

Security Rating

تقييم الأوراق المالية

Top 10 Holding / أكبر 10 استثمارات	الورقة المالية / Security	تقييم الورقة المالية / Security Rating	الشركة المُقيمة / Rating Agency	تقييم المُصدر / Issuer Rating	الشركة المُقيمة / Rating Agency
1	BSFMUR	Unrated	N/A	A-	Fitch
2	QNBMUR	Unrated	N/A	A+	Fitch
3	BAJMUR	Unrated	N/A	A-	Fitch
4	RAJMUR	Unrated	N/A	A-	Fitch
5	GFHMUR	Unrated	N/A	B-	Fitch
6	SNB Capital Saudi Riyal Trade Fund	A-	Internal	A-	Internal
7	SABBMUR	Unrated	N/A	A-	Fitch
8	BAJMUR	Unrated	N/A	A-	Fitch
9	BAJMUR	Unrated	N/A	A-	Fitch
10	SNB Capital Al Sunbullah SAR	A-	Internal	A-	Internal

Performance/Risk Metrics - Reference Table

جدول مرجعي - مقاييس الأداء/ المخاطر

Metric / المقياس	Formula / المعادلة	Notation / الرموز
Standard Deviation (σ) / الانحراف المعياري	$\sqrt{(\sum (R_i - R)^2) / (n-1)}$	- R_i = individual return / العائد الفردي - R̄ = average return / متوسط العائد - n = number of observations / عدد العينات
Annualized Standard Deviation / الانحراف المعياري على أساس سنوي	$\sigma(r_1, ..., r_n) \times \sqrt{(\text{NumPeriodsPerYear})}$	σ (r1, ..., rn) = standard deviation over the period / الانحراف المعياري خلال الفترة
Information Ratio / مؤشر المعلومات	$(\text{AnnRtn}(R_p) - \text{AnnRtn}(R_b)) / \text{AnnStdDev}(R_p - R_b)$	- R_p = manager return / عائد الصندوق - R_b = benchmark return / عائد المؤشر الإسترشادي - AnnStdDev(R_p - R_b) = annualized standard deviation of excess returns / الانحراف المعياري السنوي للعائد الإضافي
Sharpe Ratio / مؤشر شارب	$(\text{AnnRtn}(R_p) - \text{AnnRtn}(R_f)) / \text{AnnStdDev}(R_p)$	- R_p = manager return / عائد المؤشر الإسترشادي - R_f = risk-free return / العائد الخالي من المخاطر - AnnStdDev(R_p) = annualized standard deviation of manager returns / الانحراف المعياري السنوي لعائد الصندوق
Beta / معامل بيتا	$\sum (m_i - \bar{m})(b_i - \bar{b}) / \sum (b_i - \bar{b})^2$	- m_i = i-th manager return / عائد الصندوق - m̄ = average manager return / متوسط عائد الصندوق - b_i = i-th benchmark return/ عائد المؤشر الإسترشادي - ḃ = average benchmark return / متوسط عائد المؤشر الإسترشادي
Alpha / معامل ألفا	R _p - R _b	- R_p = manager return / عائد الصندوق - R_b = benchmark return/ عائد المؤشر الإسترشادي
Tracking Error / خطأ التتبع	σ(R _p - R _b)	- R_p - R_b = active returns (difference between manager and benchmark returns) / العائد النشط (الفرق بين عائد الصندوق والمؤشر الإسترشادي) - σ = standard deviation/ الانحراف المعياري