

هدف الصندوق

هو صندوق قابض عام مفتوح يستثمر في مجموعة من الصناديق المتوافقة مع الضوابط الشرعية المقررة من اللجنة الشرعية بهدف إلى نمو رأس المال على المدى الطويل في ظل مخاطر عالية.

معلومات الصندوق

تاريخ بدء الصندوق	31 ديسمبر 2002
سعر الوحدة عند الطرح	10.00
حجم الصندوق	15,502,647.28
نوع الصندوق	هو صندوق قابض عام مفتوح يستثمر في مجموعة من الصناديق المتوافقة مع الضوابط الشرعية
عملة الصندوق	الريال السعودي
مستوى المخاطر	عالي المخاطر
المؤشر الاسترشادي	DJ Islamic Markets S&P Saudi Shariah Dow Jones Sukuk Total Return (ex-Reinvestment) سعر تكلفة التمويل بين البنوك لرابال السعودي لمدة شهر
عدد مرات التوزيع	--
% رسوم الإدارة الصندوق، الصندوق المستثمر 1.85 - 0.50	--
مستشار الاستثمار ومدير الصندوق من الجانب	--
عدد أيام التوسيد المردج	--
نسبة الأيام المتاحة الجمالية	58,735.10
نسبة الاقتراض	--
معاريف التعامل	--
استثمار مدير الصندوق	--
الأرباح الموزعة	--

معلومات الأسعار كما في نهاية الربع

سعر الوحدة نهاية الربع	41.04
التغير في سعر الوحدة	1.08%
إجمالي وحداث الصندوق	374,677.59
إجمالي صافي الأصول	15,378,164.18
مركز 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	1.08	8.96	8.96	40.49	40.15
أداء المؤشر	0.96	10.76	10.76	43.99	40.65
عراق الأداء	0.12	-1.80	-1.80	-3.50	-0.50

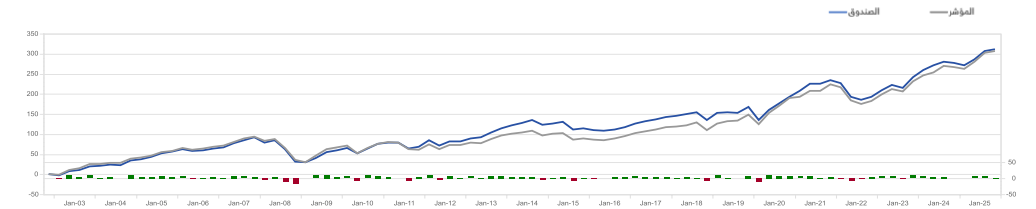
معايير الأداء والمخاطر

	ثلاثة اشهر نهاية الربع الحالي	منذ بداية السنة	سنة واحدة	ثلاث سنوات	خمس سنوات
1. الانحراف المعياري	1.40%	5.96%	5.96%	7.52%	8.53%
2. مؤشر شارب	0.04	0.77	0.77	0.93	0.43
3. حد التبع	0.12%	1.17%	1.17%	1.70%	2.62%
4. بيتا	0.99	1.00	1.00	0.98	0.95
5. ألفا	0.04%	-1.62%	-1.62%	-0.53%	0.28%
6. مؤشر المعلومات	0.99	-1.48	-1.48	-0.54	-0.03

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

مقارنة الأداء بين الصندوق والمؤشر الاسترشادي

--	--



معادلات معايير الأداء والمخاطر:

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

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

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

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

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

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

n: عدد فترات الأداء في العينة ؛ r: العائد لفترة معينة ؛ r_p: متوسط العائد السنوي للصندوق (المؤشر) ؛ r_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
3128 البوlevard العالمي 4671 حي العقيق، الرياض 13519 المملكة العربية السعودية
هاتف: 920112299 | البريد الإلكتروني: ask@riyadcapital.com | http://www.riyadcapital.com/ar/

أداء مسؤولية
أداء الاستثمار ليس مؤشرا على ضمان الأداء المستقبلي. يمكن أن تظهر قيمة الوحدات والحد منها أو تظل دون سقف الاستثمار أو حتى تستثمرها جميعا، بالإضافة إلى ذلك، الرسوم المتوقعة على الاستثمارات ستزيد المصاحبات قد يكون لها آثار سلبية إضافية يجب على المستثمرين النظر في وضعهم المالي والخاص قبل اتخاذ أي منتج معين. صندوق يقود عائد غير مضمون طلب المشورة من المهنيين في مجال الاستثمار والماليين. يتم توفير التوضيحات والتعليقات المتعلقة بالمنتجات في نشرة والأحكام واقتراعية إدرة المحفظة التقنية المحفظة على الصندوق وإدارة المحفظة التقنية التي يجب قراءتها وفهمها قبل الدخول فيها.