

هدف الصندوق

يهدف الصندوق إلى توزيع الدخل بشكل شهري من خلال الاستثمار في محفظة متنوعة من فئات الأصول المتوافقة مع المعايير الشرعية.

معلومات الصندوق

تاريخ بدء الصندوق	30 ديسمبر 2024
سعر الوحدة عند الطرح	10.0000
حجم الصندوق	255,620,621.23
نوع الصندوق	متعدد الأصول - متوافق مع الشريعة
عملة الصندوق	الريال السعودي
مستوى المخاطر	عالي المخاطر
المؤشر الاسترشادي	ستاندرد آند بوير 40% - سيور 6 أشهر 25% - سيور 3 أشهر 25% - سيور 1 شهر 10%
عدد مرات التوزيع	كل شهر
% رسوم الإدارة (الصندوق) / الصندوق المستثمر	1.00 1.00
مستشار الاستثمار ومدير الصندوق في الباطن	--
عدد أيام التوسيد المرجح	--
نسبة الأرباح المحتالاة الإجمالية	980,482.79
نسبة الأرباح	0.971%
معاريف التعامل	--
استثمار مدير الصندوق	--

معلومات الأسعار كما في نهاية الربع

سعر الوحدة نهاية الربع	9.2296
التغير في سعر الوحدة	-2.25%
إجمالي وحجم الصندوق	27,503,140.78
إجمالي صافي الأصول	253,844,123.52
مركز الربحية (P/E)	--

بيانات ملكية استثمارات الصندوق

ملكية تامة	100.00%
حق منفعة	--

العائد التراكمي (%)

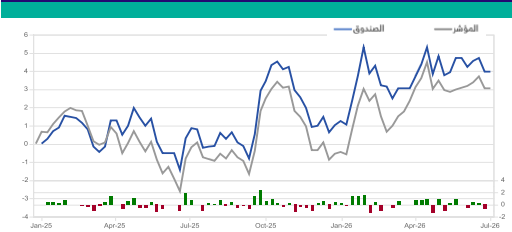
	ثلاثة أشهر (نهاية الربع الحالي)	منذ بداية السنة	سنة واحدة	ثلاث سنوات	خمس سنوات
أداء الصندوق	0.07	3.39	3.71	--	--
أداء المؤشر	-0.34	3.38	3.24	--	--
عراق الأداء	0.41	0.01	0.46	--	--

معايير الأداء والمخاطر

المعيار	ثلاثة أشهر (نهاية الربع الحالي)	منذ بداية السنة	سنة واحدة	ثلاث سنوات	خمس سنوات
1. الانحراف المعياري	0.85%	1.95%	6.75%	--	--
2. مؤشر شارپ	-1.57	0.78	-0.05	--	--
3. حد التبع	0.13%	0.60%	1.66%	--	--
4. بيتا	1.23	0.95	0.92	--	--
5. ألفا	0.17%	0.03%	0.78%	--	--
6. مؤشر المعلومات	2.56	0.01	0.32	--	--

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

مقارنة الأداء بين الصندوق والمؤشر الاسترشادي



معادلات معايير الأداء والمخاطر:

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

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

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

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

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

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

n: عدد فترات العائد في العينة ؛ r: العائد لفترة معينة ؛ r_p: متوسط العائد السنوي للمحفظة (المؤشر) ؛ r_f: متوسط العائد السنوي الخالي من المخاطر ؛ σ: الانحراف المعياري السنوي ؛ σ_{excess}: الانحراف المعياري السنوي للعائد فوق معدل المؤشر ؛ β: معامل بيتا للمحفظة بالنسبة للمؤشر

تفاصيل الاتصال

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