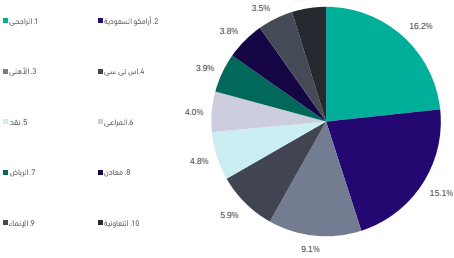


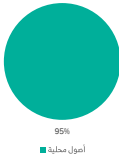
هدف الصندوق

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

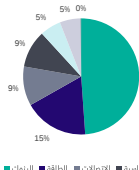
أكثر 10 استثمارات



توزيع الأصول الجغرافي



توزيع الأصول القطاعي



معلومات الصندوق

تاريخ بدء الصندوق	3 ديسمبر 1992
سعر الوحدة عند الطرح	0.65
حجم الصندوق	104,078,254.49
نوع الصندوق	صندوق استثماري عام مفتوح يستثمر في الأسهم السعودية.
عملة الصندوق	الريال السعودي
مستوى المخاطر	عالي المخاطر
المؤشر الاسترشادي	مؤشر السوق الرئيسية قاسي
عدد مرات التوزيع	--
% رسوم الإدارة (الصندوق) (الصندوق المستثمر)	1.50
مستشار الاستثمار ومدير الصندوق من الجانب	--
عدد أيام المتوسط المرجح	--
نسبة الأرباح الإجمالية	563,291.31
نسبة الأرباح	--
معاريف التعامل	10,693.35
استثمار مدير الصندوق	--
الأرباح الموزعة	--

معلومات الأسعار كما في نهاية الربع

سعر الوحدة نهاية الربع	37.56
التغير في سعر الوحدة	-4.36%
إجمالي وحجم الصندوق	2,768,073.73
إجمالي صافي الأصول	103,963,890.83
مكرر الربحية (P/E)	--

بيانات ملكية استثمارات الصندوق

ملكية تامة	100.00%
حق منفعة	--

العائد التراكمي (%)

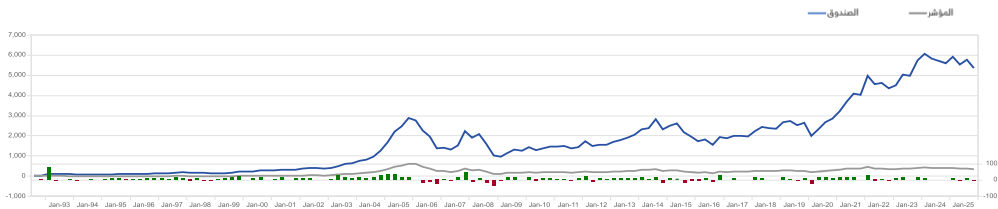
أداء الصندوق	لفترة ٣ أشهر (نهاية الربع الحالي)	منذ بداية السنة	سنة واحدة	ثلاث سنوات	خمس سنوات
-4.36	3.34	-0.03	9.62	49.99	
-4.00	2.95	-3.26	-5.75	-1.43	
-0.36	0.39	3.23	15.37	51.43	

معايير الأداء والمخاطر

المعيار	ثلاثة أشهر انهاء الربع الحالي	منذ بداية السنة	سنة واحدة	ثلاث سنوات	خمس سنوات
1. الانحراف المعياري	0.96%	5.03%	17.24%	15.86%	17.32%
2. مؤشر شارب	-5.53	0.29	-0.24	-0.11	0.27
3. خطأ التبع	0.49%	0.49%	1.95%	6.34%	5.62%
4. بيتا	0.98	1.04	1.00	1.02	1.01
5. ألفا	-0.15%	0.05%	3.35%	5.43%	8.93%
6. مؤشر المعلومات	-0.62	0.43	1.58	0.79	1.54

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

مقارنة الأداء بين الصندوق والمؤشر الاسترشادي



معادلات معايير الأداء والمخاطر:

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

n: عدد فترات العائد 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 للعائد فوق عائد المؤشر | β: معامل بيتا للمحفظة بالنسبة للمؤشر

تفاصيل الاتصال

مكتب الرياض المالية الرئيسي
3128بوليفارد المالي | 671471 الرياض | المملكة العربية السعودية
هاتف: 920012299 | البريد الإلكتروني: ask@riyadcapital.com
http://www.riyadcapital.com/ar/

أداء الاستثمارية
أداء الاستثمارية يس مؤشرا وان معاد المعايير الاستثمارية
على الاستثمارية يس مؤشرا وان معاد المعايير الاستثمارية
من المعايير في مجال الاستثمار والمؤشر
التقرير التي يجب قراءتها وفهمها قبل الدخول فيها.