

صندوق فالكم المتداول لقطاع البتروكيماويات ("الصندوق")

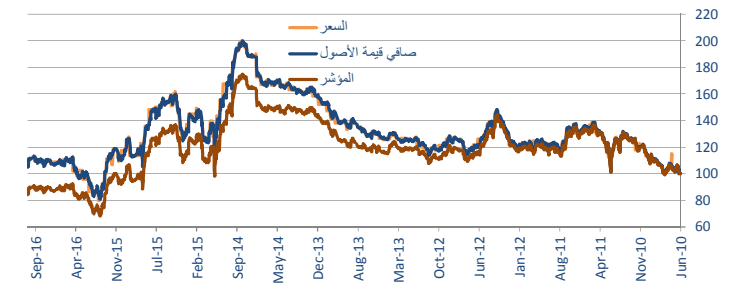
September 29, 2016

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

الأداء	الأجل القصير	شهر	شهور 3	شهور 6	شهور 9
الصندوق	-1.79%	1.00%	10.33%	6.43%	6.43%
المؤشر	-1.79%	-0.31%	5.67%	1.72%	1.72%
تقوم العائد	2016YTD	2015	2014	منذ التأسيس	
الصندوق	6.43%	-21.90%	-18.93%	8.20%	
المؤشر	1.72%	-25.11%	-21.67%	-13.12%	

العوائد المترجمة	سنة	سنتان	سنوات 3	منذ التأسيس
الصندوق	-4.81%	-8.94%	-30.12%	8.20%
المؤشر	-4.81%	-8.94%	-30.12%	8.20%
الإنحراف المعياري	8.66%	13.66%	31.29%	4.98%
نسبة شارب	-0.79	-0.80	-0.75	1.24
نسبة ترينور	-6.89%	-10.94%	-23.51%	7.57%

أداء الصندوق مقابل المؤشر

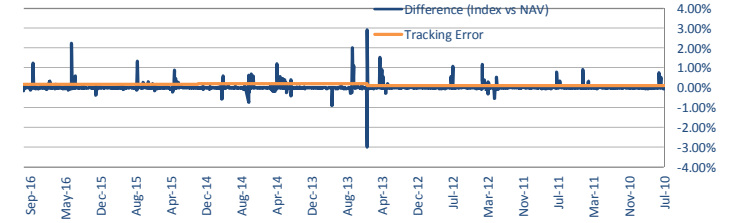


التحليل الإحصائي

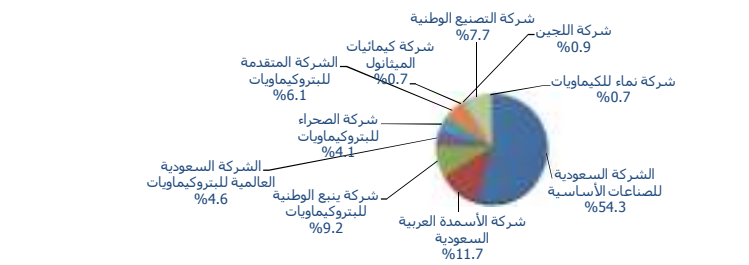
مقابل المؤشر	سنة	سنتان	سنوات 3	سنوات 4	منذ التأسيس
ألفا	0.00%	3.85%	3.80%	1.91%	3.27%
بيتا	0.9873	0.9860	0.9852	0.9466	0.8509
معدل تطابق أداء الصندوق مع أداء المؤشر	98.89%	99.40%	99.21%	94.96%	81.85%
معدل : العوائد فوق أداء المؤشر / تقلبات العوائد	0.10	0.11	0.10	0.02	0.02
معدل أداء الصندوق مع أداء استثمار خالي من المخاطر	4.37%	8.31%	12.00%	7.26%	19.03%
معدل تجاوز أداء الصندوق لأداء المؤشر	52.00%	48.99%	51.61%	51.86%	50.52%

تحليل إحصائي على أساس الوسط الهندسي ومعامل الانحراف المعياري الهندسي للفترة.

تتبع معامل الإنحراف



التوزيع القطاعي



أهداف المحفظة

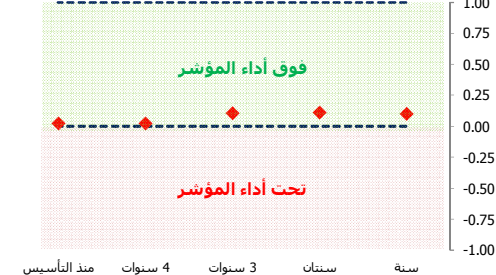
يهدف صندوق فالكم المتداول لقطاع البتروكيماويات لتحقيق مكاسب رأسمالية للمستثمرين و نمو لرأس مالهم على المدى الطويل. يستثمر الصندوق بشكل غير نشط في الأسهم المدرجة لشركات قطاع البتروكيماويات من أجل تحقيق مستوى أداء يتطابق مع أداء مؤشر القياس (مؤشر فالكم لقطاع البتروكيماويات) قبل الرسوم والمصاريف.

بيانات الصندوق

عملة الصندوق	ريال سعودي
تاريخ التأسيس	10-Jul-10
نوع الصندوق	صندوق النقد المتداول
الرسوم الإدارية (سنويا)	0.50% من صافي قيمة الأصول
إجمالي نسبة المصروفات	1.00% من صافي قيمة الأصول
سعر الوحدة عند التأسيس	SAR 20.00000
السعر الحالي	SAR 21.63990
صندوق صافي قيمة الأصول	SAR 6,491,963.00
مؤشر الصندوق	فالكم مؤشر البتروكيماويات
مدير الصندوق	فالكم للخدمات المالية
الأمين	فالكم للخدمات المالية
مقدم المؤشر	تداول (البورصة السعودية)

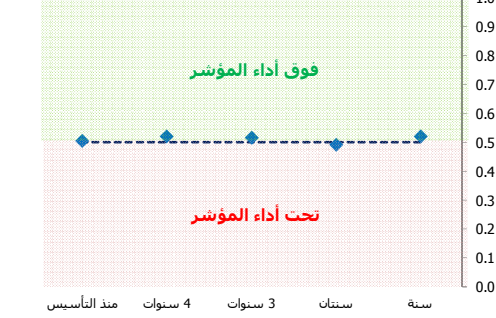
أداء المدير

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 أداء المؤشر. معدل أعلى يمكن تجاوز ثابت فوق أداء المؤشر. بشكل مثالي < 50%