

صندوق فالكم المتداول للأسهم السعودية ("الصندوق")

September 29, 2016

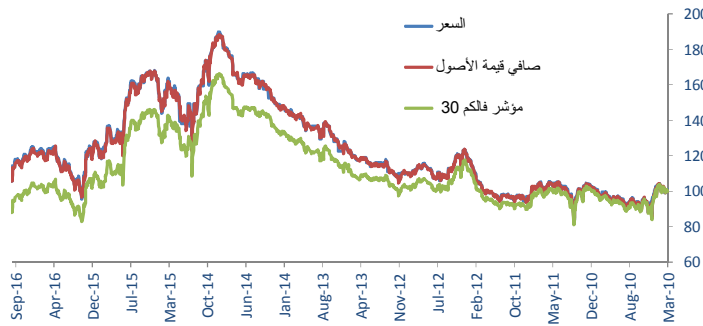
نوع الصندوق صندوق مؤشرات متداول	تصنيف الصندوق التمو	التوافق الشرعي ✓	فئة الصندوق أسهم مدرجة متداولة	العملة الريال السعودي	النطاق الجغرافي السوق المحلي
------------------------------------	------------------------	---------------------	-----------------------------------	--------------------------	---------------------------------

الأداء	الأجل القصير	شهر	شهور 3	شهور 6	شهور 9
الصندوق	-6.97%	-11.02%	-4.12%	-10.42%	-13.25%
المؤشر	-7.23%	-12.05%	-6.44%	-10.42%	-13.25%

تقديم العائد	2016YTD	2015	2014	منذ التأسيس
الصندوق	-10.42%	-14.18%	-2.96%	11.67%
المؤشر	-13.25%	-16.39%	-4.95%	-6.81%

العوائد المترجمة	سنة	سنتان	سنوات 3	منذ التأسيس
الصندوق	-16.01%	-41.39%	-20.36%	11.67%
المؤشر	-18.79%	-44.66%	-26.35%	-6.81%
الإحراق المعياري	21.01%	73.29%	27.65%	9.92%
نسبة شارب	-0.86	-0.59	-0.81	0.97
نسبة ترينور	-18.05%	-20.79%	-22.60%	9.82%

أداء الصندوق مقابل المؤشر

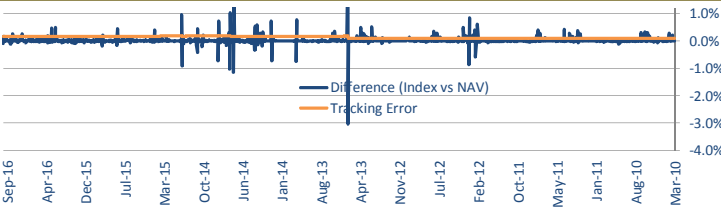


التحليل الإحصائي

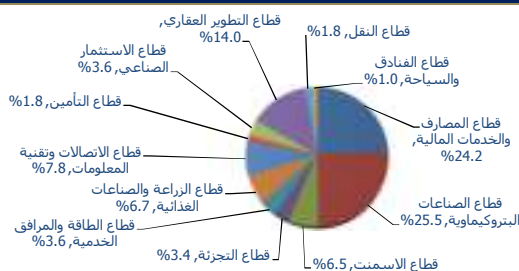
مقابل المؤشر	سنة	سنتان	سنوات 3	سنوات 4	منذ التأسيس
الفا	0.00%	2.44%	2.49%	2.67%	2.78%
بيتا	0.9754	0.9852	0.9860	0.9740	0.9789
معدل تطابق أداء الصندوق مع أداء المؤشر	99.79%	99.68%	98.95%	97.79%	98.37%
معدل : العوائد فوق أداء المؤشر / تقلبات تلك العوائد	0.19	0.12	0.07	0.06	0.07
معدل أداء الصندوق مع أداء استثمار خالي من المخاطر	3.27%	5.54%	7.66%	10.98%	19.36%
معدل تجاوز أداء الصندوق لأداء المؤشر	38.40%	41.94%	42.90%	41.71%	41.21%

تخطيط إحصائي على أساس الوسط الهندسي ومعامل الإحراق المعياري الهندسي للفترة

تتبع معامل الإحراق



التوزيع القطاعي



أهداف المحفظة

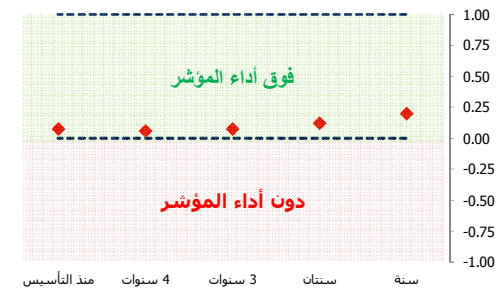
يهدف صندوق فالكم المتداول للأسهم السعودية لتحقيق مكاسب رأسمالية للمستثمرين و نمو لرأس مالهم على المدى الطويل. يستثمر الصندوق بشكل غير نشط في الأسهم السعودية المدرجة من أجل تحقيق مستوى أداء يتطابق مع أداء مؤشر القياس (مؤشر فالكم 30)، قبل الرسوم والمصاريف.

بيانات الصندوق

عملة 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 22.33300
صندوق صافي قيمة الأصول	SAR 19,541,334.00
مؤشر الصندوق	فالكم مؤشر الأسهم السعودية F30
مدير الصندوق	فالكم للخدمات المالية
الأمين	فالكم للخدمات المالية
مقدم المؤشر	تداول (البورصة السعودية)

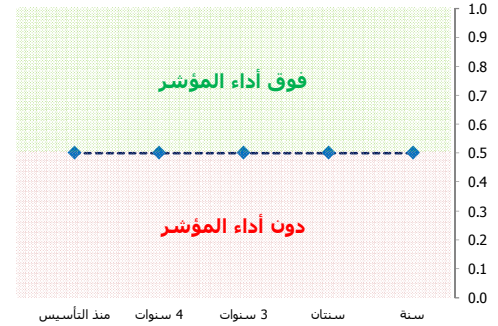
أداء المدير

معدل: العوائد فوق أداء المؤشر/تقلبات تلك العوائد



الزيادة في العوائد فوق مستوى المؤشر (قياس المخاطر عن طريق معامل الإحراق) معدل معلومات أعلى (أكثر من أو يعادل صفراً) 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

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 بضمنها مدير الاستثمار. الأداء السابق لا يضمن استمرار نفس النتائج في المستقبل والصندوق والصندوق معرض لمخاطر الاستثمار. الأوراق المالية المدرجة يتم تقييمها بسعر إقفالها، و صفقات المرايا تقوم بقيمتها عند التقييم، والاستثمارات الأخرى تقوم بقيمتها الدفترية عند التقييم