

Security Rating

تقييم الأوراق المالية

Top 10 Holding / أكبر 10 استثمارات	الورقة المالية / Security	تقييم الورقة المالية / Security Rating	الشركة المقيمة / Rating Agency	تقييم المصدر / Issuer Rating	الشركة المقيمة / Rating Agency
1	SNB Capital Al Sunbullah SAR	A-	Internal Rating	A-	Internal Rating
2	EMIRATES GLOBAL SUKUK-IUSDA	NA	NA	NA	NA
3	FRANKLIN GBL SUKUK-IAUSD	NA	NA	NA	NA
4	SNB Capital North America Index Fund	NA	NA	NA	NA
5	AlAhli Multi-Asset Opportunities Fund	NA	NA	NA	NA
6	SNB Capital Global REITs Fund	NA	NA	NA	NA
7	INVESCO PHYSICAL GOLD ETC	NA	NA	NA	NA
8	Awaed SP	NA	NA	NA	NA
9	FIM GLOBAL SUKUK-C ACC	NA	NA	NA	NA
10	SNB Capital AlJawhara Real Estate Fund ClassA	NA	NA	NA	NA

Performance/Risk Metrics - Reference Table

جدول مرجعي - مقاييس الأداء/ المخاطر

Metric / المقياس	Formula / المعادلة	Notation / الرمز
Standard Deviation (σ) / الانحراف المعياري	$\sqrt{\sum (R_i - \bar{R})^2 / (n-1)}$	<ul style="list-style-type: none"> R_i = individual return / العائد الفردي \bar{R} = average return / متوسط العائد n = number of observations / عدد العينات
Annualized Standard Deviation / الانحراف المعياري على أساس سنوي	$\sigma (r_1, \dots, r_n) \times \sqrt{\text{NumPeriodsPerYear}}$	σ (r ₁ , ..., r _n) = standard deviation over the period / الانحراف المعياري خلال الفترة
Information Ratio / مؤشر المعلومات	$(\text{AnnRtn}(R_p) - \text{AnnRtn}(R_b)) / \text{AnnStdDev}(R_p - R_b)$	<ul style="list-style-type: none"> R_p = manager return / عائد الصندوق R_b = benchmark return / عائد المؤشر الإستراتيجي AnnStdDev(R_p - R_b) = annualized standard deviation of excess returns / الانحراف المعياري السنوي للعائد الإضافي
Sharpe Ratio / مؤشر شارب	$(\text{AnnRtn}(R_p) - \text{AnnRtn}(R_f)) / \text{AnnStdDev}(R_p)$	<ul style="list-style-type: none"> R_p = manager return / عائد الصندوق الإستراتيجي 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	$\sum (m_i - \bar{m})(b_i - \bar{b}) / \sum (b_i - \bar{b})^2$	<ul style="list-style-type: none"> m_i = i-th manager return / عائد الصندوق \bar{m} = average manager return / متوسط عائد الصندوق b_i = i-th benchmark return / عائد المؤشر الإستراتيجي \bar{b} = average benchmark return / متوسط عائد المؤشر الإستراتيجي
Alpha / معامل ألفا	R _p - R _b	<ul style="list-style-type: none"> R_p = manager return / عائد الصندوق R_b = benchmark return / عائد المؤشر الإستراتيجي
Tracking Error / خطأ التتبع	σ(R _p - R _b)	<ul style="list-style-type: none"> R_p - R_b = active returns (difference between manager and benchmark returns) / العائد النشط (الفرق بين عائد الصندوق والمؤشر الإستراتيجي) σ = standard deviation / الانحراف المعياري