

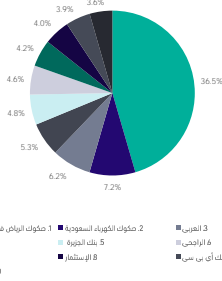
هدف الصندوق

هو صندوق أدوات دين عام مفتوح يستثمر في أدوات الدين المتوافقة مع العواصم الشرعية المقررة من قبل اللجنة الشرعية. ويهدف إلى تحقيق التوازن بين المخاطرة على رأس المال وتحقيق عائد مناسب عليه.

معلومات الصندوق

تاريخ بدء الصندوق	18 يونيو 1988
سعر الوحدة عند الطرح	10.0000
حجم الصندوق	56,895,634.71
نوع الصندوق	صندوق الرياض للمتاجرة المتنوع بالدولار هو صندوق أدوات دين عام مفتوح يستثمر في أدوات الدين المتوافقة مع العواصم الشرعية.
عملة الصندوق	الدولار الأمريكي
مستوى المخاطر	متنخفض إلى متوسط المخاطر
المؤشر الاسترشادي	سعر تكلفة التمويل بين البنوك بالدولار الأمريكي لمدة 3 شهور

أكبر 10 استثمارات

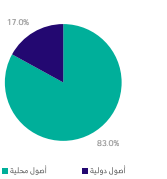


بيان التصنيف الائتماني

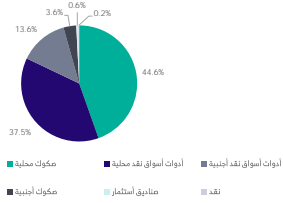
المصدر	أداة الاستثمار	التقييم	التاريخ	الوكالة	الرقم
Fitch	A	SAP	31-03-25	A	1
Fitch	B+	SAP	18-03-25	A+	2
Fitch	A	SAP	29-03-23	A-	3
SAP	A+	SAP	29-03-23	A-	4
--	--	Fitch	17-04-23	A-	5
--	--	SAP	18-03-25	A	6
--	--	SAP	08-11-21	BBB-	7
Moody's	Ba1	Fitch	17-04-23	A-	8
--	--	SAP	08-11-21	BBB-	9
--	--	Moody's	19-07-22	Ba1	10

صفحة التقييم: DD-MM-YY

توزيع الأصول الجغرافي



توزيع الأصول النوعي



معلومات التوزيع

عدد مرات التوزيع	--
% رسوم الإدارة (الصندوق) العائد المضمّن فيها	0.5 0.5
مستشار الاستثمار ومدير الصندوق من الجانبين	--
عدد أيام التوسيط المردج	2
نسبة الأعباء التشغيلية	86,787.78
نسبة الأرباح	0.153%
مخاطرة التكاليف	--
استثمار مدير الصندوق	9,019,212.25
الأرباح الموزعة	--

معلومات الأسعار كما في نهاية الربع

سعر الوحدة نهاية الربع	30.619%
التغير في سعر الوحدة	0.45%
إجمالي وحجم الصندوق	1,857,494.09
إجمالي صافي الأصول	56,875,617.40
مركز الربحية (%)	--

بيانات ملكية استثمارات الصندوق

ملكية تامة	100.00%
حق منقعة	--

العائد التراكمي (%)

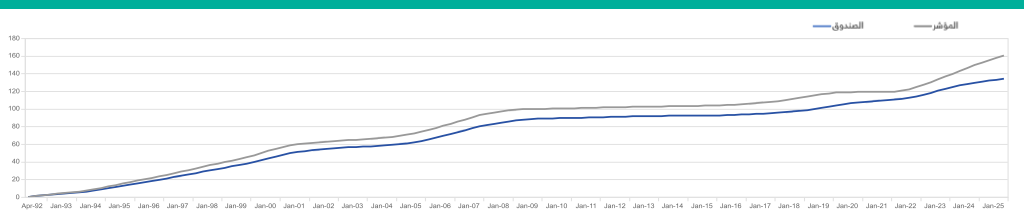
ثلاثة اشهر (نهاية الربع الحالي)	منذ بداية السنة	سنة واحدة	ثلاث سنوات	خمس سنوات
0.45	0.45	1.95	8.81	13.26
0.93	0.93	4.19	15.62	19.91
-0.48	-0.48	-2.23	-6.81	-6.64

معايير الأداء والمخاطر

المقياس	ثلاثة اشهر (نهاية الربع الحالي)	منذ بداية السنة	سنة واحدة	ثلاث سنوات	خمس سنوات
1. الانحراف المعياري	0.02%	0.02%	0.10%	0.29%	0.31%
2. مؤشر شارب	-23.77	-23.77	-21.84	-7.31	-3.13
3. خطأ التبع	0.02%	0.02%	0.12%	0.17%	0.38%
4. بيتا	0.79	0.79	0.17	1.27	0.43
5. ألفا	-0.09%	-0.09%	1.24%	-3.29%	0.94%
6. مؤشر المعلومات	-29.95	-29.95	-17.51	-11.88	-3.09

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

مقارنة الأداء بين الصندوق والمؤشر الاسترشادي



معادلات معايير الأداء والمخاطر:

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

n: عدد فترات العائد في العينة | r_f : العائد الخالي من مخاطر | r_m : متوسط العائد السنوي للمحفظة (المؤشر) | r_p : متوسط العائد السنوي الحالي من المخاطر | σ : الانحراف المعياري السنوي | σ_{excess} : الانحراف المعياري السنوي للعائد فوق معدل المؤشر | β : معامل بيتا المحفظة بالنسبة للمؤشر

تفاصيل التمثيل

مكتب الرياض المالية الرئيسي: 3128 البوليفارد، الطابق 4، 6671 ج. العهد، الرياض 13519 المملكة العربية السعودية | هاتف: 920012299 | البريد الإلكتروني: ask@riyadcapital.com | http://www.riyadcapital.com/ar/