# صندوق فالكم المتداول لقطاع البتروكيماويات ("الصندوق")

June 30, 2015

| النطاق الجغرافي | العملة | فئة الصندوق | التوافق الشرعي | تصنيف الصندوق | نوع الصندوق |
|---|---|---|---|---|---|
| السوق المحلي | الريال السعودي | أسهم مدرجة متداولة | ✓ | النمو | صندوق مؤشرات متداول |

## أهداف المحفظة

يهدف صندوق فالكم المتداول لقطاع البتروكيماويات لتحقيق مكاسب رأسمالية للمستثمرين و نمو لرأس مالهم على المدى الطويل.

يستثمر الصندوق بشكل غير نشط في الأسهم المدرجة لشركات قطاع البتروكيماويات من أجل تحقيق مستوى أداء يتطابق مع أداء مؤشر القياس (مؤشر فالكم لقطاع البتروكيماويات) قبل الرسوم والمصاريف.

## الأداء

| الأجل القصير | شهر | شهور 3 | شهور 6 | شهور 9 |
|---|---|---|---|---|
| الصندوق | -5.70% | 13.45% | 10.67% | -25.93% |
| المؤشر | -5.87% | 11.19% | 8.02% | -27.63% |

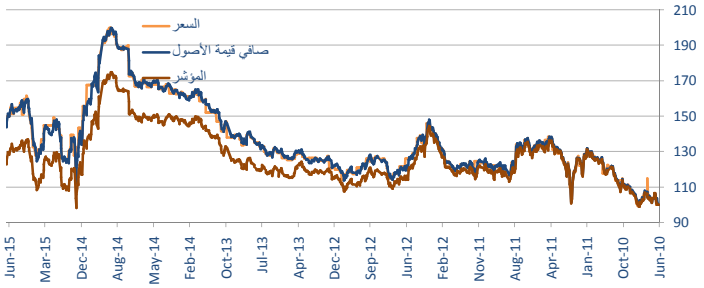
| تقويم العائد | 2015YTD | 2014 | 2013 | منذ التأسيس |
|---|---|---|---|---|
| الصندوق | 10.67% | -18.93% | 32.62% | 44.06% |
| المؤشر | 8.02% | -21.67% | 27.14% | 23.19% |

| | سنة | | سنتان | | سنوات 3 | | منذ التأسيس | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | الصندوق | المؤشر | الصندوق | المؤشر | الصندوق | المؤشر | الصندوق | المؤشر |
| العوائد المتراكمة | -18.93% | -16.92% | 12.49% | 4.81% | 20.36% | 16.46% | 44.06% | 23.19% |
| الإنحراف المعياري | 16.58% | 20.72% | 12.29% | 4.77% | 20.07% | 16.20% | 43.68% | 22.91% |
| نسبة شارب | -0.96 | -0.91 | 0.85 | 0.59 | 0.91 | 0.89 | 0.96 | 0.92 |
| نسبة ترينور | -16.02% | -18.92% | 10.62% | 2.81% | 20.29% | 14.46% | 56.18% | 21.19% |

## بيانات الصندوق

| | |
|---|---|
| عملة الصندوق | ريال سعودي |
| تاريخ التأسيس | 10-Jul-10 |
| نوع الصندوق | صندوق النقد المتداول |
| الرسوم الإداريه (سنويا) | 0.50%من صافي قيمة الأصول |
| إجمالي نسبة المصروفات | 1.00%من صافي قيمة الاصول |
| سعر الوحده عند التأسيس | SAR 20.00000 |
| السعر الحالي | SAR 28.81170 |
| صندوق صافي قيمة الأصول | SAR 11,524,679.00 |
| مؤشر الصندوق | فالكم مؤشر البتروكيماويات |
| مدير الصندوق | فالكم للخدمات المالية |
| الأمين | فالكم للخدمات المالية |
| مقدم المؤشر | تداول (البورصة السعودية) |

