

صندوق فالكم للطروحات الأولية

June 30, 2016

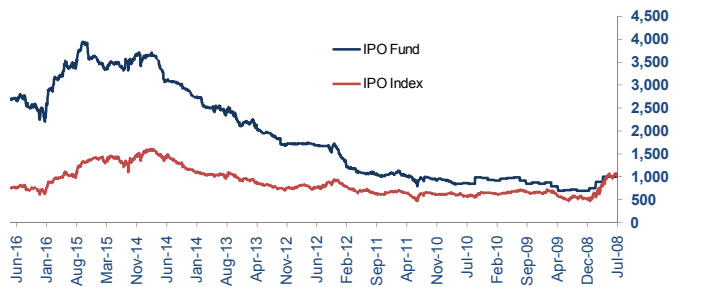
بيته الاستثمار	العملة	فئة الصندوق	متوافق مع الشريعة الإسلامية	حصة الصندوق	المبلغ الأدنى للاشتراك
محلية	الريال السعودي	الأوراق المالية	✓	النمو	10,000 ريال سعودي

الأداء	الأجل القصير	شهر	شهور 3	شهور 6	شهور 9
الصندوق	0.41%	7.26%	-7.31%	-20.44%	-26.37%
المؤشر	-0.34%	6.74%	-14.62%	-20.44%	-26.37%

العائد السنوي	2016YTD	2015	2014	منذ التأسيس
الصندوق	-7.31%	-13.65%	24.71%	169.67%
المؤشر	-14.62%	-29.02%	17.06%	-27.91%

العوائد المتراكمة	سنة	سنتان	سنوات 3	منذ التأسيس
الصندوق	-30.80%	-43.15%	-17.68%	-27.91%
المؤشر	74.80%	16.85%	27.29%	169.67%
الانحراف المعياري	44.10%	78.74%	27.49%	39.96%
نسبة شارپ	-0.74	-0.60	0.92	0.99
نسبة ترينور	-36.05%	-45.15%	-46.35%	-30.85%

أداء الصندوق



أهداف المحفظة

يهدف الصندوق إلى تنمية رأس المال على المدى الطويل وذلك من خلال الاستثمار بشكل رئيس في أسهم الشركات العامة خلال فترة الطرح الأولى العام لأسهمها، و/أو في أسهم الشركات الجديدة المدرجة التي لم يمض ثلاث سنوات على إدراجها في سوق الأسهم السعودي.

بيانات الصندوق

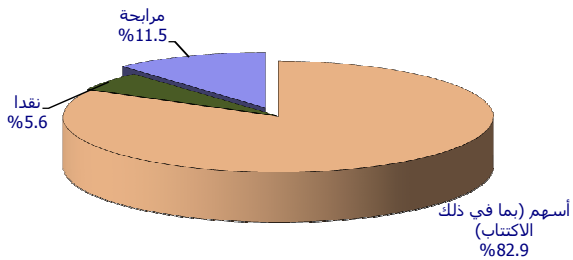
عمله الصندوق	ريال سعودي
تاريخ التأسيس	12-Jul-08
نوع الصندوق	متوافق مع الشريعة
رسوم الإدارة (سنويا)	1.75% من صافي قيمة الأصول
رسوم المشاركة	1.5% من صافي قيمة الأصول
رسوم الاسترداد	AMT* من استرداد (0.5% - 1%)
رسوم التدقيق	23,000 ريال سعودي في السنة
رسوم الاستشارات الشرعية	0.25% من صافي قيمة الأصول
يوم التقييم	اسبوعيا (كل اثنين)
الحد الأدنى لدخول الأفراد	SAR 10,000
الحد الأدنى لدخول المؤسسات	SAR 100,000
سعر الوحدة عند التأسيس	SAR 1,000.00
السعر الحالي	SAR 2,696.68
صندوق صافي قيمة الأصول	SAR 175,833,496.56
مدير الصندوق	فالكم للخدمات المالية

التحليل الإحصائي

مقابل المؤشر	سنة	سنتان	سنوات 3	سنوات 4	منذ التأسيس
ألفا	0.11%	7.59%	11.20%	11.66%	14.71%
بيتا	0.6688	0.5491	0.5478	0.5282	0.3221
معدل تطابق أداء الصندوق مع أداء المؤشر	90.99%	77.25%	73.80%	66.47%	19.23%
معدل : العوائد فوق أداء المؤشر / تقلبات العوائد	0.08	0.08	0.07	0.05	0.05
معدل أداء الصندوق مع أداء استثمار خالي من المخاطر	12.89%	28.70%	40.46%	54.26%	183.51%
معدل تجاوز أداء الصندوق لأداء المؤشر	45.06%	47.41%	49.73%	49.65%	50.45%

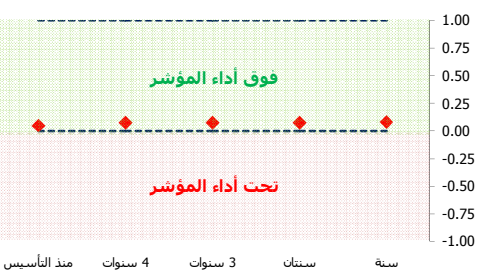
تحليل إحصائي على أساس الوسط الهندسي ومعامل الانحراف المعياري الهندسي للفترة

توزيع الأصول



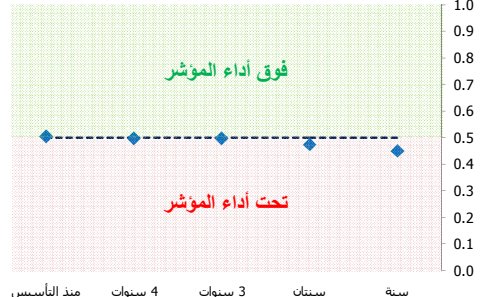
أداء المدير

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 يعكس تجاوز ثابت فوق أداء المؤشر. بشكل مثالي >50%