

هدف الصندوق

هو صندوق عام مفتوح يستثمر أصوله بشكل رئيسي في أسهم الشركات المدرجة في السوق السعودي وأدوات اسواق النقد والدخل الثابت المتفقة مع الضوابط الشرعية والتي يحددها مؤشر الصندوق

معلومات الصندوق

تاريخ بدء الصندوق	15 مارس 2005
سعر الوحدة عند الطرح	10.00
حجم الصندوق	33,275,319.81
نوع الصندوق	صندوق استثماري عام مفتوح يستثمر في الاسهم السعودية المتوافقة مع الضوابط الشرعية
عملة الصندوق	الريال السعودي
مستوى المخاطر	عالي المخاطر
المؤشر الاسترشادي	مؤشر مركب يتكون من مؤشر صندوق الرياض للدخل المتوازن المتوافق مع الضوابط الشرعية المقدم من شركة إدراج يتأخذ بنسبة 50 %وسعر تكلفة التمويل بين البنوك بالريال السعودي لمدة ستة أشهر بنسبة 50%
عدد مرات التوزيع	--
% رسوم الإدارة الصندوق / الصندوق المستثمر 0.125 0.5	
مستشار الاستثمار ومدير الصندوق من الجانب	--
عدد أيام المتوسط المرجح	--
نسبة الأرباح التجارية	184,898.57 0.502%
نسبة الاقتراض	--
معاريف الترخيص	5,978.68 0.018%
استثمار مدير الصندوق	--
الأرباح الموزعة	--

معلومات الأسعار كما في نهاية الربع

سعر الوحدة نهاية الربع	27.64
التغير في سعر الوحدة	-2.21%
إجمالي وحجم الصندوق	1,202,651.53
إجمالي صافي الأصول	33,242,256.00
مركز الرتبة (P/E)	--

بيانات ملكية استثمارات الصندوق

ملكية تامة	100.00%
حق منفعة	--

العائد التراكمي (%)

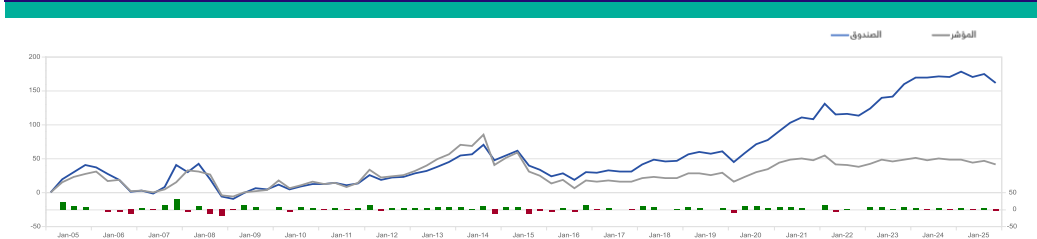
	ثلاثة اشهر االنهاية الربع الحالي	منذ بداية السنة	سنة واحدة	ثلاث سنوات	خمس سنوات
أداء الصندوق	-2.21	1.90	-1.67	11.25	31.38
أداء المؤشر	-1.72	2.70	0.60	-2.51	-2.30
عراق الأداء	-0.49	-0.80	-2.26	13.76	33.67

معايير الأداء والمخاطر

	ثلاثة اشهر االنهاية الربع الحالي	منذ بداية السنة	سنة واحدة	ثلاث سنوات	خمس سنوات
1 الانحراف المعياري	0.64%	2.62%	8.86%	8.20%	9.15%
2 مؤشر شارب	-4.91	0.01	-0.65	-0.15	0.21
3 حد التبع	0.04%	0.38%	2.17%	3.52%	3.51%
4 بيتا	0.97	1.08	1.06	1.19	1.19
5 ألفا	-0.18%	-0.16%	-2.24%	4.76%	6.31%
6 مؤشر المعلومات	-10.68	-1.12	-1.00	1.25	1.72

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

مقارنة الأداء بين الصندوق والمؤشر الاسترشادي



معادلات معايير الأداء والمخاطر:

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

$$\alpha_T = r_T - [r_f + \beta * (r_S - r_f)] \quad (5)$$

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

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

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

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

n: عدد فترات الأداء في العينة ؛ r: العائد لفترة معينة ؛ r_p: متوسط العائد السنوي للصندوق (المؤشر) ؛ r_f: متوسط العائد السنوي الخالي 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 | 671هـ، العقيل، الرياض 13519 المملكة العربية السعودية
هاتف: 920012299 | البريد الإلكتروني: ask@riyadcapital.com | http://www.riyadcapital.com/ar/

أفكار مسئولية
أداء الاستثمار ليس مؤشرا على ضمان العوائد المستقبلية. يمكن أن تتغير قيمة الوحدات والدخل منها أو تُلغى. قد يخضع المستثمون قبل وما استثموا بعدا، بالإضافة إلى ذلك، الرسوم المتوقعة على الأموال باستثناء صافي العائدات قد يكون لها آثار سلبية إضافية على قيمتهم البذرة في استثمارهم البذري والمالي قبل الدخول في منتج معين/صندوق معين. نطلب المشورة من المهنيين في مجال الاستثمار والماليين. يتم توفير التوضيحات والتعليقات والبيانات في النشرات والأحكام واقتراحات إدارة المحفظة التقديرية المحفظة على الصندوق وإدارة المحفظة التقديرية التي يجب قراءتها وفهمها قبل الدخول فيها.

الرياض المالية شركة مساهمة مسجلة رأس المال المدفوع 500 مليون ريال سعودي تعمل بموجب ترخيص من هيئة السوق المالية رقم (37-107879)وسجل تجاري رقم 102823234 الإذرة العامة 3128 البوليفارد المالي، 671هـ، العقيل، الرياض 13519، المملكة العربية السعودية.