

هدف الصندوق

هو صندوق عام مفتوح يستثمر أمواله بشكل رئيسي في أسهم الشركات المتوسطة والصغيرة والمتناهية الصغر المدرجة في سوق الأسهم السعودية المتوافقة مع التوجيهات الشرعية الصادرة من اللجنة الشرعية التي يحددها مؤشر الصندوق

معلومات الصندوق

تاريخ بدء الصندوق	30 ديسمبر 2009
سعر الوحدة عند الطرح	10.00
حجم الصندوق	55,527,368.02
نوع الصندوق	صندوق استثماري عام مفتوح يستثمر في أسهم الشركات السعودية المتوسطة والصغيرة المتوافقة مع التوجيهات الشرعية
عملة الصندوق	الريال السعودي
مستوى المخاطر	عالي المخاطر
المؤشر الاسترشادي	(إدراج ريندز) إسلامي الإسهام الصغيرة والمتوسطة والواحدة للسوق السعودي
عدد مرات التوزيع	--
% رسوم الإدارة الصندوق، الصندوق المستثمر	1.75
مستشار الاستثمار ومدير الصندوق من الجانب	--
عدد أيام المتوسط المرجح	--
نسبة الأرباح العائلية	352,282.41 0.615%
نسبة الاقتراض	--
معاريف التعامل	9,990.00 0.018%
استثمار مدير الصندوق	--
الأرباح الموزعة	--

معلومات الأسعار كما في نهاية الربع

سعر الوحدة نهاية الربع	48.64
التغير في سعر الوحدة	-9.11%
إجمالي وحجم الصندوق	1,136,263.07
إجمالي صافي الأصول	55,264,500.72
مكرر الربحية (P/E)	--

بيانات ملكية استثمارات الصندوق

ملكية تامة	100.00%
حق منفعة	--

العائد التراكمي (%)

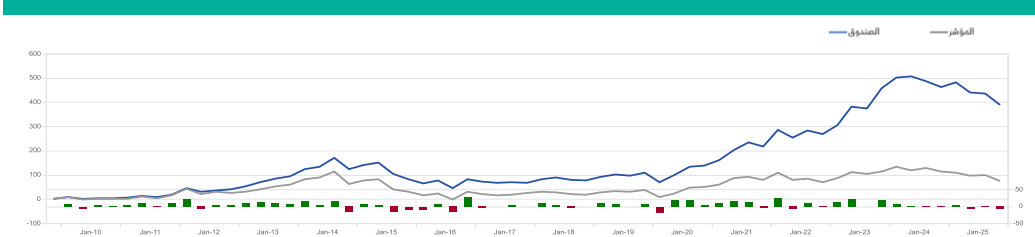
أداء الصندوق	ثلاثة أشهر انهاء الربع الحالي	منذ بداية السنة	سنة واحدة	ثلاث سنوات	خمس سنوات
أداء المؤشر	-9.11	-13.45	-13.45	32.70	105.24
عراق الأداء	-12.23	-18.61	-18.61	2.37	17.03
	3.12	5.16	5.16	30.33	88.21

معايير الأداء والمخاطر

المقاييس	ثلاثة أشهر انهاء الربع الحالي	منذ بداية السنة	سنة واحدة	ثلاث سنوات	خمس سنوات
1 الانحراف المعياري	4.74%	16.11%	16.11%	19.21%	18.69%
2 مؤشر شارب	-2.14	-1.11	-1.11	0.25	0.65
3 حد التبع	0.30%	5.34%	5.34%	8.76%	7.54%
4 بيتا	1.01	0.99	0.99	1.05	1.00
5 ألفا	1.18%	6.21%	6.21%	9.45%	12.21%
6 مؤشر المعلومات	6.92	0.92	0.92	1.03	1.61

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

مقارنة الأداء بين الصندوق والمؤشر الاسترشادي



معادلات معايير الأداء والمخاطر:

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

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

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

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

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

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

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

تفاصيل الاتصال

مكتب الرياض المالية الرئيسي
3128بوليفارد المالي، 4671حي العقيق، الرياض 13519 المملكة العربية السعودية
الهاتف: 920012299 | البريد الإلكتروني: ask@riyadcapital.com
http://www.riyadcapital.com/ar/

أغلق مسؤولية
الأداء السابق ليس مؤشرا على أداء الاستثمارات المستقبلية. يمكن أن تشهد قيمة الوحدات والحد منها أو تان. قد يخفى المستثمرون أقل مما استثمروا حيث، بالإضافة إلى ذلك، الرسوم المتوقعة على الأموال باستثناء صافي العائدات قد يكون لها آثار سلبية إضافية يجب على المستثمرين النظر في وضعهم المالي واليالي قبل اتخاذ أي منتج معين. صندوق معين يجب عليهم طلب المشورة من المهنيين في مجال الاستثمار والملاوي. يتم توفير التوضيح التفصيلي والحدود المتعلقة بالمنتج في النشود والأحكام واقتضية إدارة المحفظة التقديرية المحفظة على الصندوق وإدارة المحفظة التقديرية التي يجب قراءتها وفهمها قبل الدخول فيها.