

هدف الصندوق

هو صندوق عام مفتوح يستثمر أمواله بشكل رئيسي في أسهم الشركات المتوسطة والصغيرة والمتناهية الصغر المدرجة في سوق الأسهم السعودية المتوافقة مع التوجيهات الشرعية الصادرة من اللجنة الشرعية التي يحددها مؤشر الصندوق

معلومات الصندوق

تاريخ بدء الصندوق	30 ديسمبر 2009
سعر الوحدة عند الطرح	10.00
حجم الصندوق	52,180,706.20
نوع الصندوق	صندوق استثماري عام مفتوح يستثمر في أسهم الشركات السعودية المتوسطة والصغيرة المتوافقة مع التوجيهات الشرعية
عملة الصندوق	الريال السعودي
مستوى المخاطر	عالي المخاطر
المؤشر الاسترشادي	(إدراج ريندز) اسلامی الإسهام الصغيرة والمتوسطة والواحدة للسوق السعودي
عدد مرات التوزيع	--
% رسوم الإدارة (الصندوق) / الصندوق (المستثمر)	1.75
مستشار الاستثمار ومدير الصندوق من الجانب	--
عدد أيام المتوسط المرجح	--
نسبة الأرباح الإجمالية	336,409.07 0.625%
نسبة الأرباح	--
معاريف التعامل	15,528.85 0.030%
استثمار مدير الصندوق	--
الأرباح الموزعة	--

معلومات الأسعار كما في نهاية الربع

سعر الوحدة نهاية الربع	51.03
التغير في سعر الوحدة	-1.64%
إجمالي وحجم الصندوق	1,021,398.75
إجمالي صافي الأصول	52,117,580.45
مركز الربحية (P/E)	--

بيانات ملكية استثمارات الصندوق

ملكية تامة	100.00%
حق منفعة	--

العائد التراكمي (%)

	ثلاثة اشهر ايام الالز ربع الحالي	منذ بداية السنة	سنة واحدة	ثلاث سنوات	خمس سنوات
أداء الصندوق	-1.64	4.91	-5.48	6.46	69.20
أداء المؤشر	-1.86	3.27	-8.43	-15.13	-3.27
عراق الأداء	0.22	1.64	2.95	21.58	72.47

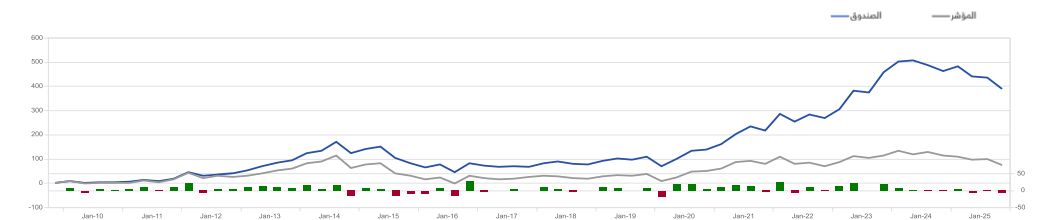
معايير الأداء والمخاطر

	ثلاثة اشهر ايام الالز ربع الحالي	منذ بداية السنة	سنة واحدة	ثلاث سنوات	خمس سنوات
1 الانحراف المعياري	0.78%	4.25%	15.53%	18.28%	18.63%
2 مؤشر شارب	-3.31	0.71	-0.61	-0.15	0.40
3 حد التبع	0.82%	0.67%	3.74%	7.97%	7.48%
4 بيتا	0.49	0.92	0.89	1.06	0.99
5 ألفا	-0.25%	0.30%	2.07%	8.55%	12.07%
6 مؤشر المعلومات	0.25	1.33	0.76	0.92	1.56

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

مقارنة الأداء بين الصندوق والمؤشر الاسترشادي

--



معادلات معايير الأداء والمؤشر:

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

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

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

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

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

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

n: عدد فترات الأداء في العينة ؛ r: الأداء لفترة معينة ؛ r_p: متوسط العائد السنوي للصندوق (المؤشر) ؛ r_f: متوسط العائد السنوي الخالي من المخاطر ؛ σ: الانحراف المعياري السنوي ؛ α: العائد المتبقي السنوي الخالي من المخاطر ؛ β: معامل بيتا للمحفظة بالنسبة للمؤشر

تفاصيل الاتصال

مكتب الرياض المالية الرئيسي
3128بوليفارد المالي | 671مبنى الخليج، الرياض 13519 المملكة العربية السعودية
هاتف: 920012299 | البريد الإلكتروني: ask@riyadcapital.com
http://www.riyadcapital.com/ar/

أداء مسؤولية
أداء السلف ليس مؤشرا وان معاد المعادلات الاستثمارية يمكن ان تظهر قيمة الوحدات والحد منها أو تظل. قد يخلق المستثمرون أرباح مع استثمارهم حيث، بالإضافة إلى ذلك، الرسوم المتوقعة على الأموال باستثناء صافي المبيعات قد يكون لها آثار سلبية إضافية يجب على المستثمرين النظر في وضعهم المالي واليالي قبل الدخول في منتج معين. صندوق معين يقدم أغلبيه طلب المشورة من المهنيين في مجال الاستثمار والماليين. يتم توفير التوضيحات التفصيلية والحدود المتعلقة بالمنتج في النسخة والأحكام والتفاهة لإدارة المحفظة التقديرية المحفظة على الصندوق وإدارة المحفظة التقديرية التي يجب قراءتها وفهمها قبل الدخول فيها.