

هدف الصندوق

هو صندوق عام مفتوح يستثمر في الأسهم السعودية المتوافقة مع الضوابط الشرعية المقررة من اللجنة الشرعية ويهدف إلى تحقيق تنمية رأسي المال على المدى الطويل

معلومات الصندوق

تاريخ بدء الصندوق	21 نوفمبر 1996
سعر الوحدة عند الطرح	1.00
حجم الصندوق	682,957,214.42
نوع الصندوق	صندوق استثماري عام مفتوح يستثمر في الأسهم السعودية المتوافقة مع الضوابط الشرعية
عملة الصندوق	الريال السعودي
مستوى المخاطر	عالي المخاطر
المؤشر الاسترشادي	مؤشر ستاندرد آند بورز لشركات المتوافقة مع الضوابط الشرعية
عدد مرات التوزيع	--
رسوم الإدارة (الصندوق) / الصندوق (المستثمر)	1.50
مستشار الاستثمار ومدير الصندوق من الجانب	--
عدد أيام المتوسط المرجح	--
نسبة الأرباح الإجمالية	3,517,805.73 0.514%
نسبة الأرباح	--
معاريف التعامل	38,395.00 0.006%
استثمار مدير الصندوق	--
الأرباح الموزعة	--

معلومات الأسعار كما في نهاية الربع

سعر الوحدة نهاية الربع	16.78
التغير في سعر الوحدة	-2.58%
إجمالي وحجم الصندوق	40,667,747.17
إجمالي صافي الأصول	682,367,557.07
مؤشر 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	-2.58	-0.64	-9.04	7.18	30.22
عائد الأداء	-4.69	-3.01	-13.04	-6.99	-11.93
	2.11	2.37	4.00	14.17	42.15

معايير الأداء والمخاطر

المقاييس	ثلاثة أشهر (نهاية الربع الحالي)	منذ بداية السنة	سنة واحدة	ثلاث سنوات	خمس سنوات
1. الانحراف المعياري	4.83%	4.91%	17.15%	16.95%	18.36%
2. مؤشر شارب	-0.73	-0.71	-0.76	-0.14	0.08
3. حدًا التبع	0.36%	0.43%	1.51%	6.02%	5.43%
4. بيتا	0.95	0.97	0.97	1.01	1.01
5. ألفا	0.63%	0.25%	4.03%	5.06%	8.28%
6. مؤشر المعلومات	4.92	1.99	2.54	0.77	1.45

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

مقارنة الأداء بين الصندوق والمؤشر الاسترشادي

--	--



معادلات معايير الأداء والمخاطر:

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

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

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

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

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

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

ن: عدد فترات الأداء في العينة ؛ r: العائد لفترة معينة ؛ r_p: متوسط العائد السنوي للصندوق (المؤشر) ؛ f: متوسط العائد السنوي الخالي من المخاطر ؛ σ: الانحراف المعياري السنوي ؛ σ_{excess}: معامل بيتا المحسطة بالنسبة للمؤشر

تفاصيل التمويل

مكتب الرياض المالية الرئيسي
3128بوليفارد العالمي 4671حي العقيق، الرياض 13519 المملكة العربية السعودية
هاتف: 920012299 | البريد الإلكتروني: ask@riyadcapital.com | http://www.riyadcapital.com/ar/

أداء الاستثمار ليس مؤشرًا ولا ضمانًا لمعادلة الاستثمار. يمكن أن تشهد قيمة الوحدات والتدخل منها أو تظل. قد يفلت المستثمرون أقل مما استثمروا حيث لا يوافق على ذلك. الرسوم المتوقعة على الأموال باستثناء صافي العائدات قد يكون لها آثار سلبية إضافية يجب على المستثمرين النظر في وضعهم المالي واليالي قبل التدخل في منتج معين. حقوق حقوق عائد غير المشورة من المهنيين في مجال الاستثمار والمقايير. يتم توفير التوضيحات والتعليقات والبيانات في الشبكات والأحكام والقرارات إدارة المحفظة التقنية المحفظة على الصندوق وإدارة المحفظة التقنية التي يجب قراءتها وفهمها قبل التدخل فيها.