

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	16,969,526.67
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	Dow Jones Sukuk Total Return (ex-Reinvestment) S&P Saudi Shariah DJ Islamic Markets سعر تكلفة التمويل بين البنوك بالريال السعودي لمدة شهر
عدد مرات التوزيع	--
نسوم الإرداة (الصندوق / الصندوق المستثمر)	1.85 - 0.50 0.65
مستشار الاستثمار ومدير الصندوق من الجانب	--
عدد أيام المتوسط المرجح	--
نسبة الأتباع الإجمالية	57,649.80
نسبة الاقتراض	0.351%
معاريف التعامل	144.73
استثمار مدير الصندوق	--
الأرباح الموزعة	--

معلومات الأسعار كما في نهاية الربع

سعر الوحدة نهاية الربع	43.66
التغير في سعر الوحدة	9.05%
إجمالي وحجم الصندوق	384,000.02
إجمالي صافي الأصول	16,765,847.65
مكرر الربحية (P/E)	--

بيانات ملكية استثمارات الصندوق

ملكية تامة	100.00%
ملكية منقصة	--

العائد التراكمي (%)

	ثلاثة اشهر نهاية الربع الحالي	منذ بداية السنة	سنة واحدة	ثلاث سنوات	خمس سنوات
أداء الصندوق	9.05	6.38	13.08	35.47	34.40
أداء المؤشر	9.34	7.98	15.46	40.43	42.60
عارق الأداء	-0.29	-1.60	-2.38	-4.96	-8.21

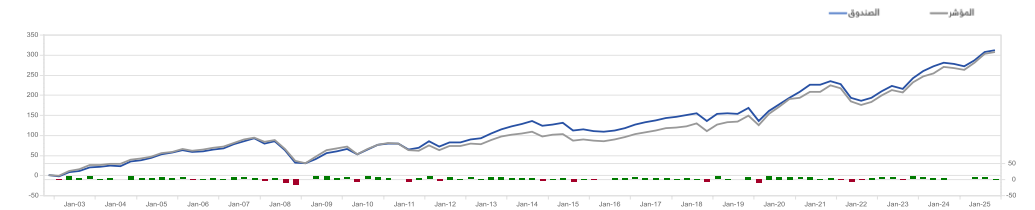
معايير الأداء والمخاطر

المعيار	ثلاثة اشهر نهاية الربع الحالي	منذ بداية السنة	سنة واحدة	ثلاث سنوات	خمس سنوات
1. الانحراف المعياري	2.60%	3.27%	8.63%	8.27%	8.92%
2. مؤشر شارب	3.13	1.38	1.05	0.70	0.27
3. حد التبع	1.32%	0.94%	2.51%	2.04%	2.33%
4. بيتا	0.78	0.93	0.92	0.97	0.94
5. ألفا	0.58%	-0.17%	-0.93%	-0.81%	-0.74%
6. مؤشر المعلومات	-0.27	-0.96	-0.91	-0.65	-0.54

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

مقارنة الأداء بين الصندوق والمؤشر الاسترشادي

--	--



معادلات معايير الأداء والمخاطر:

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

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

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

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

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

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

n: عدد فترات الأداء في العينة | r_t: العائد لفترة معينة | r_f: معدل الخزانة السنوي (المعيار) | f_r: متوسط العائد السنوي الحالي من المخاطر | σ: الانحراف المعياري السنوي | σ_{excess}: الانحراف المعياري السنوي للعائد فوق عائد المؤشر | β: معامل بيتا للمحفظة بالنسبة للمؤشر

تفاصيل الاتصال

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

أداء مسؤولية
أداء الاستثمار ليس مؤشراً على ضمان النجاح المستقبلي. يمكن أن تظهر قيمة الوحدات والحد منها أو تظل دون تحقيق الاستثمار أو حتى مما استثمرتمو، حيث لا يضمن أي ذلك. الرسوم المتوقعة على الاستثمارات ليست المصروفات قد يكون لها آثار سلبية إضافية يجب على المستثمرين النظر في وضعهم المالي والي مالي الحد في منتج معين /صندوق معين. عليهم طلب المشورة من المهنيين في مجال الاستثمار والمالي. يتم توفير التوضيح التفصيلي والحدود المتعلق بالمنتج في النشود والأحكام وإقرارها لإدارة المحفظة التقنية المحفظة على الصندوق وإدارة المحفظة التقنية التي يجب قراءتها وفهمها قبل الدخول فيها.