

هدف الصندوق

هو صندوق قابض عام مفتوح يستثمر في مجموعة من الصناديق المتوافقة مع الصناديق الشرعية المقررة من اللجنة الشرعية بهدف إلى المحافظة على رأس المال المستثمر وتحقيق معدل عائد ملائم على المدى القصير في ظل مخاطر محدودة.

معلومات الصندوق

تاريخ بدء الصندوق	31 ديسمبر 2002
سعر الوحدة عند الطرح	10.00
حجم الصندوق	22,792,166.02
نوع الصندوق	هو صندوق قابض عام مفتوح يستثمر في مجموعة من الصناديق المتوافقة مع الصناديق الشرعية
عملة الصندوق	الريال السعودي
مستوى المخاطر	محدود المخاطر
المؤشر الاسترشادي	■ S&P Saudi Shariah ■ DJ Islamic Markets ■ Dow Jones Sukuk Total Return (ex-Reinvestment) ■ سعر تكلفة التمويل بين البنوك بالريال السعودي لمدة شهر
عدد مرات التوزيع	--
نسوم الإرداة (الصندوق / الصناديق المستثمر) 0.1 - 0.50 - 1.85	--
مستشار الاستثمار ومدير الصندوق في الباطن	--
عدد أيام التوسيد المردج	--
نسبة الأرباح العائلية	38,421.97 0.176%
نسبة الاقتراض	--
معاريف التعامل	27.50 0.000%
استثمار مدير الصندوق	--
الأرباح الموزعة	--

معلومات الأسعار كما في نهاية الربع

سعر الوحدة نهاية الربع	18.97
التغير في سعر الوحدة	2.50%
إجمالي وحداث الصندوق	1,197,498.51
إجمالي صافي الأصول	22,718,050.95
مركز الربحية (P/E)	--

بيانات ملكية استثمارات الصندوق

ملكية تامة	100.00%
حصة منقصة	--

العائد التراكمي (%)

	ثلاثة اشهر نهاية الربع الحالي	منذ بداية السنة	سنة واحدة	ثلاث سنوات	خمس سنوات
أداء الصندوق	2.50	2.82	6.07	17.19	20.59
أداء المؤشر	2.59	3.15	6.78	21.43	27.01
عراق الأداء	-0.09	-0.33	-0.71	-4.24	-6.42

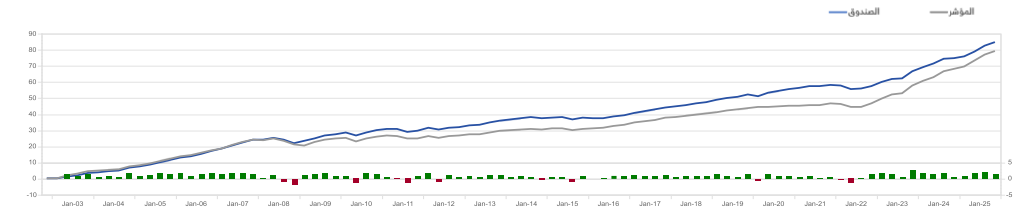
معايير الأداء والمخاطر

	ثلاثة اشهر نهاية الربع الحالي	منذ بداية السنة	سنة واحدة	ثلاث سنوات	خمس سنوات
1. الانحراف المعياري	0.44%	0.63%	1.58%	1.58%	1.72%
2. مؤشر شارب	3.54	1.50	1.20	0.36	0.08
3. حدح التبع	0.37%	0.26%	0.68%	0.49%	0.49%
4. بيتا	0.61	0.91	0.91	0.94	0.92
5. ألفا	0.31%	-0.01%	-0.04%	-0.77%	-0.65%
6. مؤشر المعلومات	-0.25	-0.69	-0.99	-2.53	-2.17

ملاحظة: تم إيراد بيان المقاييس المستخدمة لتحاسب معايير الأداء والمخاطر لأسفل الرسم البياني.

مقارنة الأداء بين الصندوق والمؤشر الاسترشادي

--



معادلات معايير الأداء والمخاطر:

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

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

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

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

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

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

n: عدد فترات الأداء في العينة | r_f: العائد الخازر معينة | r_p: م_{صندوق} متوسط العائد السنوي للمحفظة (المؤشر) | f_ص: متوسط العائد السنوي الحالي من المخاطر | σ: الانحراف المعياري السنوي | σ_{excess}: الانحراف المعياري السنوي للعائد فوق معدل المؤشر | β: معامل بيتا للمحفظة بالنسبة للمؤشر

تفاصيل الاتصال

مكتب الرياض المالية الرئيسي
3128بوليفارد المالي | 671هـ-الرياض | العقيل، الرياض 13519 المملكة العربية السعودية
هاتف: 920012299 | البريد الإلكتروني: ask@riyadcapital.com | http://www.riyadcapital.com/ar/

الأداء مسؤولية
الأداء السابق ليس مؤشرا وان معادلات المعادلات المستخدمة يمكن أن تظهر قيمة الوحدات والحد منها أو تان. قد يفتي المستثمرون أقل مما استثمروا حيث أن الواقع إلى ذلك. الرسوم المتوقعة على الأموال باستثناء صافي المصداقات 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 التوضيحات التفصيلية المتعلقة بالمنتج في النشود والأحكام وإقرارية إدارة المحفظة التقديرية المحفظة على الصندوق وإدارة المحفظة التقديرية التي يجب قراءتها وفهمها قبل الدخول فيها.