## أداء الصندوق مقابل المؤشر

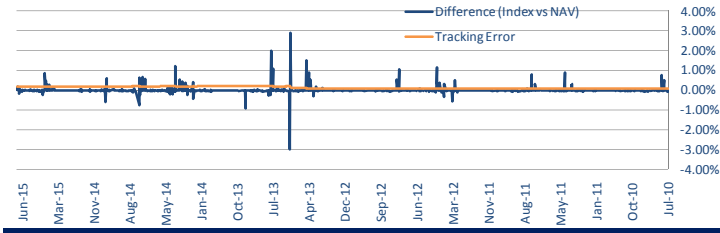



## التحليل الاحصائي

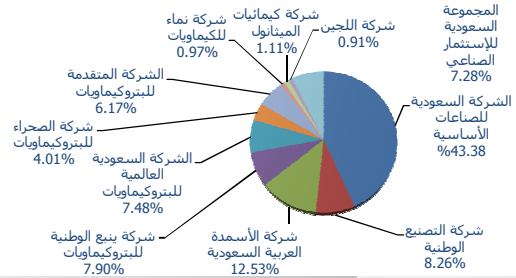
| مقابل المؤشر | سنة | سنتان | سنوات 3 | 4 سنوات | منذ التأسيس |
|---|---|---|---|---|---|
| ألفا | 0.00% | 3.61% | 1.54% | -2.27% | 4.10% |
| بيتا | 0.9960 | 0.9910 | 0.9255 | 0.9632 | 0.7984 |
| معدل تطابق أداء الصندوق مع أداء المؤشر | 99.56% | 98.78% | 90.48% | 89.33% | 74.87% |
| معدل : العوائد فوق أداء المؤشر / تقلبات العوائد | 0.11 | 0.09 | 0.01 | -0.02 | 0.02 |
| معدل أداء الصندوق مع اداء استثمار خالي من المخا | 3.48% | 7.37% | 4.53% | -7.84% | 19.32% |
| معدل تجاوز أداء الصندوق لأداء المؤشر | 50.20% | 53.31% | 52.27% | 49.90% | 51.00% |

تحليل إحصائي على أساس الوسط الهندسي و معامل الانحراف المعياري الهندسي للفترة.

## تتبع معامل الإنحراف

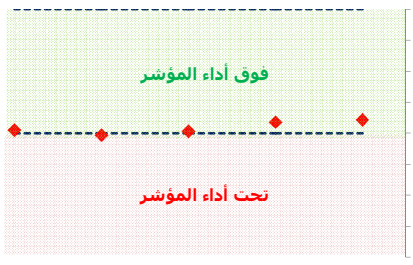



## التوزيع القطاعي



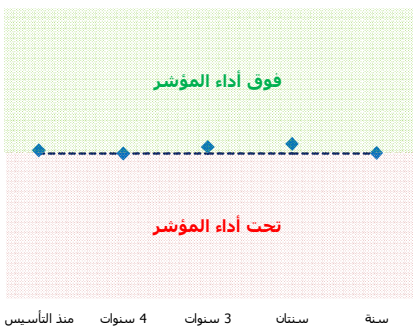

## أداء المدير

### معدل: العوائد فوق أداء المؤشر/تقلبات تلك العوائد




الزيادة في العوائد فوق مستوى المؤشر (قياس المخاطر عن طريق معامل الانحراف)
معدل معلومات أعلى (أكثر من أو يعادل صفر) يعكس مستوى مخاطر محسوبة أفضل

### معدل تجاوز أداء الاستثمار لأداء المؤشر




معدل الفترة التي تجاوز فيها مدير الصندوق اداء المؤشر.
معدل أعلى يعكس تجاوز ثابت فوق أداء المؤشر . بشكل مثالي >50%




لايوجد ضمان بأن الصندوق سيواصل الاستثمار في أوراق مالية بعينها، أو الاستمرار في الاستثمار في قطاعات معينة. محفظة الصندوق قابلة للتغير. الاستثمار في هذا الصندوق ليس وديعة أو التزامات يضمنها مدير الاستثمار. الأداء السابق لا يضمن استمرار نفس النتائج في المستقبل والصندوق معرض لمخاطر اللاستثمار.
الأوراق المالية المدرجة يتم تقويمها بسعر إقفالها، و صفقات المرابحات تقوّم بقيمتها عند التقويم، والاستثمارات الأخرى تقوّم بقيمتها الدفترية عند التقويم