

هدف الصندوق

هو صندوق عام مفتوح يستثمر شكل رئيسي في صندوق أيردينجل للسهم الأمريكية ويهدف إل أن يقي تنمية رأس المال عل المدل الطويل.

معلومات الصندوق

تاريخ بدء الصندوق	26 مايو 1992
سعر الوحدة عند الطرح	10.00
حجم الصندوق	5,845,330.88
نوع الصندوق	صندوق عام مفتوح يستثمر في صندوق أيردينجل للسهم الأمريكية.
عملة الصندوق	الدولار الأمريكي
مستوى المخاطر	عالي المخاطر
المؤشر الاستثماري	ستاندرد اند بورز 500
عدد مرات التوزيع	--
% رسوم الإدارة (الصندوق الصندوق المستثمر)	1.15
مستشار الاستثمار ومدير الصندوق من الجانب	--
عدد أيام التوسيد المرحج	--
نسبة الأتعاب الإجمالية	29,431.23
نسبة الأتعاب	0.502%
نسبة الاقتراض	--
معاريف التعامل	--
استثمار مدير الصندوق	--
الأرباح الموزعة	--

معلومات الأسعار كما في نهاية الربع

سعر الوحدة نهاية الربع	192.07
التغير في سعر الوحدة	3.77%
إجمالي وحجم الصندوق	30,146.05
إجمالي صافي الأصول	5,790,021.43
مكرر 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
أداء المؤشر	3.77	6.08	9.38	59.99	67.48
عراق الأداء	2.03	11.77	14.40	79.00	75.52
	1.74	-5.70	-5.02	-19.02	-8.04

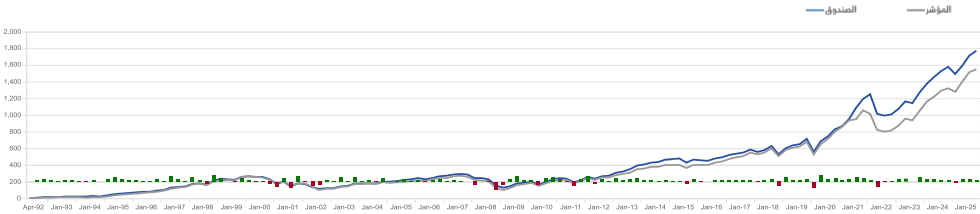
معايير الأداء والمخاطر

المقاييس	ثلاثة أشهر انهاء الربع الحالي	منذ بداية السنة	سنة واحدة	ثلاث سنوات	خمس سنوات
1. الانحراف المعياري	2.08%	3.66%	11.36%	11.75%	14.69%
2. مؤشر شارب	1.35	0.88	0.48	1.04	0.48
3. حدأ التبع	1.63%	1.32%	4.29%	3.51%	5.74%
4. بيتا	0.58	0.83	0.83	0.95	0.94
5. ألفا	0.84%	-0.38%	-2.20%	-2.82%	-0.19%
6. مؤشر المعلومات	1.10	-1.61	-1.12	-1.25	-0.18

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

مقارنة الأداء بين الصندوق والمؤشر الاستثماري

--



معادلات معايير الأداء والمخاطر:

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

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

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

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

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

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

n: عدد فترات الأداء في العينة | r_t : العائد لفترة معينة | r_f : المعدل الفرضي معينة | r_s : متوسط العائد السنوي للمحفظة (المؤشر) | f, σ : متوسط العائد السنوي الداخلي 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 العقيق، الرياض 13519 المملكة العربية السعودية
هاتف: 920012299 | البريد الإلكتروني: ask@riyadcapital.com |
http://www.riyadcapital.com/ar/

إدارة مسؤولية
أداء الاستثمار ليس مؤشرا وان معاد العوائد المستقبلية. يمكن أن تظهر قيمة الوحدات والحد منها أو تان. قد يخلق المستثمون أخل مع استثمارهم أخل بالوفاء إلى ذلك. الرسوم المتوقعة على الاستثمار سلاسل صافي العائدات قد يكون لها آثار سلبية (إضافة) يجب على المستثمرين البقاء على وعيهم المخاطر والتي قبل الحدوث في منتج معين. حقوق حقوق عقوبت عليهم طلب المشورة من المهنيين في مجال الاستثمار والمقايير. يتم توفير التوضيحات التفصيلية والحدود المتعلقة بالمنتج في النشود والأكافم والتقرير إدرة المحفظة التقديرية المحفظة على الصندوق وإدارة المحفظة التقديرية التي يجب قراءتها وفهمها قبل الدخول فيها.