

هدف الصندوق

هو صندوق عام مفتوح يستثمر في الأسهم السعودية ويهدف الى تحقيق تنمية رأسي المال على المدى الطويل.

معلومات الصندوق

تاريخ بدء الصندوق	31 ديسمبر 2000
سعر الوحدة عند الطرح	9.72
حجم الصندوق	851,752,530.64
نوع الصندوق	صندوق استثماري عام مفتوح يستثمر في الأسهم السعودية.
عملة الصندوق	الريال السعودي
مستوى المخاطر	عالي المخاطر
المؤشر الاسترشادي	إدخال ريتنكز للأسهم الكبرى للسوق السعودي المستثمر (السعودي)
عدد مرات التوزيع	--
% رسوم الإدارة الصندوق, الصندوق المستثم	1.50
مستشار الاستثمار ومدير الصندوق من الجانب	--
عدد أيام المتوسط المرجح	--
نسبة الأرباح الإجمالية	4,417,240.24
نسبة الأرباح	0.506%
معاريف التعامل	26,217.15
استثمار مدير الصندوق	--
الأرباح الموزعة	--

معلومات الأسعار كما في نهاية الربع

سعر الوحدة نهاية الربع	109.11
التغير في سعر الوحدة	-4.42%
إجمالي وحداث الصندوق	7,804,117.13
إجمالي صافي الأصول	851,485,846.75
مركز الربحية (P/E)	--

بيانات ملكية استثمارات الصندوق

ملكية تامة	100.00%
حق منفعة	--

العائد التراكمي (%)

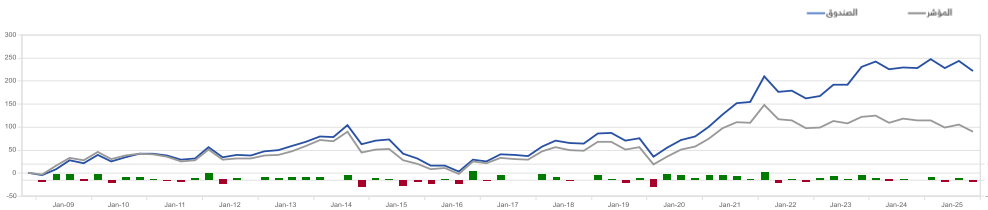
	ثلاثة اشهر (نهاية الربع الحالي)	منذ بداية السنة	سنة واحدة	ثلاث سنوات	خمس سنوات
أداء الصندوق	-4.42	3.66	1.64	14.09	46.35
أداء المؤشر	-4.84	4.63	0.38	-6.30	1.15
عراق الأداء	0.42	-0.97	1.26	20.39	45.20

معايير الأداء والمخاطر

المعيار	ثلاثة اشهر (نهاية الربع الحالي)	منذ بداية السنة	سنة واحدة	ثلاث سنوات	خمس سنوات
1 الانحراف المعياري	1.11%	5.00%	16.39%	14.15%	16.80%
2 مؤشر شارب	-4.82	0.36	-0.14	-0.03	0.25
3 حد التبع	0.18%	0.44%	2.19%	4.11%	3.64%
4 بيتا	1.04	0.97	0.96	1.00	0.99
5 ألفا	0.21%	-0.14%	1.24%	6.86%	7.72%
6 مؤشر المعلومات	1.87	-1.21	0.55	1.59	2.10

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

مقارنة الأداء بين الصندوق والمؤشر الاسترشادي



معادلات معايير الأداء والمخاطر:

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

n: عدد فترات الأداء في العينة ؛ r: الأداء لفترة معينة ؛ r_p: متوسط العائد السنوي للصندوق (المؤشر) ؛ f: متوسط العائد السنوي الخالي من المخاطر ؛ σ: الانحراف المعياري السنوي ؛ σ_{excess}: الانحراف المعياري السنوي للعوائد خالية عائد المؤشر ؛ β: معامل بيتا المحصنة بالنسبة للسوق

تفاصيل الاتصال

مكتب الرياض المالية الرئيسي
3128 البوليفارد، العالي، 6671 حي العقيق، الرياض 13519 المملكة العربية السعودية
3128 البوليفارد، العالي، 6671 حي العقيق، الرياض 13519 المملكة العربية السعودية
ask@riyadcapital.com | 920012299 | البريد الإلكتروني: | http://www.riyadcapital.com/ar/

أداء مسؤولية
الأداء المالي ليس مؤشراً على ضمان العوائد المستقبلية. يمكن أن تتغير قيمة الوحدات والحد منها أو تُلغى. قد يُلغى الاستثمارون أجل مما استثمواهم أيضاً، بالإضافة إلى ذلك. الرسوم المتوقعة على الأموال باستثناء صافي العائدات قد يكون لها آثار سلبية إضافية يجب على المستثمرين البقاء على وعيهم الفوري والمالي قبل الدخول في منتج معين. صندوق معين يجب عليهم طلب المشورة من المهنيين في مجال الاستثمار والماليين. يتم توفير التوضيح التفصيلي والمعلومات المتعلقة بالمنتج في النشود والأحكام والقرارية إدارة المحفظة التقديرية المحفظة على الصندوق وإدارة المحفظة التقديرية التي يجب قراءتها وفهمها قبل الدخول فيها.