

هدف الصندوق

هو صندوق عام مفتوح يستثمر في الأسهم السعودية المتوافقة مع الضوابط الشرعية المقررة من اللجنة الشرعية ويهدف إلى تحقيق تنمية رأسي المال على المدى الطويل

معلومات الصندوق

تاريخ بدء الصندوق	21 نوفمبر 1996
سعر الوحدة عند الطرح	1.00
حجم الصندوق	682,750,903.43
نوع الصندوق	صندوق استثماري عام مفتوح يستثمر في الأسهم السعودية المتوافقة مع الضوابط الشرعية
عملة الصندوق	الريال السعودي
مستوى المخاطر	عالي المخاطر
المؤشر الاسترشادي	مؤشر ستاندرد آند بورز لشركات المتوافقة مع الضوابط الشرعية
عدد مرات التوزيع	--
% رسوم الإدارة للصندوق الصافي المستثمر	1.50
مستشار الاستثمار ومدير الصندوق في الباطن	--
عدد أيام المتوسط المرجح	--
نسبة الأرباح الإجمالية	3,636,237.83 0.514%
نسبة الأرباح	--
معاملة التعامل	31,584.22 0.005%
استثمار مدير الصندوق	--
الأرباح الموزعة	--

معلومات الأسعار كما في نهاية الربع

سعر الوحدة نهاية الربع	16.89
التغير في سعر الوحدة	-8.45%
إجمالي وحجم الصندوق	40,373,309.50
إجمالي صافي الأصول	681,770,929.05
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
أداء الصندوق	-8.45	-6.81	-6.81	24.68	86.43
أداء المؤشر	-10.35	-13.87	-13.87	1.63	23.86
عراق الأداء	1.89	7.06	7.06	23.05	62.57

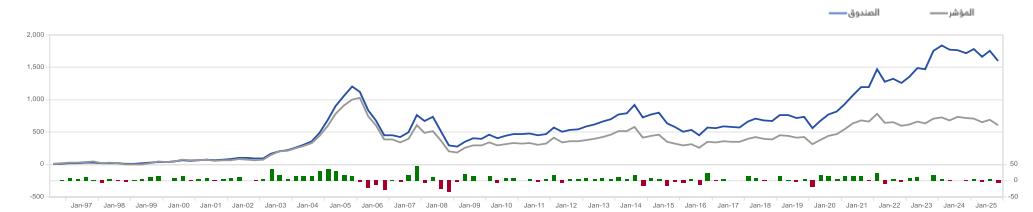
معايير الأداء والمخاطر

المقاييس	ثلاثة أشهر (نهاية الربع الحالي)	منذ بداية السنة	سنة واحدة	ثلاث سنوات	خمس سنوات
1. الانحراف المعياري	4.44%	15.99%	15.99%	16.95%	17.91%
2. مؤشر شارب	-2.14	-0.70	-0.70	0.15	0.56
3. خطأ التبع	0.27%	3.49%	3.49%	6.53%	5.68%
4. بيتا	1.01	1.04	1.04	1.02	1.00
5. ألفا	0.72%	8.85%	8.85%	7.28%	8.70%
6. مؤشر المعلومات	4.86	1.94	1.94	1.07	1.55

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

مقارنة الأداء بين الصندوق والمؤشر الاستثماري

--	--



معادلات معايير الأداء والمخاطر:

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

$$\alpha_t = r_t - [r_f + \beta * (r_{m,t} - r_f)] \quad (5)$$

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

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

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

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

n: عدد فترات الأداء في العينة ؛ r: العائد لفترة معينة ؛ r_p: متوسط العائد السنوي للصندوق (المؤشر) ؛ r_m: متوسط العائد السنوي للمؤشر ؛ σ: الانحراف المعياري السنوي ؛ σ_{excess}: الانحراف المعياري السنوي للعائد فوق عائد المؤشر ؛ β: معامل بيتا المعطاة بالنسبة للمؤشر

تفاصيل الاستثمار

مكتب الرياض المالية الرئيسي 3128بوليفارد المالي، 4671حي الفيلق، الرياض 13519 المملكة العربية السعودية هاتف: 92012299 البريد الإلكتروني: ask@riyadcapital.com http://www.riyadcapital.com/ar/	أغلب مسؤولي أداء المصالح ليس مؤشرا وان معادلات المعادلات الاستثمارية يمكن أن تظهر قيمة الوحدات والحد منها أو تظل. قد يخلق المستثمرون أخطأ مما استثمروا حيث لا يوافق على ذلك. الرسوم المتوقعة على الأموال باستثناء صريف المعادلات قد يكون لها آثار سلبية (إيجابية) على المستثمرين الباطن في استثمارهم الفعلي وبالمثل قبل الاندخول في منتج معين/صندوق معين يجب عليهم طلب المشورة من المهنيين في مجال الاستثمار والماليين. يتم توفير التوضيحات التفصيلية والحدود المتعلقة بالمنتج في النشرات والأحكام وإقرارها بدرجة المخاطرة التقديرية المحيطة على الصندوق وإدارة المخاطرة التقديرية التي يجب مراعاتها وفهمها قبل الدخول فيها.
--	--