

صندوق فالكم المتداول للأسهم السعودية ("الصندوق")

December 31, 2015

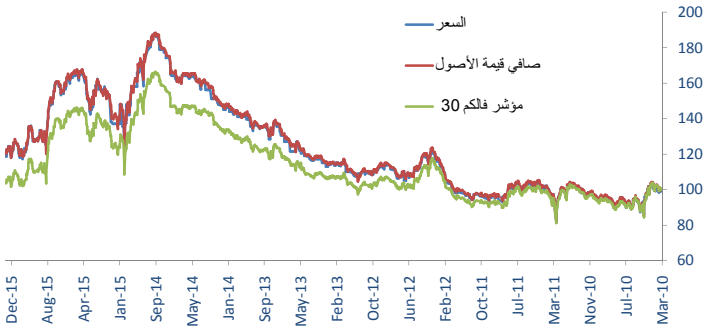
نوع الصندوق	تصنيف الصندوق	التوافق الشرعي	فئة الصندوق	العملة	التطابق الجغرافي
صندوق مؤشرات متداول	التمو		أسهم مدرجة متداولة	الريال السعودي	السوق المحلي

الأداء	الأجل القصير	شهر	شهور 3	شهور 6	شهور 9
الصندوق	-4.91%	-6.24%	-22.87%	-18.79%	-20.46%
المؤشر	-4.97%	-6.39%	-23.74%	-20.46%	-20.46%

تكوين العائد	2015	2014	2013	منذ التأسيس
الصندوق	-14.18%	-2.96%	30.61%	24.66%
المؤشر	-16.39%	-4.95%	26.67%	7.42%

العوائد المتراكمة	سنة	سنوات 3	منذ التأسيس
الصندوق	16.53%	8.86%	24.67%
المؤشر	19.60%	25.83%	7.52%
الانحراف المعياري	0.98	0.77	0.92
نسبة شارب	-0.94	-0.87	0.72
نسبة ترينور	-18.39%	-22.53%	23.08%

أداء الصندوق مقابل المؤشر



أهداف المحفظة

يهدف صندوق فالكم المتداول للأسهم السعودية لتحقيق مكاسب رأسمالية للمستثمرين ونمو لرأس مالمهم على المدى الطويل. يستثمر الصندوق بشكل غير نشط في الأسهم السعودية المدرجة من أجل تحقيق مستوى أداء يتطابق مع أداء مؤشر القياس (مؤشر فالكم 30)، قبل الرسوم والمصاريف.

بيانات الصندوق

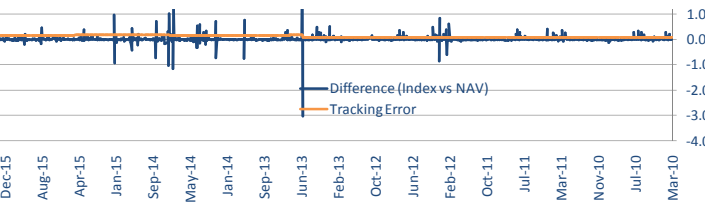
رملة الصندوق	ريال سعودي
تاريخ التأسيس	27-Mar-10
نوع الصندوق	صندوق النقد المتداول
الرسوم الإدارية (سنويا)	0.50% من صافي قيمة الأصول
إجمالي نسبة المصروفات	1.00% من صافي قيمة الأصول
سعر الوجوه عند التأسيس	SAR 20.00000
السعر الحالي	SAR 24.93120
صندوق صافي قيمة الأصول	SAR 22,438,099.00
مؤشر الصندوق	فالكم مؤشر الأسهم السعودية F30
مدير الصندوق	فالكم للخدمات المالية
الأمين	فالكم للخدمات المالية
مقدم المؤشر	تداول (البورصة السعودية)

التحليل الاحصائي

مقابل المؤشر	سنة	سنوات 3	سنوات 4	منذ التأسيس
الفا	0.00%	2.25%	2.71%	2.63%
بيتا	0.9836	0.9737	0.9738	0.9799
معدل تطابق أداء الصندوق مع أداء المؤشر	99.55%	97.17%	97.29%	98.15%
معدل : العوائد فوق أداء المؤشر / تقلبات العوائد	0.10	0.05	0.06	0.07
معدل أداء الصندوق مع أداء استثمار خالي من المخاطر	2.49%	7.93%	11.17%	15.98%
معدل تجاوز أداء الصندوق لأداء المؤشر	36.65%	39.47%	39.56%	39.04%

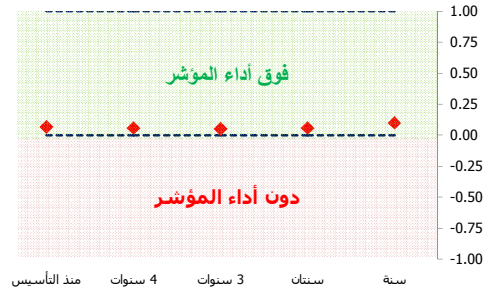
تحليل احصائي على أساس الوسط الهندسي ومعامل الانحراف المعياري الهندسي للفترة

تتبع معامل الانحراف



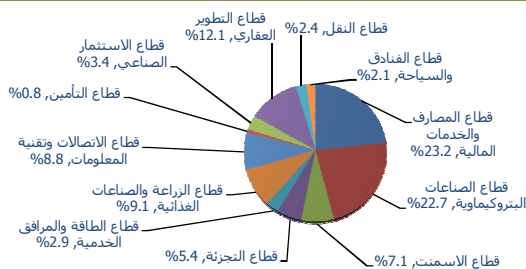
أداء المدير

معدل: العوائد فوق أداء المؤشر/تقلبات تلك العوائد

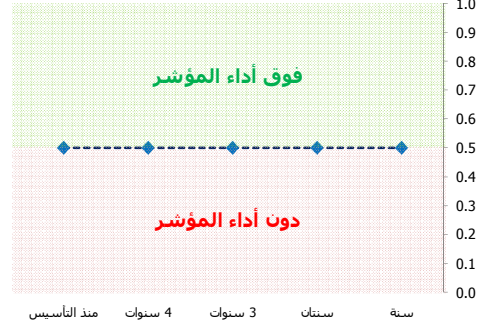


الزيادة في العوائد فوق مستوى المؤشر (قياس المخاطر عن طريق معامل الانحراف) معدل معلومات أعلى (أكثر من أو يعادل صفر) يعكس مستوى مخاطر محسوبة أفضل

التوزيع القطاعي



معدل تجاوز أداء الاستثمار لأداء المؤشر



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

CMA License #: 06020-37 dated 29/04/1427 AH

لمزيد من المعلومات الرجاء الاتصال على 8004298888 أو زيارة الموقع www.falcom.com.sa

لا يوجد ضمان بأن الصندوق سيواصل الاستثمار في أوراق مالية بعينها، أو الاستثمار في القطاعات معينة. محفظة الصندوق قابلة للتغير. الاستثمار في هذا الصندوق ليس وديعة أو التزامات بضمتها مدير الاستثمار. الأداء السابق لا يضمن استمرار نفس النتائج في المستقبل والصندوق معرض لمخاطر الاستثمار. الأوراق المالية المدرجة يتم تقييمها بسعر إقفالها، وصفقات المرايجات تقوّم بقيمتها عند التقييم، والاستثمارات الأخرى تقوّم بقيمتها الدفترية عند التقييم