

هدف الصندوق

هو صندوق عام مفتوح يستثمر أمواله بشكل رئيسي في أسهم الشركات المتوسطة والصغيرة والمتناهية الصغر المدرجة في سوق الأسهم السعودية المتوافقة مع الشواهد الشرعية الصادرة من اللجنة الشرعية التي يحددها مؤشر الصندوق

معلومات الصندوق

تاريخ بدء الصندوق	30 ديسمبر 2009
سعر الوحدة عند الطرح	10.00
حجم الصندوق	46,904,002.93
نوع الصندوق	صندوق استثماري عام مفتوح يستثمر في أسهم الشركات السعودية المتوسطة والصغيرة المتوافقة مع الشواهد الشرعية
عملة الصندوق	الريال السعودي
مستوى المخاطر	عالي المخاطر
المؤشر الاسترشادي	(إجمالي ريندز إسلامي الإسهام الصغيرة والمتوسطة والواحدة للسوق السعودي
عدد مرات التوزيع	--
% رسوم الإدارة (الصندوق) الصندوق (المستثمر)	1.75
مستشار الاستثمار ومدير الصندوق من الجانب	--
عدد أيام المتوسط المرجح	--
نسبة الأرباح الإجمالية	322,071.12 0.656%
نسبة الأرباح	--
معاريف الأداء	16,333.03 0.035%
استثمار مدير الصندوق	--
الأرباح الموزعة	--

معلومات الأسعار كما في نهاية الربع

سعر الوحدة نهاية الربع	49.46
التغير في سعر الوحدة	-3.07%
إجمالي وحجم الصندوق	944,133.79
إجمالي صافي الأصول	46,695,540.95
مؤشر الربحية (P/E)	--

بيانات ملكية استثمارات الصندوق

ملكية تامة	100.00%
حق منفعة	--

العائد التراكمي (%)

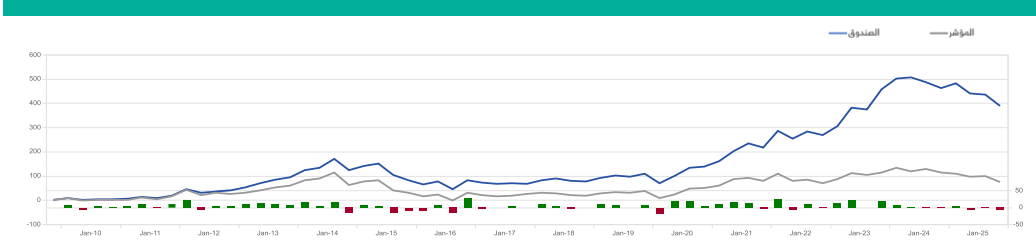
أداء الصندوق	ثلاثة أشهر انهاء الربع الحالي	منذ بداية السنة	سنة واحدة	ثلاث سنوات	خمس سنوات
-3.07	1.69	-7.57	4.45	48.21	
-4.88	-1.77	-13.78	-16.51	-11.21	
1.81	3.46	6.21	20.96	59.42	

معايير الأداء والمخاطر

المقاييس	ثلاثة أشهر انهاء الربع الحالي	منذ بداية السنة	سنة واحدة	ثلاث سنوات	خمس سنوات
1. الانحراف المعياري	5.09%	4.63%	16.88%	18.25%	18.89%
2. مؤشر شارب	-0.79	-0.25	-0.68	-0.18	0.23
3. حد التبع	1.26%	0.93%	3.06%	7.79%	7.38%
4. بيتا	0.91	0.91	0.92	1.02	0.98
5. ألفا	0.46%	0.36%	5.78%	8.18%	10.95%
6. مؤشر المعلومات	1.20	1.35	1.94	0.92	1.42

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

مقارنة الأداء بين الصندوق والمؤشر الاسترشادي



معادلات معايير الأداء والمؤشر

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

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

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

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

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

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

n: عدد فترات الأداء في العينة | r: العائد لفترة معينة | r_f: معدل الخزانة السنوي (المعيار) | f: متوسط العائد السنوي للمحفظة (المؤشر) | f_p: متوسط العائد السنوي الحالي 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
3128بوليفارد المالي 6671حي الفيلق، الرياض 13519 المملكة العربية السعودية
هاتف: 92012299 | البريد الإلكتروني: ask@riyadcapital.com | http://www.riyadcapital.com/ar

أداء مسؤولية
أداء الاستثمار ليس مؤشرا على ضمان العوائد المستقبلية. يمكن أن تشهد قيمة الوحدات والحد منها أو تان. قد يخضع المستثمون قبل مع استثمائهم حيث بالضرورة أن كل الأسهم المتوفرة على الأسواق سيستأجر صافي العائدات قد يكون لها آثار سلبية (إيجابية) على المستثمرين البطار في وضعهم المالي والتي قبل الصندوق في منتج معين/ صندوق معين ويجب عليهم طلب المشورة من المهنيين في مجال الاستثمار والمقايير. يتم توفير التوضيحات التفصيلية والحدود المتعلقة بالمنتج في النشرات والإحكام والقوانين إدارة المحفظة التقديرية المحفظة على الصندوق وإدارة المحفظة التقديرية التي يجب قراءتها وفهمها قبل الدخول فيها.