



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
خطأ التتبع	خطأ التتبع هو التباين بين سلوك سعر الصندوق وسعر المؤشر المرجعي له. يتم حسابه على أنه الانحراف المعياري للفرق بين عائد الصندوق وعائد المؤشر المرجعي.
بيتا	بيتا هي مقياس للتقلب - أو المخاطر النظامية - للصندوق مقارنةً بالسوق. يتم حساب بيتا باستخدام الصيغة التالية: (التباين المشترك بين عوائد الصندوق وعوائد المؤشر المرجعي) / (تباين عوائد المؤشر المرجعي).
الفا	الفا تشير إلى العوائد الزائدة المحققة على الاستثمار مقارنة بالعائد المرجعي. قد تكون الفا موجبة أو سالبة وهي نتيجة للاستثمار النشط. المعادلة المستخدمة لحساب معادلة الفا = عوائد الصندوق - عوائد المؤشر الاسرصادي
مؤشر المعلومات	نسبة المعلومات (IR) هي مقياس أداء معدل حسب المخاطر يقيم 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 التتبع.