

بيان المعادلات المستخدمة لاحتساب معايير الأداء والمخاطر:

إحصائيات الصندوق	
الانحراف المعياري	
المعادلة:	$\sigma = \sqrt{(\sum (R_i - \bar{R})^2 / (N - 1))}$
	قياس تذبذب العوائد $\rightarrow \sigma$
	عائد كل فترة $\rightarrow R_i$
	متوسط العائد $\rightarrow \bar{R}$
	عدد الفترات $\rightarrow N$
مؤشر شارب	
المعادلة:	$Sharpe = (R_p - R_f) / \sigma_p$
	عائد الصندوق $\rightarrow R_p$
	العائد الخالي من المخاطر $\rightarrow R_f$
	مخاطر الصندوق الكليه $\rightarrow \sigma_p$
البيتا	
المعادلة:	$\beta = Cov(R_p, R_m) / Var(R_m)$
	حساسية الصندوق لتغيرات السوق $\rightarrow \beta$
	عائد الصندوق $\rightarrow R_p$
	عائد المؤشر السوقي $\rightarrow R_m$
	التباين المشترك بين الصندوق والسوق $\rightarrow Cov$
خطأ التتبع	
المعادلة:	$TE = \sqrt{(\sum (R_p - R_m)^2 / (N - 1))}$
	مدى إنحراف أداء السوق عن الصندوق $\rightarrow TE$
	عائد الصندوق $\rightarrow R_p$
	عائد المؤشر $\rightarrow R_m$
	عدد الفترات $\rightarrow N$
مؤشر المعلومات	
المعادلة:	$IR = (R_p - R_m) / TE$
	كفاءة تحقيق العوائد النشطة $\rightarrow IR$
	عائد الصندوق $\rightarrow R_p$
	عائد المؤشر المرجعي $\rightarrow R_m$
	خطأ التتبع $\rightarrow TE$
ألفا	
المعادلة:	$Alpha = \Delta R_p - \Delta R_m$
	العائد الإضافي للصندوق مقارنة بالمؤشر $\rightarrow Alpha$
	التغير في أداء الصندوق $\rightarrow \Delta R_p$
	التغير في أداء المؤشر $\rightarrow \Delta R_m$