

هدف الصندوق

هو صندوق عام مفتوح يستثمر في الأسهم العالمية المتوافقة مع الشواهد الشرعية المقررة من اللجنة الشرعية بدار من الجاهل ويهدف إلى تحقيق تنمية رأس المال على المدى الطويل.

معلومات الصندوق

تاريخ بدء الصندوق	17 مايو 1999
سعر الوحدة عند الطرح	10.00
حجم الصندوق	28,038,752.97
نوع الصندوق	صندوق استثماري عام مفتوح يستثمر في الأسهم العالمية المتوافقة مع الشواهد الشرعية.
عملة الصندوق	الدولار الأمريكي
مستوى المخاطر	عالي المخاطر
المؤشر الاسترشادي	دو جونز الإسلامي
عدد مرات التوزيع	--
% رسوم الإدارة (الصندوق) / الصندوق (المستثمر)	1.75
مستشار الاستثمار ومدير الصندوق في الجاهل	جي بي مورجان
عدد أيام المتوسط المرجح	--
نسبة الأتاعل الجمالية	163,680.92
نسبة الاقتراض	0.598%
معاريف الجاهل	--
استثمار مدير الصندوق	--
الأرباح الموزعة	--

معلومات الأسعار كما في نهاية الربع

سعر الوحدة نهاية الربع	47.40
التغير في سعر الوحدة	1.99%
اجمالي وحجم الصندوق	586,643.71
اجمالي حافلي الأموال	27,804,430.16
مركز الربحية (P/E)	--

بيانات ملكية استثمارات الصندوق

ملكية تامة	100.00%
حق منفعة	--

العائد التراكمي (%)

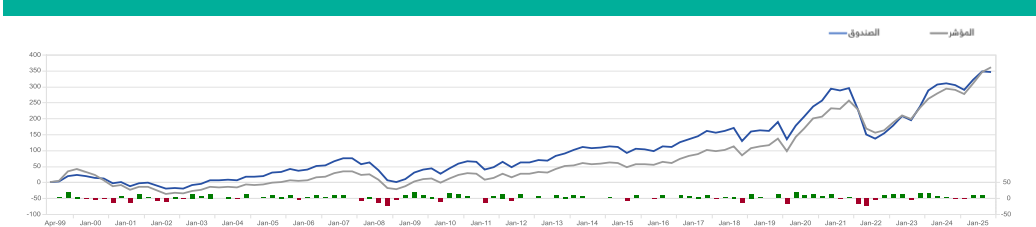
أداء الصندوق	ثلاثة اشهر نهاية الربع الحالي	منذ بداية السنة	سنة واحدة	ثلاث سنوات	خمس سنوات
أداء المؤشر	1.99	6.21	5.65	61.07	22.15
عراق الأداء	1.41	15.46	19.53	78.43	61.85
	0.58	-9.26	-13.88	-17.37	-39.70

معايير الأداء والمخاطر

المقاييس	ثلاثة اشهر نهاية الربع الحالي	منذ بداية السنة	سنة واحدة	ثلاث سنوات	خمس سنوات
1. الانحراف المعياري	3.63%	5.19%	16.66%	15.00%	18.59%
2. مؤشر شابري	0.28	0.65	0.10	0.83	0.01
3. حد التبع	1.86%	1.61%	5.17%	6.14%	7.74%
4. بيتا	0.67	0.85	0.87	0.97	1.05
5. ألفا	0.32%	-0.71%	-9.79%	-2.67%	-5.55%
6. مؤشر المعلومات	0.31	-2.16	-2.57	-0.65	-0.77

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

مقارنة الأداء بين الصندوق والمؤشر الاسترشادي



معادلات معايير الأداء والمخاطر:

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

$$\alpha_i = r_i - [r_f + \beta_i (r_m - r_f)] \quad (5)$$

$$\beta_i = \frac{Cov(r_{pi}, r_m)}{Var(r_m)} \quad (4)$$

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

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

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

n: عدد فترات الأداء في العينة | r_f: العائد الفراهز 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 للعائد فوق عائد المؤشر | β: معامل بيتا للمحفظة بالنسبة للمؤشر

تفاصيل الاتصال

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

أداء مسؤولية
الأداء السابق ليس مؤشرا وان معاد الجاهل المستشرية. يمكن أن تظهر قيمة الوحدات والحد منها أو تان. قد يخلق المستثمرون أخل مما استثمروا حيث، بالإضافة إلى ذلك، الرسوم المتطوعة على الأموال باستاء صراف العملات قد يكون لها آثار سلبية إضافية يجب على المستثمرين النظر في وضعهم المالي واليالي قبل الدخول في منتج معين. صندوق معين يجب عليه طلب المشورة من المهنيين في مجال الاستثمار والفاور. يتم توفير التصنيف التقييمي والحدود المتعلقة بالمنتج في الشواهد والأحكام واقتضائية إدارة المحفظة التقديرية المحفظة على الصندوق وإدارة المحفظة التقديرية التي يجب فارتها وقمتها قبل الدخول فيها.