

صندوق فالكم المتداول للأسهم السعودية ("الصندوق")

December 31, 2014

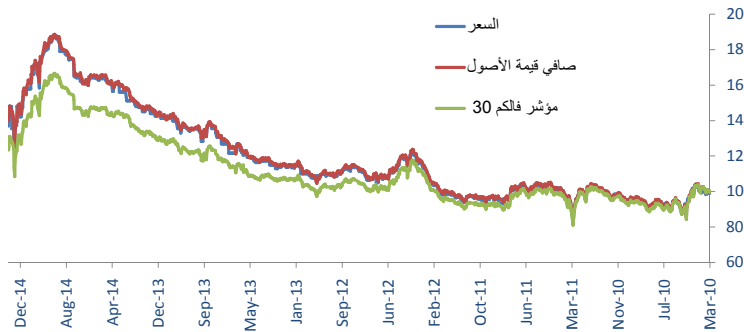
نوع الصندوق	تصنيف الصندوق	التوافق الشرعي	فئة الصندوق	العملة	النطاق الجغرافي
صندوق مؤشرات متداول	النمو		أسهم مدرجة متداولة	الريال السعودي	السوق المحلي

الأداء	الأجل القصير	شهر	3 شهور	6 شهور	9 شهور
الصندوق	-2.62%	-23.76%	-13.07%	-12.75%	-14.25%
المؤشر	-2.58%	-23.81%	-13.74%	-12.75%	-14.25%

تقويم العائد	2014	2013	2012	منذ التأسيس
الصندوق	-2.96%	30.61%	10.74%	45.25%
المؤشر	-5.07%	26.67%	7.70%	28.31%

العوائد المتراكمة	سنة		سنتان		3 سنوات		منذ التأسيس
	الصندوق	المؤشر	الصندوق	المؤشر	الصندوق	المؤشر	الصندوق
	-2.96%	-5.07%	26.75%	20.25%	40.36%	29.50%	45.25%
الانحراف المعياري	3.33%	5.50%	26.72%	20.24%	40.31%	29.48%	45.22%
نسبة شارب	-1.49	-1.29	0.93	0.90	0.95	0.93	0.96
نسبة ترينور	-5.06%	-7.07%	26.08%	18.25%	40.12%	27.50%	44.31%

أداء الصندوق مقابل المؤشر

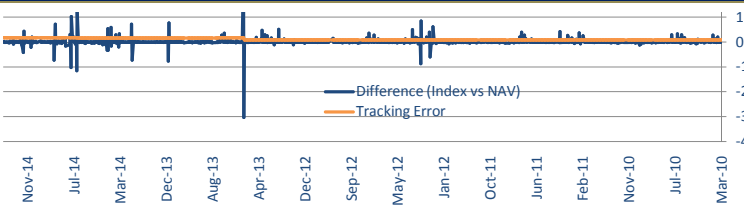


التحليل الاحصائي

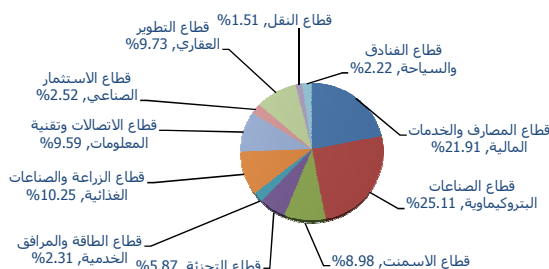
مقابل المؤشر	سنة	سنتان	3 سنوات	4 سنوات	منذ التأسيس
الفا	0.00%	3.02%	3.01%	2.86%	2.75%
بيتا	0.9990	0.9636	0.9659	0.9749	0.9782
معدل تطابق أداء الصندوق مع أداء المؤشر	97.89%	94.89%	95.60%	97.04%	97.60%
معدل : العوائد فوق أداء المؤشر / تقلبات العوائد	0.04	0.05	0.06	0.06	0.06
معدل أداء الصندوق مع أداء استثمار خالي من المخاطرة	2.16%	6.34%	9.53%	11.96%	13.65%
معدل تجاوز أداء الصندوق لأداء المؤشر	46.40%	43.29%	42.53%	42.38%	41.99%

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

تتبع معامل الانحراف



التوزيع القطاعي



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 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 الاستثمار. الأوراق المالية المدرجة يتم تقييمها بسعر إقفالها، وصفقات المراجعات تقوم بقيمتها عند التقويم، والاستثمارات الأخرى تقوم بقيمتها الدفترية عند التقويم

أهداف المحفظة

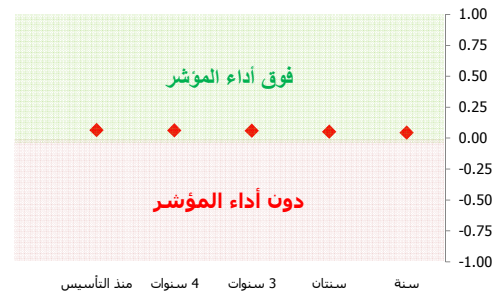
يهدف صندوق فالكم المتداول للأسهم السعودية لتحقيق مكاسب رأسمالية للمستثمرين و نمو لرأس مالهم على المدى الطويل. يستثمر الصندوق بشكل غير نشط في الأسهم السعودية المدرجة من أجل تحقيق مستوى أداء يتطابق مع أداء مؤشر القياس (مؤشر فالكم 30)، قبل الرسوم والمصاريف.

بيانات الصندوق

عملية الصندوق	ريال سعودي
تاريخ التأسيس	27-Mar-10
نوع الصندوق	صندوق النقد المتداول
الرسوم الإدارية (سنوي)	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 29.04920
صندوق صافي قيمة الأصول	SAR 26,870,515.00
مؤشر الصندوق	فالكم مؤشر الأسهم السعودية F30
مدير الصندوق	فالكم للخدمات المالية
الأمين	فالكم للخدمات المالية
مقدم المؤشر	تداول (البورصة السعودية)

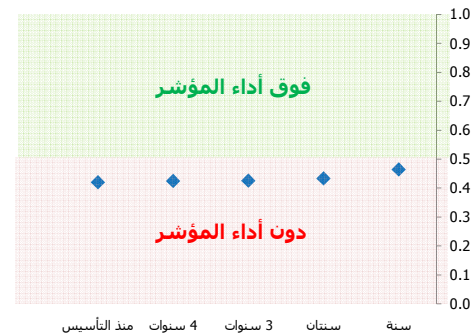
أداء المدير

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