

بيان المعدلات المستخدمة لإحتساب معايير الأداء والمخاطر

الانحراف المعياري	الانحراف المعياري هو إحصائية تقيس تشتت مجموعة بيانات بالنسبة لمتوسطها. يتم حساب صيغته على أنها الجذر التربيعي للتباين، والذي يعتمد على انحراف كل نقطة بيانات عن المتوسط. يتم قياس ذلك على كل فترة زمنية محددة، ويتم تحويله إلى معدل سنوي بناءً على عدد نقاط البيانات في السنة.
مؤشر شارب	مؤشر شارب هي متوسط العائد المحقق بما يتجاوز معدل العائد الخالي من المخاطر لكل وحدة من التقلب أو المخاطر الكلية. المعادلة المستخدمة لمؤشر شارب = (عوائد الصندوق - العائد الخالي من المخاطر) / الانحراف المعياري.
خطا التتبع	خطا التتبع هو التباين بين سلوك سعر الصندوق وسعر المؤشر المرجعي له. يتم حسابه على أنه الانحراف المعياري للفرق بين عائد الصندوق وعائد المؤشر المرجعي.
بيتا	بيتا هي مقياس للتقلب — أو المخاطر النظامية — للصندوق مقارنة بالسوق. يتم حساب بيتا باستخدام الصيغة التالية: (التباين المشترك بين عوائد الصندوق وعوائد المؤشر المرجعي) / (تباين عوائد المؤشر المرجعي).
ألفا	ألفا تشير إلى العوائد الزائدة المحققة على الاستثمار مقارنة بالعائد المرجعي. قد تكون ألفا موجبة أو سالبة وهي نتيجة للاستثمار النشط. المعادلة المستخدمة لحساب معادلة ألفا = عوائد الصندوق - عوائد المؤشر الإرشادي.
مؤشر المعلومات	نسبة المعلومات (IR) هي مقياس أداء معدل حساب المخاطر بقيم مدى كفاءة الصندوق في تحقيق عوائد تفوق المؤشر المرجعي، مع الأخذ في الاعتبار تقلب تلك العوائد الزائدة. يتم حسابها عن طريق أخذ الفرق بين عوائد الصندوق والمؤشر لنفس الفترة، ثم قسمته على خطأ التتبع.

لا تتقدم سيكو المالية لاء أي انتشار. الأداء السابق ليس بالضروة دليلاً للأداء المستقبلي. سعر وقيمة أي استثمار من انتشارك محفوف بوزيد أو ينقص وقد يحصل انتشار على أقل مما تتوقعه. يستثمر الصندوق في الأوراق المالية وفقاً لتدابير وإحكام الصندوق. وبالتالي فهو معرض لأبوع مختلفة من المخاطر التي يصب على الاستثمار فرائداً وإرتدادها. لا يقره مدير الصندوق باسترداد الوصايا قيمة العرض، وأن قيمة الوصايا والمطل منها يمكن أن تتغير أو ترفع قد لا يكون الانتشار مدعماً لجميع أنواع المستثمرين. نوصي سيكو المالية بجميع المستثمرين بحذورة طلب المشورة من مستشار الانتشار الخاص بهم. تحتوي المشاركة في الانتشار على مخاطر العسرة الشكينة. الانتشارات عرضة لمخاطر الانتشار، وهي الرجوع إلى الشروط والأحكام لزيادة من التفصيل حول المخاطر ذات الصلة للتمويل على حدة من شروط وإحكام الصندوق والبيانات المالية، يرجى زيارة موقعنا على www.sicocapital.com أو الاتصال على 8001010008 أو زيارة مكتبنا حسب العنوان أدناه. يجوز لشركة سيكو المالية أو الشركات التابعة لها الانتشار في الصندوق أو الأوراق المالية المرصصة به. كما تقوم سيكو المالية تلقياً بأصل لفرى في مجال الأوراق المالية المستقلة، مثل تمويل الشركات والخدمات المصرفية الاستثمارية والوسيلة والتي قد تكون هي أو الشركات التابعة لها قد قدمت أو ربما قدمت خلال الأثني عشر شهراً الماضية خدمات أصل الأوراق المالية الأخرى المستشري الأوراق المالية، حيث قد يستثمر الصندوق من وقت لآخر.