

هدف الصندوق

هو صندوق أسواق نقد عام مقنن يستثمر في أدوات أسواق النقد المتوافقة مع الضوابط الشرعية المقررة من اللجنة الشرعية ويهدف إلى المحافظة على رأس المال المستثمر مع تحقيق معدل عائد مناسب.

معلومات الصندوق

تاريخ بدء الصندوق	1 يوليو 1993
سعر الوحدة عند الطرح	1,000,000
حجم الصندوق	665,400,540.87
نوع الصندوق	هو صندوق أسواق نقد عام مقنن يستثمر في أدوات أسواق النقد المتوافقة مع الضوابط الشرعية
عملة الصندوق	الريال السعودي
مستوى المخاطر	منخفض المخاطر
المؤشر الاسترشادي	سعر تكلفة التمويل بين البنوك بالريال السعودية لمدة شهر
عدد مرات التوزيع	--
%رسوم الإدارة (الصندوق) الصندوق المستثمر فيها	0.5 0.5
مستشار الاستثمار ومدير الصندوق من الجانب	--
عدد أيام التوسيد المردج	3,382
نسبة الأتعاب الإجمالية	1,230,727.59
نسبة اقتراض	0.151%
مخاطر التعامل	--
استثمار مدير الصندوق	198,929,820.31
الأرباح الموزعة	--

معلومات الأسعار كما في نهاية الربع

سعر الوحدة نهاية الربع	2,586.3255
التغير في سعر الوحدة	0.89%
إجمالي وحداث الصندوق	257,197.76
إجمالي صافي الأصول	665,197,119.35
مكرر الربحية (P/E)	--

بيانات ملكية استثمارات الصندوق

ملكية تامة	100.00%
حق منفعة	--

العائد التراكمي (%)

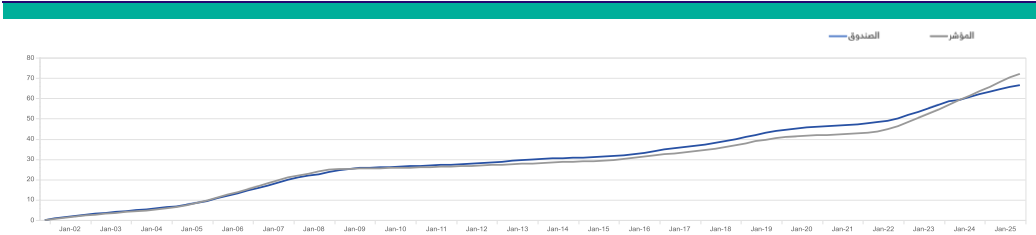
أداء الصندوق	ثلاثة أشهر (نهاية الربع الحالي)	منذ بداية السنة	سنة واحدة	ثلاث سنوات	خمس سنوات
أداء المؤشر	0.89	2.33	2.95	9.88	16.00
عراق الأداء	-0.24	-1.04	-1.62	-6.88	-8.95

معايير الأداء والمخاطر

المقاييس	ثلاثة أشهر (نهاية الربع الحالي)	منذ بداية السنة	سنة واحدة	ثلاث سنوات	خمس سنوات
1. الانحراف المعياري	0.01%	0.04%	0.14%	0.37%	0.39%
2. مؤشر شارب	-10.01	-14.36	-6.86	-4.07	-2.21
3. حدأ التبع	0.02%	0.04%	0.15%	0.38%	0.38%
4. بيتا	-0.50	0.84	-0.83	0.37	0.53
5. ألفا	0.48%	-0.05%	6.81%	1.25%	0.60%
6. مؤشر المعلومات	-10.28	-10.71	-10.08	-5.45	-4.06

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

مقارنة الأداء بين الصندوق والمؤشر الاسترشادي



معادلات معايير الأداء والمخاطر:

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

$$\alpha_i = r_i - [r_f + \beta * (r_s - r_f)] \quad (5)$$

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

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

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

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

n: عدد فترات الأداء في العينة | r_i: 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 الجوليفارد المالي | 671 حي الفيلق، الرياض | المملكة العربية السعودية
هاتف: 92001 12299 | البريد الإلكتروني: ask@riyadcapital.com | http://www.riyadcapital.com/ar/

أفكار مسؤوليّة
أداء المساهمين يس مؤشرا وان ممتاز للعوائد المستقبلية. يمكن ان تظهر قيمة الوحدات وحدها أو على نطاق المستثمرين أقل مما استثمروا حيث، بالإضافة إلى ذلك، الرسوم المتوقعة على الأصول سيؤدي إلى انخفاض حاد في العوائد. الاستثمار في الأصول المالية والائدي والائدي غير الخاضع في منتج معين، مخاطر معين يجب عليهم طلب المشورة من المهنيين في مجال الاستثمار والمقايير. يتم توفير التصنيف التقني والحدود المتعلقة بالمنتج في الشرواح والأحكام واقتراعية إدارة المحفظة لتقديرة الخطية على الصندوق وإدارة المحفظة لتقديرة التي يجب مراعاتها وفهمها قبل الدخول فيها.