995.37
الأرباح الموزعة	--

معلومات الأسعار كما في نهاية الربع

سعر الوحدة نهاية الربع	2,527.4082
التغير في سعر الوحدة	0.60%
إجمالي وحجم الصندوق	521,995.21
إجمالي صافي الأصول	1,319,193,859.87
مؤشر التكلفة (P/E)	--

بيانات ملكية استثمارات الصندوق

ملكية تامة	100.00%
حق منفعة	--

العائد التراكمي (%)

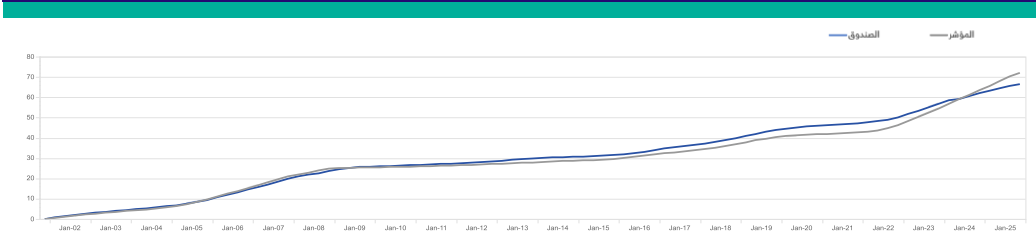
	ثلاثة أشهر (نهاية الربع الحالي)	منذ بداية السنة	سنة واحدة	ثلاث سنوات	خمس سنوات
أداء الصندوق	0.60	2.71	2.71	10.86	14.01
أداء المؤشر	1.15	5.31	5.31	17.61	21.45
عراق الأداء	-0.55	-2.59	-2.59	-6.75	-7.44

معايير الأداء والمخاطر

المعيار	ثلاثة أشهر (نهاية الربع الحالي)	منذ بداية السنة	سنة واحدة	ثلاث سنوات	خمس سنوات
1. الاندراج المعيارى	0.01%	0.09%	0.09%	0.40%	0.45%
2. مؤشر شارب	-30.23	-18.89	-18.89	-3.81	-1.44
3. حد التبع	0.02%	0.11%	0.11%	0.40%	0.41%
4. بيتا	-1.47	0.35	0.35	0.84	0.55
5. ألفا	0.76%	0.87%	0.87%	-1.11%	0.49%
6. مؤشر المعلومات	-25.78	-23.47	-23.47	-5.13	-3.16

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

مقارنة الأداء بين الصندوق والمؤشر الاسترشادي



معادلات معايير الأداء والمخاطر:

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

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

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

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

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

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

n: عدد فترات الأداء في العينة | r_t: العائد لفترة معينة | r_f: المعدل الفرضي (المؤشر) | f_t: متوسط العائد السنوي (الحالي من المخاطر) | σ: الانحراف المعياري السنوي | σ_{excess}: الانحراف المعياري السنوي للعائد فوق معدل المؤشر | β: معامل بيتا المحسنة بالنسبة للمؤشر

تفاصيل الاتصال

مكتب الرياض المالية الرئيسي
3128 البوlevard المالي | 6671 حي الفيلق، الرياض 13519 المملكة العربية السعودية
هاتف: 920012299 | البريد الإلكتروني: ask@riyadcapital.com | http://www.riyadcapital.com/ar/

أداء مسؤولي
أداء المساق يس مؤشرا وان معاد المعادلات المستخدمة يمكن ان تظهر قيمة الوحدات والحد منها أو تان. قد يلقى المستثمرون أقل مما استثمروا حيث أن الوافعة إلى تلك الرسوم المطلوبة على الأصول المالية صريف المعاملات قد يكون لها آثار سلبية إضافية يجب على المستثمرين البقاء في وعيهم الذي وبالتالي قبل اندراج في منتج معين، صندوق معين عليهم طلب المشورة من المهنيين في مجال الاستثمار والمقايير. يتم توفير التصنيف التقييمي والحدود المتعلقة بالمنتج في النشود والأحكام واقتراحات إدارة المحفظة التقديرية المحفظة على الصندوق وإدارة المحفظة التقديرية التي يجب قراءتها وفهمها قبل الدخول فيها.