

هدف الصندوق

هو صندوق قابض عام مفتوح يستثمر في مجموعة من الصناديق بهدف إلى تحقيق التوازن بين نمو وحماية رأس المال على المدى المتوسط والطويل في ظل مخاطر متوسطة.

معلومات الصندوق

تاريخ بدء الصندوق	10 يونيو 2001
سعر الوحدة عند الطرح	10.00
حجم الصندوق	28,567,702.69
نوع الصندوق	هو صندوق قابض عام مفتوح يستثمر في مجموعة من الصناديق
عملة الصندوق	الريال السعودي
مستوى المخاطر	متوسطة المخاطر
المؤشر الاسترشادي	Barclays Bond Index ■ TASI ■ MSCI World Index ■ سعر لكافة المؤشر بين البنوك بالريال السعودي لمدة شهر
عدد مرات التوزيع	--
% رسوم الإدارة الصندوق, الصندوق المستثم 0.4 1.85 - 0.50	--
مستشار الاستثمار ومدير الصندوق من الجانب	--
عدد أيام المتوسط المرجح	--
نسبة الأتعاب الجمالية	74,527.04 0.264%
نسبة الاقتراض	--
معاريف التعامل	--
استثمار مدير الصندوق	--
الأرباح الموزعة	--

معلومات الأسعار كما في نهاية الربع

سعر الوحدة نهاية الربع	29.54
التغير في سعر الوحدة	1.39%
إجمالي وحجم الصندوق	963,124.32
إجمالي صافي الأصول	28,452,808.39
مركز 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	1.39	8.54	8.54	28.57	22.02
أداء المؤشر	0.96	9.04	9.04	32.49	27.18
عراق الأداء	0.43	-0.50	-0.50	-3.93	-5.16

معايير الأداء والمخاطر

المعيار	ثلاثة اشهر نهاية الربع الحالي	منذ بداية السنة	سنة واحدة	ثلاث سنوات	خمس سنوات
1 الانحراف المعياري	0.72%	3.15%	3.15%	5.00%	5.76%
2 مؤشر شارب	0.51	1.32	1.32	0.73	0.13
3 حد التبع	0.05%	0.76%	0.76%	0.85%	1.47%
4 بيتا	1.00	0.99	0.99	1.00	0.93
5 ألفا	0.14%	-0.36%	-0.36%	-0.99%	-0.48%
6 مؤشر المعلومات	8.13	-0.63	-0.63	-1.27	-0.58

ملاحظة: تم إدراج بيان المعاملات المستخدمة لاحتساب معايير الأداء والمخاطر أسفل الرسم البياني.

مقارنة الأداء بين الصندوق والمؤشر الاسترشادي

--	--



معادلات معايير الأداء والمخاطر:

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

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

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

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

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

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

n: عدد فترات الأداء في العينة | r_t: العائد لفترة معينة | r_p: متوسط العائد السنوي للصندوق (المؤشر) | r_f: متوسط العائد السنوي الخالي من المخاطر | σ: الانحراف المعياري السنوي | σ_{excess}: الانحراف المعياري السنوي للعوائد فوق عائد المؤشر | β: معامل بيتا المحفظة بالنسبة للمؤشر

تفاصيل التمثيل

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

أغلب مسؤولية
الأداء السابق ليس مؤشرا وان معاد المعادلات المستخدمة يمكن أن تظهر قيمة الوجودات والحد منها أو تاتي. قد يخلق المستثمر أخطا عند استثماره حيث، بالإضافة إلى ذلك، الرسوم المتوقعة على الاستثمار ستزيد من المعادلات قد يكون لها آثار سلبية إضافية يجب على المستثمرين النظر في وضعهم المالي واليالي قبل اتخاذ أي منتج معين. صندوق يقود يجب عليهم طلب المشورة من المهنيين في مجال الاستثمار والماليين. يتم توفير التوضيحات والتعليقات المتعلقة بالمنتج في نشرة والوثائق واقتراحية إدارة المحفظة التقديرية المحفظة على الصندوق وإدارة المحفظة التقديرية التي يجب قراءتها وفهمها قبل الدخول فيها.