

هدف الصندوق

هو صندوق قابض عام مفتوح يستثمر في مجموعة من الصناديق المتوافقة مع الضوابط الشرعية المقررة من اللجنة الشرعية بهدف إلى نمو رأسي المال على المدى الطويل في ظل مخاطر عالية.

معلومات الصندوق

تاريخ بدء الصندوق	31 ديسمبر 2002
سعر الوحدة عند الطرح	10.00
حجم الصندوق	17,397,040.04
نوع الصندوق	هو صندوق قابض عام مفتوح يستثمر في مجموعة من الصناديق المتوافقة مع الضوابط الشرعية
عملة الصندوق	الريال السعودي
مستوى المخاطر	عالي المخاطر
المؤشر الاسترشادي	DJ Islamic Markets <S&P Saudi Shariah> Dow Jones Sukuk Total Return (ex-Reinvestment) بإدارة الرياض السعودي لمدة شهر
عدد مرات التوزيع	--
% رسوم الإدارة (الصندوق) / الصندوق (المستثمر)	0.65 1.85 - 0.50
مستشار الاستثمار ومدير الصندوق من الجانب	--
عدد أيام المتوسط المرجح	--
نسبة الأتعاب الجمالية	60,274.37 0.356%
نسبة الاقتراض	--
معاريف التعامل	80.45 0.000%
استثمار مدير الصندوق	--
الأرباح الموزعة	--

معلومات الأسعار كما في نهاية الربع

سعر الوحدة نهاية الربع	43.62
التغير في سعر الوحدة	-0.08%
إجمالي وحجم الصندوق	394,031.44
إجمالي صافي الأصول	17,189,511.09
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	-0.08	6.29	7.43	39.05	34.16
أداء المؤشر	-0.22	7.74	8.77	43.39	42.70
عراق الأداء	0.14	-1.45	-1.34	-4.35	-8.54

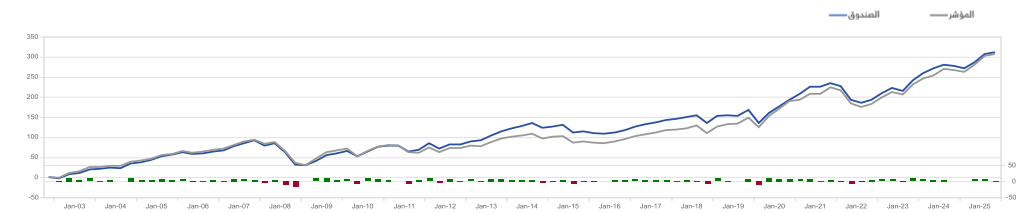
معايير الأداء والمخاطر

	ثلاثة اشهر نهاية الربع الحالي	منذ بداية السنة	سنة واحدة	ثلاث سنوات	خمس سنوات
1. الانحراف المعياري	2.58%	3.10%	9.63%	8.15%	9.08%
2. مؤشر شارب	-0.41	1.11	0.37	0.85	0.24
3. حد التبع	0.03%	0.78%	2.38%	2.00%	2.05%
4. بيتا	0.99	0.94	0.94	0.96	0.95
5. ألفا	0.05%	-0.10%	-0.75%	-0.57%	-0.91%
6. مؤشر المعلومات	3.81	-0.68	-0.54	-0.57	-0.64

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

مقارنة الأداء بين الصندوق والمؤشر الاسترشادي

--	--



معادلات معايير الأداء والمخاطر:

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

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

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

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

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

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

n: عدد فترات الأداء في العينة | r_t: 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 للعوائد فوق عائد المؤشر | β: معامل بيتا للمحفظة بالنسبة للمؤشر

تفاصيل الاستثمار

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

الأداء السابق ليس مؤشراً على أداء صناديق الاستثمار المستقبلية. يمكن أن تتغير قيمة الوحدات والحدود منها أو تُلغى. قد يُلغى الاستثمارون أطق معاً استثمارهم أطقاً، بالإضافة إلى ذلك. الرسوم المتوقعة على الاستثمارات سابقة صرف. المعلومات قد يكون لها آثار سلبية (إيجابية) على المستثمرين الباد في استثمارهم البادوي والتي يمكن أن تكون ضارة/مفيدة. حقوق حقوق غايه طلب المشورة من المهنيين في مجال الاستثمار والمقايير. يتم توفير التوضيح التفصيلي والتمثيل المتعلق بالمنتج في كشور والأحكام والظروف لإدارة المحفظة التقديرية المحفظة على الصندوق وإدارة المحفظة التقديرية التي يجب مراقبتها وفهمها قبل الدخول فيها.