

هدف الصندوق

هو صندوق قابض عام مفتوح يستثمر في مجموعة من الصناديق بهدف إلى تحقيق التوازن بين نمو وحماية رأس المال على المدى المتوسط والطويل في ظل مخاطر متوسطة.

معلومات الصندوق

تاريخ بدء الصندوق	10 يونيو 2001
سعر الوحدة عند الطرح	10.00
حجم الصندوق	29,715,803.48
نوع الصندوق	هو صندوق قابض عام مفتوح يستثمر في مجموعة من الصناديق
عملة الصندوق	الريال السعودي
مستوى المخاطر	متوسط المخاطر
المؤشر الاسترشادي	MSCI World Index *TASI *Barrclays Bond Index سعر تكلفة التمويل بين البنوك بالريال السعودي لمدة شهر
عدد مرات التوزيع	--
% رسوم الإدارة (الصندوق) / % رسوم الإدارة (المستثمر)	0.4 1.85 - 0.50
مستشار الاستثمار ومدير الصندوق من الجانب	--
عدد أيام المتوسط المرجح	--
نسبة الأرباح الإجمالية	74,140.54
نسبة الأرباح	0.251%
معاريف التكاليف	103.73
استثمار مدير الصندوق	--
الأرباح الموزعة	--

معلومات الأسعار كما في نهاية الربع

سعر الوحدة نهاية الربع	30.67
التغير في سعر الوحدة	-0.15%
إجمالي وحجم الصندوق	963,937.89
إجمالي حافلي الأصول	29,561,386.16
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	-0.15	3.81	5.25	28.21	24.75
أداء المؤشر	-0.17	4.80	5.81	32.04	28.24
عراق الأداء	0.02	-1.00	-0.56	-3.84	-3.48

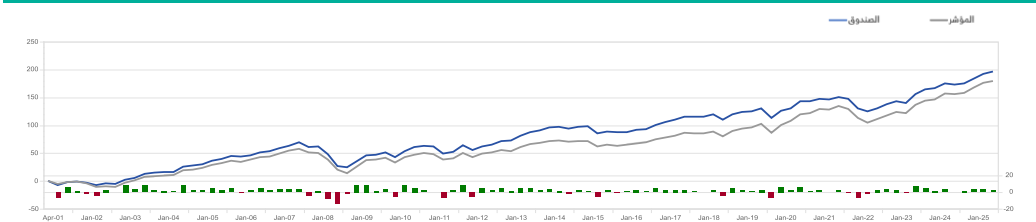
معايير الأداء والمخاطر

	ثلاثة اشهر نهاية الربع الحالي	منذ بداية السنة	سنة واحدة	ثلاث سنوات	خمس سنوات
1. الانحراف المعياري	1.42%	1.76%	5.42%	5.05%	6.09%
2. مؤشر شارب	-0.79	0.54	0.25	0.78	0.11
3. حد التبع	0.26%	0.52%	1.61%	1.15%	1.40%
4. بيتا	1.08	0.97	0.97	0.99	0.94
5. ألفا	0.01%	-0.09%	-0.36%	-0.91%	-0.25%
6. مؤشر المعلومات	0.06	-0.70	-0.33	-0.92	-0.41

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

مقارنة الأداء بين الصندوق والمؤشر الاسترشادي

--



معادلات معايير الأداء والمخاطر:

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

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

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

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

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

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

n: عدد فترات الأداء في العينة ؛ r: العائد 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 التمثيل

أغلب مسؤولية

أداء الاستثمار
أداء الاستثمار ليس مؤشرا وان أداء عملاء المحافظ الاستثمارية يمكن أن تظهر قيمة إيجابية أو سلبية أو حتى قد يفلت المستثمرون أقل مما استثمروا حيث أن طبيعة تلك الأصول المتغيرة على المدى الطويل صفة العملات قد يكون لها آثار سلبية إضافية يجب على المستثمرين البقاء في وعيهم الذي وبالحالي قبل اتخاذ أي منتج معين /صندوق معين عليهم طلب المشورة من المهنيين في مجال الاستثمار والمقايير يتم توفير التوضيح التفصيلي والمعتقد المتعلق بالمنتج في الشبكات والأحكام وإقرارية إدارة المحفظة التقنية المحفظة على الصندوق وإدارة المحفظة التقنية التي يجب مراعاتها وفهمها قبل الدخول فيها.

مكتب الرياض المالية الرئيسي
3128بوليفارد العالمي 4671حي العقيق، الرياض 13519 المملكة العربية السعودية
إتصال: 920012299 | البريد الإلكتروني: ask@riyadcapital.com | http://www.riyadcapital.com/ar/