

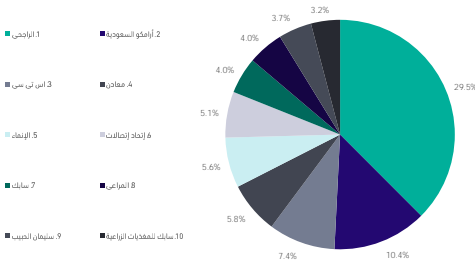
هدف الصندوق

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

معلومات الصندوق

تاريخ بدء الصندوق	21 نوفمبر 1996
سعر الوحدة عند الطرح	1.00
حجم الصندوق	723,823,929.92
نوع الصندوق	صندوق استثماري عام مفتوح يستثمر في الأسهم السعودية المتوافقة مع العواصم الشرعية
عملة الصندوق	الريال السعودي
مستوى المخاطر	عالي المخاطر
المؤشر الاسترشادي	مؤشر ستاندارد آند بورز لشركات المتوافقة مع العواصم الشرعية
عدد مرات التوزيع	--
% رسوم الإدارة للصندوق المصنّف المستكم	1.50
مستشار الاستثمار ومدير الصندوق من الباحثين	--
عدد أيام العكوس المردج	--
نسبة الأتعاب الإجمالية	0.482%
نسبة الأتعاب	--
مطابقة التكاليف	0.013%
استثمار مدير الصندوق	93,004.92
الأرباح الموزعة	--

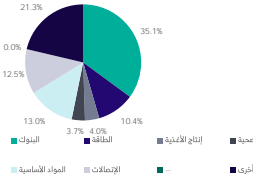
أكثر 10 استثمارات



توزيع الأصول الجغرافي



توزيع الأصول القطاعي



معلومات الأسعار كما في نهاية الربع

سعر الوحدة نهاية الربع	18.00
التغير في سعر الوحدة	6.58%
إجمالي وحجم الصندوق	40,137,100.90
إجمالي صافي الأصول	722,352,433.02
مؤشر الربحية (%)	--

بيانات ملكية استثمارات الصندوق

ملكية تامة	100.00%
حق منقحة	--

العائد التراكمي (%)

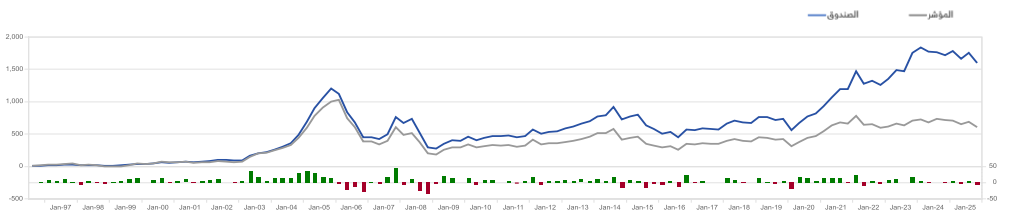
أداء الصندوق	ثلاثة أشهر انقضاء الربع الحالي	منذ بداية السنة	سنة واحدة	ثلاث سنوات	خمس سنوات
6.58	6.30	4.15	-4.15	24.66	76.56
0.28	0.28	3.47	-7.61	4.44	16.24
0.28	0.28	3.47	20.22	60.32	60.32

معايير الأداء والمخاطر

المقياس	ثلاثة أشهر انقضاء الربع الحالي	منذ بداية السنة	سنة واحدة	ثلاث سنوات	خمس سنوات
1. الانحراف المعياري	6.33%	6.33%	18.58%	17.23%	18.39%
2. مؤشر شارب	0.89	0.89	-0.45	0.15	0.46
3. خطأ التبع	0.10%	0.10%	1.96%	6.49%	5.63%
4. بيتا	0.99	0.99	0.98	1.02	1.01
5. ألفا	0.11%	0.11%	3.54%	6.29%	8.88%
6. مؤشر المعلومات	3.15	3.15	1.70	0.94	1.58

ملاحظة: تم إيراد بيان المقادير المستخدمة لحساب معايير الأداء والمخاطر الرسم الهيكلي.

مقارنة الأداء بين الصندوق والمؤشر الاسترشادي



معادلات معايير الأداء والمخاطر:

$$IR = \frac{E(r_p - r_f)}{\sigma_{excess}} \quad (6) \quad \alpha_T = r_T - [r_f + \beta * (r_M - r_f)] \quad (5) \quad \beta = \frac{Cov(r_p, r_M)}{Var(r_M)} \quad (4) \quad \sigma = \sqrt{\frac{n \sum r_i^2 - (\sum r_i)^2}{n^2}} \quad (3) \quad SR = \frac{r_p - r_f}{\sigma_p} \quad (2) \quad s = \sqrt{\frac{n \sum r_i^2 - (\sum r_i)^2}{n^2 - n}} \quad (1)$$

n: عدد فترات العائد في العينة ؛ r<sub>T</sub>: العائد لفترة معينة ؛ r<sub>p</sub>: متوسط العائد السنوي للمحفظة (المؤشر) ؛ r<sub>M</sub>: متوسط العائد السنوي الحالي من المخاطر ؛ σ: الانحراف المعياري السنوي ؛ σ<sub>excess</sub>: الانحراف المعياري السنوي للمحفظة فوق عائد المؤشر ؛ β: معامل بيتا المحفظة بالنسبة للمؤشر

تفاصيل التمثيل

مكتب الرياض المالية الرئيسي

3128 البوlevard - الطابق 4، 6671 الرياض، المملكة العربية السعودية  
 هاتفنا: 920012299 | البريد الإلكتروني: ask@riyadcapital.com  
 http://www.riyadcapital.com/ar/

أغلب مسئولية  
 الأداء السابق ليس مؤشراً على أداء الاستثمارات المستقبلية. يمكن أن تتغير قيمة الوحدات وحاصلها أو يتغير حد يغطي المستثمرين أقل مما استثمروه حتى، بالإضافة إلى ذلك، الرسوم المتوقعة على الأموال باستثناء صافي العائد قد يكون لها آثار سلبية (إيجابية) على المستثمرين الذين يشاركون في استثمارهم. يرجى قراءة الوثائق المتعلقة بالصندوق بعناية قبل طلب المشورة من المهنيين في حال الاستثمار والمخاطر. يتم توفير التوضيحات والتعليقات المتعلقة بالمنتجات والخدمات والأحكام وكافة إدارة المحفظة التقنية المحفظة على الصندوق وإدارة المحفظة التقنية التي يجب قراءتها وفهمها قبل اتخاذ أي قرار.