

هدف الصندوق

هو صندوق أدوات دين عام مفتوح يستثمر في أدوات الدين المتوافقة مع الضوابط الشرعية المقررة من قبل الهيئة الشرعية. ويهدف إلى تحقيق التوازن بين المحافظة على رأس المال وتحقيق عائد مناسب عليه.

معلومات الصندوق

تاريخ بدء الصندوق	24 مايو 1999
سعر الوحدة عند الطرح	1,000.0000
حجم الصندوق	3,438,872,582.57
نوع الصندوق	صندوق ائتمان للمساعدة المتعددة بالريال مع صندوق أدوات دين عام مفتوح يستثمر في أدوات الدين المتوافقة مع الضوابط الشرعية
علامة الصندوق	الريال السعودي
مستوى المخاطر	منخفض إلى متوسط المخاطر
المؤشر الاسترشادي	سعر تكلفة التمويل بين البنوك بالريال السعودي لمدة 3 شهور
عدد مرات التوزيع	--
نسوم الإذرة الصندوق الصناديق المستثمر فيها	0.5 0.5
مستثمر الاستثمار ومدير الصندوق من الجانب	--
عدد أيام المتوسط المرجح	1.165
نسبة الأتباع للأرجمانية	3,848,950.67
نسبة الأ فتراس	0.112%
مخاطر التعامل	--
استثمار مدير الصندوق	--
الأرباح الموزعة	535,340,714.58
	--

معلومات الأسعار كما في نهاية الربع

سعر الوحدة نهاية الربع	1,906.0906
التغير في سعر الوحدة	0.68%
إجمالي وحدات الصندوق	1,803,948.27
إجمالي صافي الأصول	3,438,488,917.70
مكرر الربحية (P/E)	--

بيانات ملكية استثمارات الصندوق

100.00%	100%
--	0%

العائد التراكمي (%)

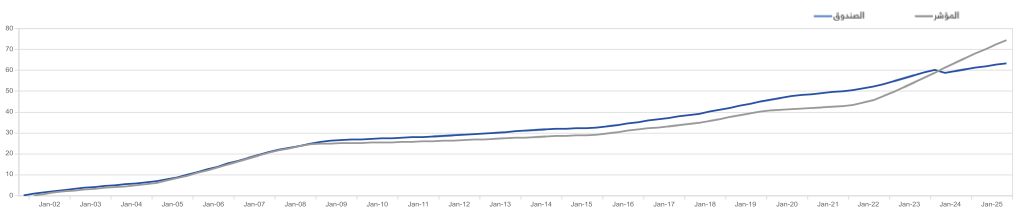
أداء الصندوق	فترة شهر (نهاية البرر الحالي)	مدة بداية السنة	سنة واحدة	ثلاث سنوات	خمس سنوات
أداء الصندوق	0.68	2.00	2.44	5.72	11.46
أداء المؤشر	1.25	3.65	4.90	17.43	26.89
فائدة الأداء	-0.57	-1.65	-2.47	-11.71	-15.43

معايير الأداء والمخاطر

المقاييس	ثلاثة أشهر (القيمة الربو الحالي)	منذ بداية السنة	سنة واحدة	لثلاث سنوات	خمس سنوات
1. التوظيف المعنوي	0.01%	0.03%	0.16%	0.91%	0.74%
2. مؤشر شاب	-56.91	-27.41	-9.46	-3.12	-2.29
3. كحدأ التاجر	0.03%	0.04%	0.17%	0.94%	0.82%
4. بيتا	0.01	0.14	-0.17	-0.85	0.13
5. الفا	0.22%	0.16%	3.28%	6.62%	1.55%
6. مؤشر المعلومات	-21.17	-17.14	-13.92	-3.79	-3.25

ملاحظة: تم إيراد بيان المعادلات المستخدمة لاختساب معاني الأجل والمخاطر أسفله، الرسم البياني.

مقارنة الأداء بين الصندوق والمؤشر الاسترشادي



معادلات معايير الأداء والمخاطر:

$$IR = \frac{E(r_p - r_b)}{\sigma_{\text{excess}}} \quad (6) \quad \alpha_j = r_i - r_f + \beta * (r_b - r_f) \quad (5) \quad \beta = \frac{\text{Cov}(r_p, r_b)}{\text{Var}(r_b)} \quad (4) \quad \sigma = \sqrt{\frac{n \sum_{i=1}^n r_i^2 - (\sum_{i=1}^n r_i)^2}{n^2}} \quad (3) \quad SR = \frac{r_p - r_f}{\sigma_p} \quad (2) \quad s = \sqrt{\frac{n \sum_{i=1}^n r_i^2 - (\sum_{i=1}^n r_i)^2}{n^2 - n}} \quad (1)$$

n : عدد فترات العائد في العينة | i_r : العائد لفترة معينة | p_r : متوسط العائد السنوي للمحفظة (المؤشر) | f_r : متوسط العائد السنوي الخالي من المخاطر | σ : الانحراف المعياري السنوي | σ_{sse} : الانحراف المعياري السنوي للعوائد فوق عائد المؤشر | β : معامل يربط المحفظة بالنسبة للسوق

تفاصيل الاتصال

مكتب الرياض المالية الرئيسي
31282 البوليفارد العالي 6671 حى العقيق الرياض 13519 المملكة العربية السعودية.
هاتف 920012299 البريد الإلكتروني ask@riyadcapital.com
<http://www.riyadcapital.com/ar>

التفكيرية التي يجب

يمكن أن ترفع قيمة الوحدات والدخل منها أو تقل، أو يتلقى المستثمرين أقل مما استثمروه أصلًا، بالإضافة إلى ذلك، الرسوم المفروضة عليه إزاء ما يجب على المستثمرين النظر في وضعهم الفردي والمالي قبل الدخول في منتج معين / صندوق معين ويجب عليهم طلب المشورة ومير التوصيف التفصيلي والمحدد والمتعلق بالمنتج في الشروط والأحكام واتفاقية إدارة المحفظة التقديرية المطبقة على الصندوق وإدارة المحفظة