

صندوق الرياض المتوازن المتوافق مع الشريعة

هدف الصندوق

هو صندوق قابض عام مفتوح يستثمر في مجموعة من الصناديق المتوافقة مع الصوابط الشرعية المقررة من اللجنة الشرعية ويهدف الى تحقيق التوازن بين نمو وحماية رأس المال على المدى المتوسط و الطويل في ظل مخاطر متوسطة.

معلومات الصندوق

تاريخ بدء الصندوق	31 ديسمبر 2002
سعر الوحدة عند الطرح	10.00
حجم الصندوق	27,387,546.40
نوع الصندوق	هو صندوق قابض عام مفتوح يستثمر في مجموعة من الصناديق المتوافقة مع الصوابط الشرعية
عملة الصندوق	الريال السعودي
مستوى المخاطر	متوسط المخاطر
المؤشر الاسترشادي	S&P Saudi Shariah Dow Jones Sukuk Total Return (ex-Reinvestment) DJ Islamic Markets سعر تكلفة التمويل بين البنوك بالريال السعودي لمدة شهر
عدد مرات التوزيع	--
% رسوم الإدارة (الصندوق / الصندق المستثمر) 0.4 - 1.85	--
مستشار الاستثمار ومدير الصندوق من الجانب	--
عدد أيام المتوسط المرجح	--
نسبة الأرباح الاجتماعية	66,734.76
نسبة الاقتراض	--
معاريف التعامل	259.21
استثمار مدير الصندوق	--
الأرباح الموزعة	--

معلومات الأسعار كما في نهاية الربع

سعر الوحدة نهاية الربع	35.03
التغير في سعر الوحدة	6.61%
إجمالي وحداث الصندوق	779,425.64
إجمالي صافي الأصول	27,304,979.83
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	6.61	5.11	10.58	29.49	30.10
أداء المؤشر	6.66	5.96	11.90	32.53	36.66
عراق الأداء	-0.05	-0.86	-1.32	-3.04	-6.56

معايير الأداء والمخاطر

المقاييس	ثلاثة اشهر نهاية الربع الحالي	منذ بداية السنة	سنة واحدة	ثلاث سنوات	خمس سنوات
1. الانحراف المعياري	1.72%	2.27%	5.95%	5.77%	6.11%
2. مؤشر شارب	3.30	1.43	1.10	0.72	0.28
3. حدح التبع	1.00%	0.72%	1.88%	1.49%	1.65%
4. بيتا	0.74	0.93	0.91	0.97	0.94
5. ألفا	0.55%	-0.07%	-0.23%	-0.49%	-0.58%
6. مؤشر المعلومات	-0.06	-0.66	-0.67	-0.56	-0.62

ملاحظة: تم إيراد بيان المقاييس المستخدمة لحساب معايير الأداء والمخاطر والرسم البياني.

مقارنة الأداء بين الصندوق والمؤشر الاسترشادي

--	--



معادلات معايير الأداء والمخاطر:

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

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

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

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

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

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

n :عدد فترات الأداء في العينة | r :الأداء لفترة معينة | r_p :معدل العائد السنوي للمحفظة (المؤشر) | f :معدل العائد السنوي الداخلي 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
3128بوليفارد المالي | 6671 حي العقيق، الرياض 13519 المملكة العربية السعودية
هاتف: 920012299 | البريد الإلكتروني: ask@riyadcapital.com | http://www.riyadcapital.com/ar/

أغلب مسؤولي
الأداء السابق ليس مؤشرا على ضمان أداء صناديق الاستثمار المستقبلية. يمكن أن يتغير قيمة الوحدات والحدود منها أو تأن. قد يخلق المستثمرون أرباحا مع استئجارهم أرباحا بالوفاء إلى ذلك. الرسوم المتوقعة على الأموال باستثناء صافي العائدات قد يكون لها آثار سلبية إضافية يجب على المستثمرين البقاء في وعيهم التغيرات والتي يمكن أن تحدث في صناديق حقوق عقود عليهم طلب المشورة من المهنيين في مجال الاستثمار والملازم. يتم توفير التوضيحات والتعليقات والمحددات المتعلقة بالمنتجات والخدمات والأحكام والاختصاصات لإدارة المحفظة التقديرية المحفظة على الصندوق وإدارة المحفظة التقديرية التي يجب مراعاتها وفهمها قبل الدخول فيها.