

## هدف الصندوق

صندوق سيكو لأسهم منطقة الشرق الأوسط وشمال أفريقيا هو صندوق عام مفتوح يهدف إلى تحقيق نمو رأس المال على المدى الطويل من خلال الاستثمار في الشركات المتوافقة مع الشريعة الإسلامية المدرجة في أسواق منطقة الشرق الأوسط وشمال أفريقيا.

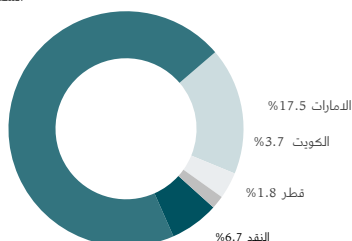
| العائد الإجمالي        | آخر ثلاث أشهر | منذ بداية السنة | سنة   | ثلاث سنوات | خمس سنوات |
|------------------------|---------------|-----------------|-------|------------|-----------|
| أداء الصندوق           | 2.5%          | 7.0%            | 10.2% | 37.8%      | 145.1%    |
| أداء المؤشر الإسترشادي | 3.7%          | 3.2%            | 3.5%  | 10.0%      | 51.4%     |
| فرق الأداء             | -1.2%         | 3.8%            | 6.7%  | 27.8%      | 93.8%     |

تم احتساب العوائد بما يعكس توزيعات الأرباح الموزعة خلال السنة الماضية لمقارنتها مع الفترة الحالية

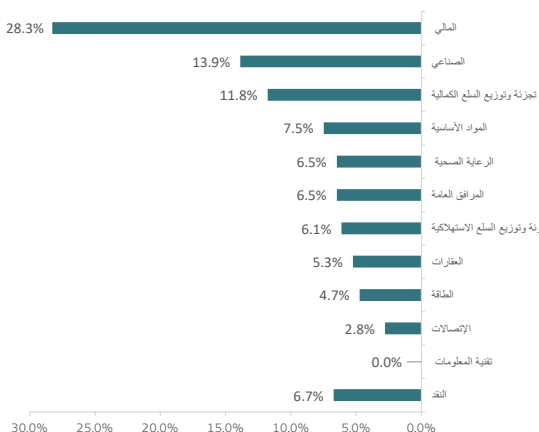
| أخر ثلاث أشهر | منذ بداية السنة | سنة   | ثلاث سنوات | خمس سنوات |
|---------------|-----------------|-------|------------|-----------|
| 17.2%         | 23.0%           | 19.3% | 12.8%      | 13.6%     |
| 0.4           | 0.3             | 0.3   | 0.6        | 1.2       |
| 5.8%          | 7.4%            | 6.6%  | 5.8%       | 7.7%      |
| 1.0           | 1.2             | 1.1   | 1.0        | 0.9       |
| -5.2%         | 5.0%            | 6.7%  | 8.0%       | 11.5%     |
| -0.9          | 0.7             | 1.0   | 1.4        | 1.4       |

مقاييس الأداء والمخاطر على مدار عام واحد محسوبه سنوياً  
عائد الخالي من المخاطر المستخدم هو سايبور 3 أشهر

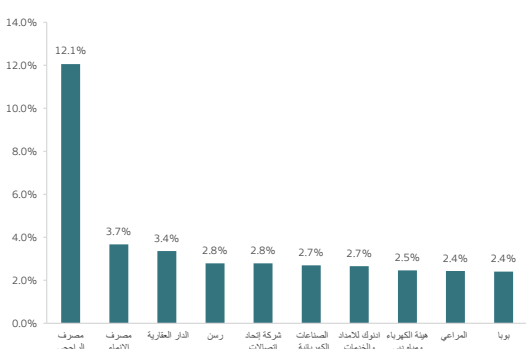
## التوزيع الجغرافي



## التوزيع القطاعي



## أكبر 10 استثمارات للصندوق



آداء سعر الوحدة (ريال سعودي)

[illegible]

شركة ميكو المالية - شركة مساهمة مقفلة رأس مال 60,000,000 ريال سعودي مدفوع بالكامل - ج.ب. 64666 الريالين 13542 - المملكة العربية السعودية - برج سي آر سي، حي الملك فهد طريق الملك فهد 7702 الدور الخامس - ترميم هيئة السوق المالية رقم 08096-37 السجل التجاري رقم 1010259328 - هاتف مجاني 8001010008 (بائيل السعودية) 966 11 521 3835 (خارج السعودية) البريد الإلكتروني: info@micocapital.com

| الجدول 1          |                                                                                                                                                                                                                                                                                |
|-------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 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 التنبع        | خطا التنبع هو التباين بين سلوك سعر الصندوق وسعر المؤشر المرجعي له. يتم حسابه على أنه الانحراف المعياري للفارق 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).                                                                           |
| آلفا              | آلفا تشير إلى العوائد الزائدة المحققة على الاستثمار مقارنة بالعائد المرجعي. قد تكون آلفا موجبة أو سالبة وهي نتيجة للاستثمار النشط. المعادلة المستخدمة لحساب معادلة آلفا = عوائد الصندوق - عوائد المؤشر الاسرصادي                                                               |
| مؤشر المعلومات    | نسبة المعلومات (R) هي مقياس أداء معدل حسب المخاطر يقّم 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 التنبع.                       |