

هدف الصندوق

هو صندوق أسواق نقد عام متوازن يستثمر في أدوات أسواق النقد المتفقة مع الشواهد الشرعية المعفرة من قبل الهيئة الشرعية ويهدف إلى المحافظة على رأس المال المستثمر.

معلومات الصندوق

تاريخ بدء الصندوق	27 أكتوبر 2024
سعر الوحدة عند الطرح	10.0000
حجم الصندوق	5,690,514,840.67
نوع الصندوق	أسواق النقد - متوافق مع الشريعة
عملة الصندوق	الريال السعودي
مستوى المخاطر	منخفض المخاطر
المؤشر الاسترشادي	نسبة الودائع بين البنوك بالريال السعودي لمدة شهر
عدد مرات التوزيع	--
رسوم الإدارة (الصندوق) الصندوق المستثمر فيها	0.5 0.5
مستشار الاستثمار ومدير الصندوق من الجاهز	--
عدد أيام المتوسط المرجح	72
نسبة الأتعاب الإجمالية	8,390,354.14
نسبة الأتعاب	0.146%
نسبة الأتعاب	--
مخاطر الائتمان	--
استثمار مدير الصندوق	462,644,675.75
الأرباح الموزعة	--

معلومات الأسعار كما في نهاية الربع

سعر الوحدة نهاية الربع	10.8830
التغير في سعر الوحدة	1.16%
إجمالي وحجم الصندوق	521,187,087.72
إجمالي صافي الأصول	5,672,055,337.71
مكرر الربحية (P/E)	--

بيانات ملكية استثمارات الصندوق

ملكية تامة	100.00%
حق منفعة	--

العائد التراكمي (%)

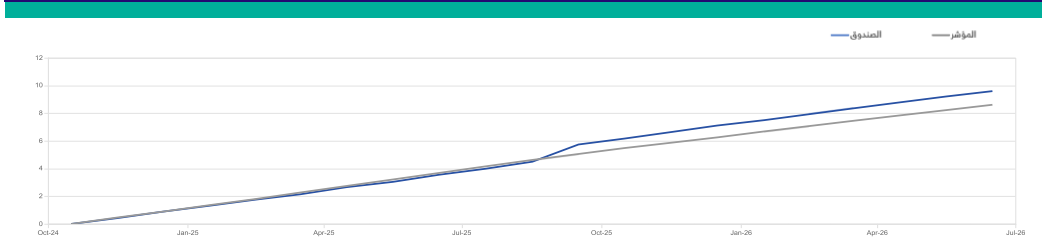
أداء الصندوق	ثلاثة أشهر انهاء الربع الحالي	منذ بداية السنة	سنة واحدة	ثلاث سنوات	خمس سنوات
1.16	2.36	5.88	--	--	--
1.10	2.22	4.77	--	--	--
0.06	0.14	1.10	--	--	--

معايير الأداء والمخاطر

المعيار	ثلاثة أشهر انهاء الربع الحالي	منذ بداية السنة	سنة واحدة	ثلاث سنوات	خمس سنوات
1. الانحراف المعياري	0.01%	0.02%	0.76%	--	--
2. مؤشر شارب	42.52	26.10	2.40	--	--
3. حد التبع	0.00%	0.02%	0.72%	--	--
4. بيتا	4.44	5.34	3.11	--	--
5. ألفا	-1.23%	-1.57%	-8.45%	--	--
6. مؤشر المعلومات	14.00	4.65	1.47	--	--

ملاحظة: تم إيراد بيان المعاملات المستخدمة لحساب معايير الأداء، ومعايير الأداء، وأسفل الرسم البياني.

مقارنة الأداء بين الصندوق والمؤشر الاسترشادي



مقارنة معايير الأداء والمخاطر:

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

n: عدد فترات الأداء في العينة | L: الأداء لفترة معينة | r_p: متوسط العائد السنوي للمحفظة (المؤشر) | f_r: 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
3128 البوليارد المالي | 4671 حي العقيق، الرياض | المملكة العربية السعودية
هاتف: 920012299 | البريد الإلكتروني: ask@riyadcapital.com |
http://www.riyadcapital.com/ar/

إفصاح مسؤولي
أداء السماس ليس مؤشرا وان معاد العوائد المستقبلية. يمكن أن تشهد قيمة الوحدات والحد منها أو تان. قد يلقى المستثمرون أقل مما استثمروا حيث، بالإضافة إلى ذلك، الرسوم المتوقعة على الأصول سيؤثر سلبا على العائدات قد يكون لها آثار سلبية إضافية على المستثمرين الذين في استثمارهم الذي في حد ذاته قد يكون في منتج معين، مخاطر معين يجب عليهم طلب المشورة من المهنيين في مجال الاستثمار والمقارن. يتم توفير التوضيحات التفصيلية والحدود المتعلقة بالمنتج في النشود والأحكام واقتراعية إدارة المحفظة التقنية المحفظة في الصندوق وإدارة المحفظة التقنية التي يجب قراءتها وفهمها قبل الدخول فيها.