

هدف الصندوق

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

معلومات الصندوق

تاريخ بدء الصندوق	18 يونيو 1988
سعر الوحدة عند الطرح	10.0000
حجم الصندوق	54,050,247.76
نوع الصندوق	صندوق الرياض للمتاجرة المتنوع بالدولار وهو صندوق أدوات دين عام مفتوح يستثمر في أدوات الدين المتوافقة مع الضوابط الشرعية.
عملة الصندوق	الدولار الأمريكي
مستوى المخاطر	منخفض إلى متوسط المخاطر
المؤشر الاسترشادي	سعر تكلفة التحويل بين البنوك بالدولار الأمريكي لمدة 3 شهور
عدد مرات التوزيع	--
نسو% الإدارة (الصندوق) الصندوق المستثمر فيه	0.5 0.5
مستشار الاستثمار ومدير الصندوق من الجانب	--
عدد أيام المتوسط المرجح	75
نسبة الاعتماد الإجمالية	82,166.14
نسبة الافتراض	--
مخاطر الائتمان	--
استثمار مدير الصندوق	2,096,856.19
الأرباح الموزعة	--

معلومات الأسعار كما في نهاية الربع

سعر الوحدة نهاية الربع	31.1024
التغير في سعر الوحدة	0.78%
إجمالي وحجم الصندوق	1,737,101.16
إجمالي صافي الأصول	54,027,971.63
مكرر الربحية (P/E)	--

بيانات ملكية استثمارات الصندوق

ملكية تامة	100.00%
حق منفعة	--

العائد التراكمي (%)

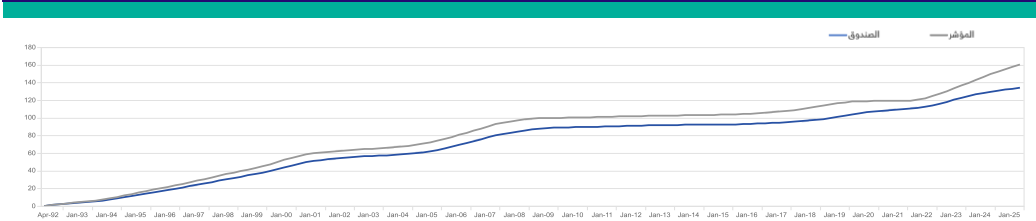
	ثلاثة اشهر نهاية الربع الحالي	منذ بداية السنة	سنة واحدة	ثلاث سنوات	خمس سنوات
أداء الصندوق	0.78	2.08	2.58	8.36	14.32
أداء المؤشر	0.91	2.75	3.83	14.59	21.99
عراق الأداء	-0.12	-0.72	-1.25	-6.23	-7.67

معايير الأداء والمخاطر

	ثلاثة اشهر نهاية الربع الحالي	منذ بداية السنة	سنة واحدة	ثلاث سنوات	خمس سنوات
1. الانحراف المعياري	0.00%	0.05%	0.19%	0.24%	0.29%
2. مؤشر شارب	-48.63	-15.19	-6.98	-8.18	-4.02
3. حد التبع	0.00%	0.06%	0.23%	0.23%	0.32%
4. بيتا	0.78	-0.81	-0.99	0.58	0.46
5. ألفا	0.03%	0.47%	6.45%	0.04%	0.85%
6. مؤشر المعلومات	-48.22	-4.61	-5.13	-8.30	-4.19

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

مقارنة الأداء بين الصندوق والمؤشر الاسترشادي



معادلات معايير الأداء والمؤشر

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

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

$$\beta = \frac{Cov(r_{p,t}, r_{f,t})}{Var(r_{f,t})} \quad (4)$$

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

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

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

n: عدد فترات الأداء في العينة ؛ r: العائد لفترة معينة ؛ r_f: سعر الفائدة الفوري (المؤشر) ؛ f_م: 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
3128 البوlevard المالي 4671، حي العقيق، الرياض 13519 المملكة العربية السعودية
هاتف: 920012299 | البريد الإلكتروني: ask@riyadcapital.com | http://www.riyadcapital.com/ar/

أفكار مسئولية
الأداء المالي ليس مؤشراً على جودة الأداء الاجتماعي. يمكن أن تؤثر قيمة الوحدات والحد منها أو تان. قد يخلق المستثمرون أخطأ مما استثمروا أحياناً، بالإضافة إلى ذلك. الرسوم المتعددة على الأموال يستلزم صرف المصالح قد يكون لها آثار سلبية (إضافة) على المستثمرين. لذلك في استثمارهم المالي والمالي قبل اتخاذ في منتج معين/ صندوق معين يجب عليهم طلب المشورة من المهنيين في مجال الاستثمار والمقايير. يتم توفير التوضيحات التفصيلية والمحددات المتعلقة بالمنتج في النشرات والأحكام وإقراراً بضرورة المحفظة التفرعية المحفظة على الصندوق وإدارة المحفظة التفرعية التي يجب مراقبتها وفهمها قبل الدخول فيها.