

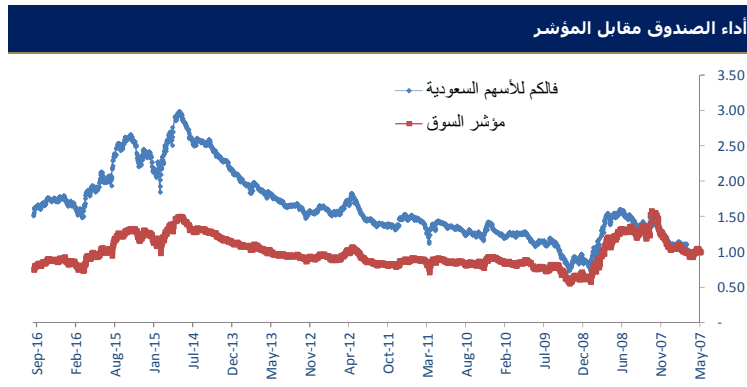
# صندوق فالكم للأسهم السعودية

September 29, 2016



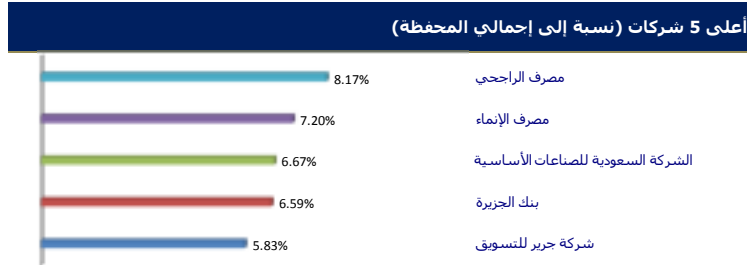
الأداء	الأجل القصير	شهر	شهور 3	شهور 6	شهور 9
الصندوق	-6.35%	-11.84%	-8.06%	-16.74%	-18.64%
المؤشر	-7.50%	-13.49%	-9.64%		
العائد السنوي	2016YTD	2015	2014	منذ التأسيس	
الصندوق	-16.74%	-13.34%	-5.08%	52.90%	
المؤشر	-18.64%	-17.06%	-2.37%	-23.90%	

العوائد المتراكمة	سنة	سنتان	سنوات 3	منذ التأسيس
الصندوق	-23.27%	-47.63%	-21.57%	52.90%
المؤشر	-24.05%	-48.19%	-29.40%	-23.90%
الإنحراف المعياري	31.88%	93.15%	29.13%	50.90%
نسبة شارب	-0.79	-0.53	-0.81	1.00
نسبة ترينور	-26.82%	-52.51%	-25.35%	57.58%



التحليل الاحصائي	سنة	سنتان	سنوات 3	سنوات 4	منذ التأسيس
مقابل المؤشر	0.78%	0.57%	7.83%	15.01%	76.79%
ألفا	0.8583	0.9730	0.9706	0.9740	0.9560
بيتا	94.21%	94.51%	92.98%	92.81%	88.39%
معدل تطابق أداء الصندوق مع أداء المؤشر	-0.01	-0.01	0.03	0.05	0.06
معدل : العوائد فوق أداء المؤشر / تقلبات العوائد	-1.05%	-2.47%	8.49%	16.76%	96.57%
معدل أداء الصندوق مع أداء استثمار خالي من المخاطر	51.20%	49.60%	51.21%	52.56%	52.60%

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



## أهداف المحفظة

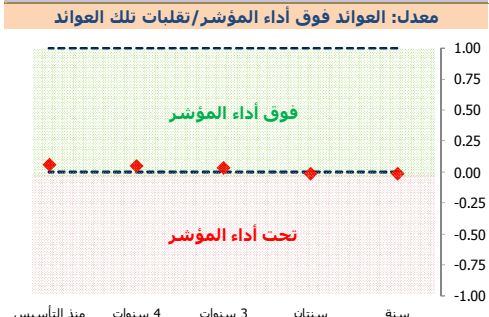
تحقيق مكاسب رأسمالية و نمو على المدى الطويل عن طريق الاستثمار في الأوراق المالية المدرجة في سوق الأسهم السعودية التي تتوافق مع ضوابط الشريعة الإسلامية من خلال مؤشر تداول لكل الأسهم السعودية (TASI).

يسعى فريق إدارة الأصول المتخصص في فالكم إلى تحقيق أداء أفضل من المؤشر الإرشادي للصندوق وذلك عن طريق:  
 (1) التوزيع النشط على مستوى القطاعات  
 (2) الإقتناء النشط للأسهم التي تكون المحفظة الاستثمارية

## بيانات الصندوق

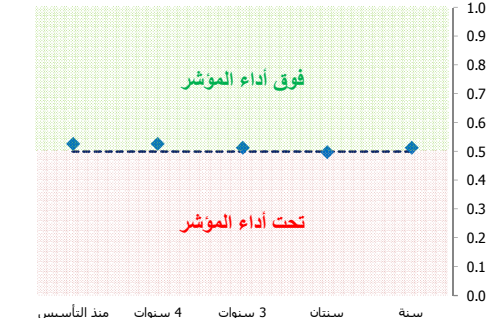
عملة الصندوق	ريال سعودي
تاريخ التأسيس	6-May-07
نوع الصندوق	متوافق مع الشريعة
الرسوم الإدارية (سنويا)	1.75% من صافي قيمة الأصول
رسوم المشاركة	1.50% من قيمة الاشتراك
يوم المشاركة	كل يوم عمل
يوم الاسترداد	كل يوم عمل
يوم التقييم	كل يوم عمل
الحد الأدنى للمشاركة	10,000 ريال
الحد الأدنى للرصيد	10,000 ريال
الحد الأدنى للمشاركة الإضافية	5,000 ريال
سعر الوحدة عند التأسيس	1 ريال
السعر الحالي	SAR 1.52896
صندوق صافي قيمة الأصول	SAR 106,696,811.75
مؤشر الصندوق	مؤشر تداول العام
مدير الصندوق	فالكم للخدمات المالية

## أداء المدير



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 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](http://www.falcom.com.sa)

لا يوجد 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 بضمونها مدير الاستثمار. الأداء السابق لا يضمن استمرار نفس النتائج في المستقبل والصندوق معرض لمخاطر الاستثمار. الأوراق المالية المدرجة يتم تقييمها بسعر إقبالها، و صفقات المراjbات تقوّم بقيمتها عند التقييم، والاستثمارات الأخرى تقوّم بقيمتها الدفترية عند التقييم