

هدف الصندوق

هو صندوق قابض عام مفتوح يستثمر في مجموعة من الصناديق المتوافقة مع الصناديق الشرعية المقررة من اللجنة الشرعية ويهدف الى تحقيق التوازن بين نمو وحماية رأس المال على المدى المتوسط والطويل في ظل مخاطر متوسطة.

معلومات الصندوق

تاريخ بدء الصندوق	31 ديسمبر 2002
سعر الوحدة عند الطرح	10.00
حجم الصندوق	29,211,700.24
نوع الصندوق	هو صندوق قابض عام مفتوح يستثمر في مجموعة من الصناديق المتوافقة مع الصناديق الشرعية
عملة الصندوق	الريال السعودي
مستوى المخاطر	متوسطة المخاطر
المؤشر الاسترشادي	DJ Islamic Markets <S&P Saudi Shariah> Dow Jones Sukuk Total Return (ex-Reinvestment) بإدارة الرياض السعودية لمدة شهر
عدد مرات التوزيع	--
نسوم الإرداة (الصندوق / الصندوق المستثمر) 0.4 0.50 - 1.85	
مستشار الاستثمار ومدير الصندوق من الجانب	--
عدد أيام المتوسط المرجح	--
نسبة الأرباح الإجمالية	71,340.98 0.253%
نسبة الاقتراض	--
معاريف التعامل	164.42 0.001%
استثمار مدير الصندوق	--
الأرباح الموزعة	--

معلومات الأسعار كما في نهاية الربع

سعر الوحدة نهاية الربع	35.04
التغير في سعر الوحدة	0.02%
إجمالي وحجم الصندوق	824,945.79
إجمالي صافي الأصول	28,904,270.96
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	0.02	5.12	6.43	31.66	30.70
أداء المؤشر	-0.09	5.86	6.97	34.17	36.71
عراق الأداء	0.11	-0.74	-0.54	-2.51	-6.01

معايير الأداء والمخاطر

المعيار	ثلاثة اشهر نهاية الربع الحالي	منذ بداية السنة	سنة واحدة	ثلاث سنوات	خمس سنوات
1 الانحراف المعياري	1.84%	2.17%	6.72%	5.70%	6.24%
2 مؤشر شارب	-0.52	1.04	0.38	0.86	0.26
3 حد التبع	0.05%	0.59%	1.79%	1.47%	1.51%
4 بيتا	1.01	0.95	0.95	0.96	0.95
5 ألفا	0.04%	-0.04%	-0.14%	-0.27%	-0.60%
6 مؤشر المعلومات	1.94	-0.46	-0.29	-0.46	-0.62

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

مقارنة الأداء بين الصندوق والمؤشر الاسترشادي

--



معادلات معايير الأداء والمخاطر:

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

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

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

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

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

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

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 الاتصال

مكتب الرياض المالية الرئيسي
3128 البوlevard المالي - 6671 حي العقيق، الرياض 13519 المملكة العربية السعودية
هاتف: 920012299 | البريد الإلكتروني: ask@riyadcapital.com | http://www.riyadcapital.com/ar/

أداء مسؤولية
أداء الاستثمار ليس مؤشرا وان معاد المعادلات المستخدمة يمكن ان تظهر قيمة الوحدان والحد منها أو تان. حد يخلق المستثمرين الحق مع الاستثمار، حيث بالامانة الى ذلك. الرسوم المطلوبة على الأموال باستثناء صافي العائدات قد يكون لها آثار سلبية (إيجابية) على المستثمرين. انظر في جميع النماذج والبيانات قبل اتخاذ أي منتج معين. صندوق معين يجب عليه طلب المشورة من المهنيين في مجال الاستثمار والمقايير يتم توفير التوضيحات والتعليقات والحدود المتعلقة بالمنتج في النشود والأحكام وإقراره إدارة المحفظة التقنية المحفظة على الصندوق وإدارة المحفظة التقنية التي يجب قراءتها وفهمها قبل الدخول فيها.