

هدف الصندوق

هو صندوق قابض عام مفتوح يستثمر في مجموعة من الصناديق المتوافقة مع الضوابط الشرعية المقررة من اللجنة الشرعية بهدف إلى نمو رأس المال على المدى الطويل في ظل مخاطر عالية.

معلومات الصندوق

تاريخ بدء الصندوق	31 ديسمبر 2002
سعر الوحدة عند الطرح	10.00
حجم الصندوق	44,885,331.75
نوع الصندوق	صندوق قابض عام مفتوح يستثمر في مجموعة من الصناديق المتوافقة مع الضوابط الشرعية.
عملة الصندوق	الريال السعودي
مستوى المخاطر	عالي المخاطر
المؤشر الاسترشادي	■ Dow Jones Sukuk Total Return (ex) ■ S&P Saudi Shariah ■ D-J Islamic Markets (Reinvestment) ■ سعر لكلفة التمويل بين البنوك بالريال السعودي لمدة شهر
عدد مرات التوزيع	--
% رسوم الإدارة الصندوق, الصندوق المستثمر 1.85 - 0.50	0.85
مستشار الاستثمار ومدير الصندوق من الجائز	--
عدد أيام التأسيس المرحج	--
نسبة الأرباح الإجمالية	169,235.68 0.373%
نسبة الأقراس	--
معاريف التعامل	--
استثمار مدير الصندوق	--
الأرباح الموزعة	--

معلومات الأسعار كما في نهاية الربع

سعر الوحدة نهاية الربع	48.34
التغير في سعر الوحدة	1.11%
إجمالي وحجم الصندوق	923,083.45
إجمالي صافي الأصول	44,619,988.28
مركز الربحية (P/E)	--

بيانات ملكية استثمارات الصندوق

ملكية تامة	100.00%
حق منفعة	--

العائد التراكمي (%)

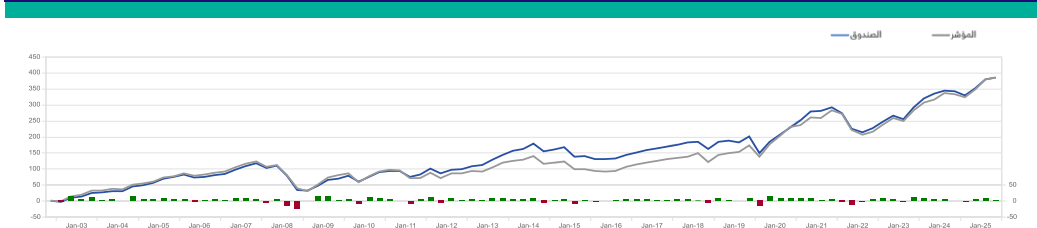
	ثلاثة أشهر انهاء الربع الحالي	منذ بداية السنة	سنة واحدة	ثلاث سنوات	خمس سنوات
أداء الصندوق	1.11	9.57	48.52	47.01	
أداء المؤشر	0.92	11.80	53.48	46.21	
فارق الأداء	0.18	-2.23	-4.96	0.80	

معايير الأداء والمخاطر

المعيار	ثلاثة أشهر انهاء الربع الحالي	منذ بداية السنة	سنة واحدة	ثلاث سنوات	خمس سنوات
1. الانحراف المعياري	1.79%	7.83%	7.83%	9.32%	11.04%
2. مؤشر شارب	0.05	0.66	0.66	0.97	0.43
3. حد التبع	0.13%	1.43%	1.43%	2.23%	3.61%
4. بيتا	0.98	0.99	0.99	0.96	0.94
5. ألفا	0.07%	-1.86%	-1.86%	-0.51%	0.57%
6. مؤشر المعلومات	1.42	-1.49	-1.49	-0.56	0.03

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

مقارنة الأداء بين الصندوق والمؤشر الاسترشادي



معادلات معايير الأداء والمخاطر:

$$IR = \frac{E(r_p - r_f)}{\sigma_{excess}} \quad (6) \quad \alpha_t = r_t - [r_f + \beta * (r_s - r_f)] \quad (5) \quad \beta = \frac{Cov(r_p, r_b)}{Var(r_b)} \quad (4) \quad \sigma = \sqrt{\frac{n \sum_{i=1}^n r_i^2 - (\sum_{i=1}^n r_i)^2}{n^2}} \quad (3) \quad SR = \frac{r_p - r_f}{\sigma_p} \quad (2) \quad s = \sqrt{\frac{n \sum_{i=1}^n r_i^2 - (\sum_{i=1}^n r_i)^2}{n^2 - n}} \quad (1)$$

n: عدد فترات الأداء في العينة | r_t: العائد لفترة معينة | r_p, r_f: متوسط العائد السنوي للمحفظة (المؤشر) | f, r: متوسط العائد السنوي الحالي من المخاطر | σ: الانحراف المعياري السنوي | σ_{excess}: الانحراف المعياري السنوي للعائد فوق عائد المؤشر | β: معامل بيتا للمحفظة بالنسبة للمؤشر

تفاصيل الاستثمار

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/

أداء الاستثمارية
الأداء السابق ليس مؤشراً على أداء الاستثمارية المستقبلية. يمكن أن تتغير قيمة الوحدات والحدود منها أو تُلغى. قد يلغى المستثمرون الحق في استردادهم استثمارهم، بالإضافة إلى ذلك، الرسوم المتوقعة على الأموال باستثناء صافي العائدات قد يكون لها آثار سلبية إضافية يجب على المستثمرين النظر في وضعهم المالي والسياسات قبل اتخاذ أي منتج معين. صندوق مفتوح يجب عليه طلب المشورة من المهنيين في مجال الاستثمار والمقايير. يتم توفير التوضيحات التفصيلية والمحددات المتعلقة بالمنتج في النشرات والوثائق وإقرارها بإدارة المحفظة التقنية المحفظة على الصندوق وإدارة المحفظة التقنية التي يجب قراءتها وفهمها قبل الدخول فيها.