

هدف الصندوق

هو صندوق عام مفتوح يستثمر في الاسهم السعودية المتوافقة مع الضوابط الشرعية المقررة من اللجنة الشرعية ويهدف إلى تحقيق تنمية رأس المال على المدى الطويل

معلومات الصندوق

تاريخ بدء الصندوق	30 ديسمبر 2009
سعر الوحدة عند الطرح	10.00
حجم الصندوق	30,874,396.33
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 صندوق الرياض للاعمار المتوافق مع الضوابط الشرعية المعد من شركة ايدإل ريتينجز*
عدد مرات التوزيع	--
% رسوم الإدارة الصندوق / الصندوق المستثمر	1.75
مستشار الاستثمار ومدير الصندوق من الباحث	--
عدد أيام التوسيد المرجح	--
نسبة الأرباح المحتالاة	209,516.85 0.648%
نسبة الأرباح	--
معاريف التعامل	3,080.78 0.010%
استثمار مدير الصندوق	--
الأرباح الموزعة	--

معلومات الأسعار كما في نهاية الربع

سعر الوحدة نهاية الربع	24.22
التغير في سعر الوحدة	-1.60%
إجمالي وحجم الصندوق	1,273,169.95
إجمالي صافي الأصول	30,832,204.08
مركز الربحية (P/E)	--

بيانات ملكية استثمارات الصندوق

ملكية تامة	100.00%
حق منفعة	--

العائد التراكمي (%)

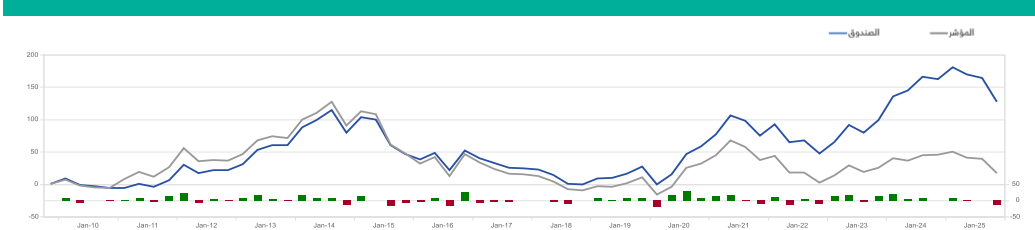
	ثلاثة اشهر نهاية الربع الحالي	منذ بداية السنة	سنة واحدة	ثلاث سنوات	خمس سنوات
أداء الصندوق	-1.59	6.85	-10.02	26.74	17.84
أداء المؤشر	-3.54	3.58	-14.17	-6.53	-27.73
عراق الأداء	1.94	3.27	4.14	33.27	45.57

معايير الأداء والمخاطر

	ثلاثة اشهر نهاية الربع الحالي	منذ بداية السنة	سنة واحدة	ثلاث سنوات	خمس سنوات
1. الانحراف المعياري	2.91%	5.16%	17.42%	18.47%	18.62%
2. مؤشر شارب	-0.87	0.96	-0.81	0.18	-0.02
3. حدأ التبع	0.93%	0.69%	2.51%	4.40%	4.45%
4. بيتا	1.38	1.02	0.97	1.03	0.97
5. ألفا	1.13%	0.52%	4.27%	10.86%	10.07%
6. مؤشر المعلومات	1.81	2.63	1.58	2.34	2.14

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

مقارنة الأداء بين الصندوق والمؤشر الاسترشادي



معادلات معايير الأداء والمخاطر:

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

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

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

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

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

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

ن: عدد فترات الأداء في العينة ؛ r: العائد لفترة معينة ؛ r_p: متوسط العائد السنوي للمحفظة (المؤشر) ؛ f: متوسط 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، 67147 الرياض، المملكة العربية السعودية
3128بوليفارد المالي، 67147 الرياض، المملكة العربية السعودية
ask@riyadcapital.com | 920012299 | البريد الإلكتروني
http://www.riyadcapital.com/ar/

إدارة مسؤولية
أداء السائق في مؤشرات أداء معمار المعايير المستهدفة يمكن أن تظهر قيمة الوحدات والحد منها أو تان. قد يخلق المستثمرون أخطأ مع استثمروا أخطأ بالواقع إلى ذلك. الرسوم المتوقعة على الأصول بإستثمار صريف المعادلات قد يكون لها آثار سلبية (إضافة) إلى المستثمرين الداخلي والخارجي قبل الحدوث في منتج معين /صندوق معين ويجب عليهم طلب المشورة من المهنيين في مجال الاستثمار والمقايير يتم توفير التوضيحات التفصيلية والحدود المتعلقة بالمنتج في النشود والأحكام وإقرارها إدارة المحفظة التقنية المحفظة على الصندوق وإدارة المحفظة التقنية التي يجب قراءتها وفهمها قبل الدخول فيها.