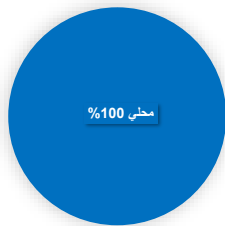
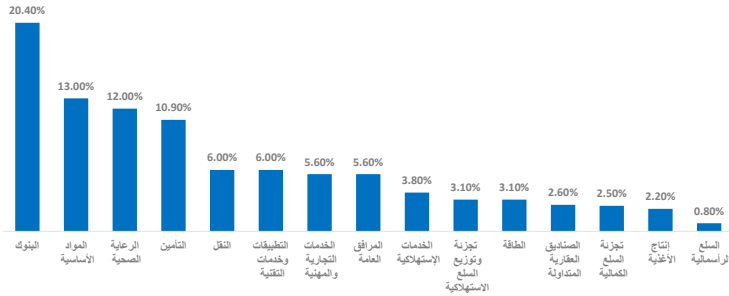


رسم بياني يوضح توزيع أصول الصندوق (قطاعي / جغرافي)*



العائد

البيان	3 أشهر	سنة حتى تاريخه	سنة واحدة	3 سنوات	5 سنوات
أداء الصندوق	15.62	32.30	32.30	101.42	164.95
أداء المؤشر الاستراتيجي	9.88	20.83	20.83	60.32	100.41
فارق الأداء	5.74	11.47	11.47	41.10	64.54

الأداء والمخاطر

البيان	3 أشهر	سنة حتى تاريخه	سنة واحدة	3 سنوات	5 سنوات
الانحراف المعياري	10.15	21.37	21.37	19.91	19.78
مؤشر شارب	5.49	1.23	1.23	1.53	1.52
خطأ التنبؤ	4.46	3.59	3.59	5.01	4.81
بيتا	0.93	0.99	0.99	0.94	0.93
ألفا	5.74	11.47	11.47	41.10	64.54
مؤشر المعلومات	5.15	3.19	3.19	2.74	2.68



تعريفات

الانحراف المعياري	المقياس الأساسي لمعدل المخاطرة، وهو يقيس مقدار التذبذب في السعر أو العائد حول المتوسط عبر فترة من الزمن. وصفاً عامة كلما كان أصغر كانت المخاطرة أقل
مؤشر شارب	نسبة تقيس متوسط العائد الذي يتم الحصول عليه بما يزيد عن المعدل الحالي من المخاطر.
خطأ التنبؤ	نسبة شارب = (متوسط عائد المحفظة - معدل العائد الحالي من المخاطر) / الانحراف المعياري لعائد المحفظة
بيتا	يعطي خطأ التنبؤ دليلاً على ثقل العوائد من خلال قياس انشاق فرق تبع المحفظة بمرور الوقت، ويتم حسابه باستخدام الانحراف المعياري السنوي للفرق في المحفظة والعوائد المعيارية
ألفا	قياس لمدى حساسية الصندوق للحركة في سوقه أو مؤشره الإرشادي
مؤشر المعلومات	هو الفارق بين العائد الفعلي للمنتوق والعائد المتوقع له بناء على نسبة المخاطرة التي يتحملها (بالمقارنة مع مخاطرة سوقه ككل، والتي نحسبها بمعامل (بيتا)).
	مؤشر يستخدم لتقييم أداء مدير الصندوق لفترة معينة وقياس قدرة مدير الصندوق في تحقيق أداء أفضل من السوق أو من المؤشر الاستراتيجي

إخلاء مسؤولية

لا يعتبر الأداء في الماضي دليلاً لسير الأداء في المستقبل، إذ أن أسعار الوحدات قابلة للتغير وليست مضمونة

* الرسم البياني لأكبر استثمارات الصندوق و توزيع أصول الصندوق كما في بداية الربع المعني

www.anbcapital.com.sa

800 124 0055

info@anbcapital.com.sa

شركة العربي المالية مرخصة من هيئة السوق المالية في المملكة العربية السعودية
ترخيص رقم 37-07072