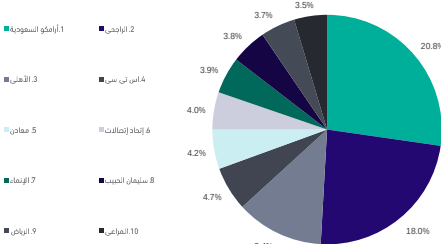


هدف الصندوق

هو صندوق عام مفتوح يستثمر في الأسهم السعودية ويهدف الى تحقيق تنمية رأسي المال على المدى الطويل.

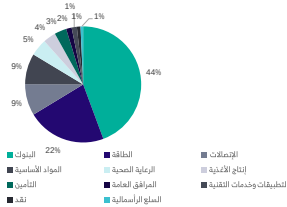
أكبر 10 استثمارات



توزيع الأصول الجغرافي



توزيع الأصول القطاعي



معلومات الأسعار كما في نهاية الربع

سعر الوحدة نهاية الربع	108.43
التغير في سعر الوحدة	-0.62%
إجمالي وحداث الصندوق	7,735,255.83
إجمالي صافي الأصول	838,735,756.61
مؤشر الربحية (P/E)	--

بيانات ملكية استثمارات الصندوق

ملكية تامة	100.00%
حق منفعة	--

العائد التراكمي (%)

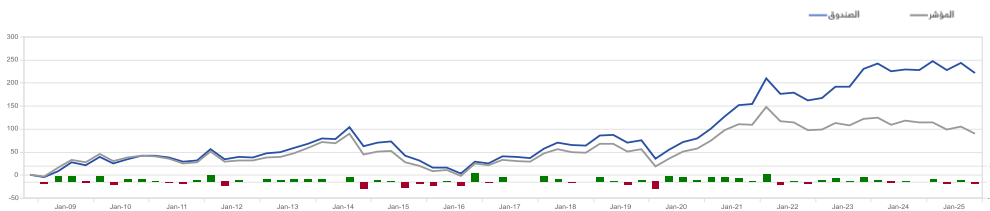
أداء الصندوق	ثلاثة أشهر (نهاية الربع الحالي)	منذ بداية السنة	سنة واحدة	ثلاث سنوات	خمس سنوات
أداء المؤشر	-0.62	3.02	-3.86	13.37	31.45
عراق الأداء	2.29	2.23	-5.45	-6.64	-7.33
	1.67	0.79	1.59	20.01	38.78

معايير الأداء والمخاطر

المعيار	ثلاثة أشهر (نهاية الربع الحالي)	منذ بداية السنة	سنة واحدة	ثلاث سنوات	خمس سنوات
1. الانحراف المعياري	4.24%	4.78%	16.44%	14.34%	16.93%
2. مؤشر شارب	-0.37	0.03	-0.47	-0.03	0.10
3. حد التبع	0.30%	0.53%	2.08%	3.91%	3.54%
4. بيتا	1.07	0.98	0.97	0.99	0.99
5. ألفا	0.63%	0.09%	1.47%	6.72%	7.26%
6. مؤشر المعلومات	5.07	0.55	0.73	1.65	2.00

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

مقارنة الأداء بين الصندوق والمؤشر الاسترشادي



معادلات معايير الأداء والمخاطر:

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

n: عدد فترات الأداء في العينة ؛ r: الأداء لفترة معينة ؛ r_p: متوسط العائد السنوي للصندوق (المؤشر) ؛ r_m: متوسط العائد السنوي للخارج من المخاطر ؛ σ: الانحراف المعياري السنوي ؛ σ_{excess}: الانحراف المعياري السنوي للعوائد فوق عائد المؤشر ؛ β: معامل بيتا للمحفظة بالنسبة للمؤشر

تفاصيل التمثيل

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

أداء مسؤولية
أداء الاستثمار ليس مؤشراً على ضمان العوائد المستقبلية. يمكن أن تتغير قيمة الوحدات والحدود منها أو تظل. قد يفلت المستثمرون أقل مما استثمروا حيث لا يراعى إلى ذلك. الرسوم المتوقعة على الأموال باستثناء صافي العائدات قد يكون لها آثار سلبية إضافية يجب على المستثمرين البقاء على وعيهم الفوري والبالغ قبل الدخول في منتج معين. صندوق معين يجب عليه طلب المشورة من المهنيين في مجال الاستثمار والملاوي. يتم توفير التوضيحات والتعليقات المتعلقة بالمنتج في النشرات والإحكام والقانونية إدارة المحفظة التقديرية المحفظة على الصندوق وإدارة المحفظة التقديرية التي يجب مراعاتها وفهمها قبل الدخول فيها.