

صندوق فالكم المتداول لقطاع البتروكيماويات ("الصندوق")

March 31, 2016

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

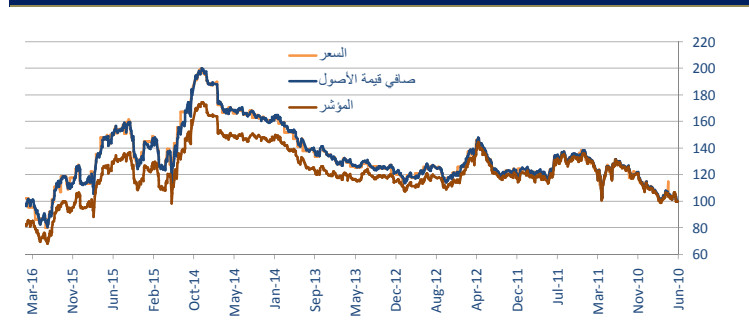
الأداء		الأجل القصير		شهر		شهر 3		شهر 6		شهر 9	
الصندوق	المؤشر	4.22%	3.55%	-3.54%	-3.73%	-13.73%	-13.82%	-31.93%	-33.26%		
تقوم العائد	الصندوق	2016YTD	2015	2014	منذ التأسيس						
الصندوق	المؤشر	-3.54%	-25.11%	-18.93%	-17.78%						
العوائد المتراكمة	الصندوق	سنة	سنتان	سنوات 3	منذ التأسيس						
الإحتراف المعياري	المؤشر	-22.77%	-25.79%	-41.40%	-45.37%						
نسبة شارب	الصندوق	29.48%	33.91%	70.57%	81.82%						
نسبة ترينور	المؤشر	-0.84	-0.82	-0.61	-0.58						

أهداف المحفظة

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

بيانات الصندوق

أداء الصندوق مقابل المؤشر



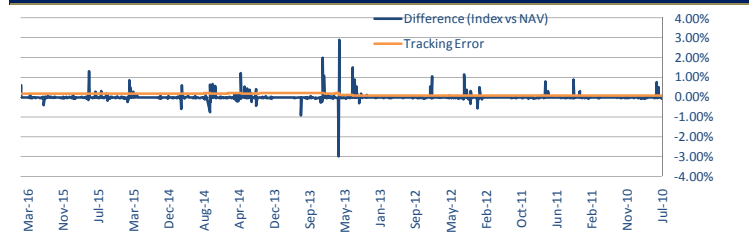
عملة الصندوق	ريال سعودي
تاريخ التأسيس	10-Jul-10
نوع الصندوق	صندوق النقد المتداول
الرسوم الإدارية (سنويا)	0.50% من صافي قيمة الأصول
إجمالي نسبة المصروفات	1.00% من صافي قيمة الأصول
سعر الوحدة عند التأسيس	SAR 20.00000
السعر الحالي	SAR 19.61320
صندوق صافي قيمة الأصول	SAR 5,883,963.00
مؤشر الصندوق	فالكم مؤشر البتروكيماويات
مدير الصندوق	فالكم للخدمات المالية
الأمين	فالكم للخدمات المالية
مقدم المؤشر	تداول (البورصة السعودية)

التحليل الاحصائي

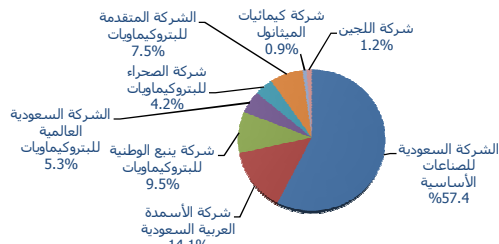
مقابل المؤشر	سنة	سنتان	سنوات 3	سنوات 4	منذ التأسيس
ألفا	0.00%	3.08%	3.74%	-0.39%	2.61%
بيتا	0.9797	0.9870	0.9761	0.9524	0.8443
معدل تطابق أداء الصندوق مع أداء المؤشر	99.64%	99.53%	98.16%	94.08%	81.06%
معدل : العوائد فوق أداء المؤشر / تقلبات العوائد	0.12	0.10	0.07	-0.01	0.01
معدل أداء الصندوق مع أداء استثمار خالي من المخاطر	3.76%	6.75%	11.77%	-2.50%	12.97%
معدل تجاوز أداء الصندوق لأداء المؤشر	48.62%	48.80%	51.26%	49.85%	50.17%

تحليل إحصائي على أساس الوسط الهندسي ومعامل الإحتراف المعياري الهندسي للفترة

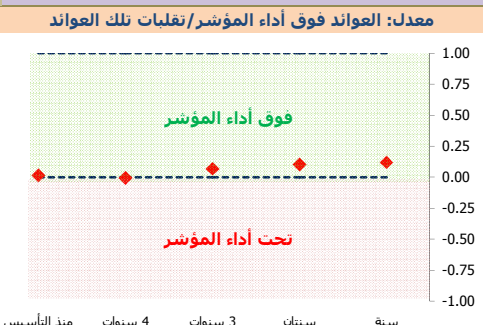
تتبع معامل الإحتراف



التوزيع القطاعي

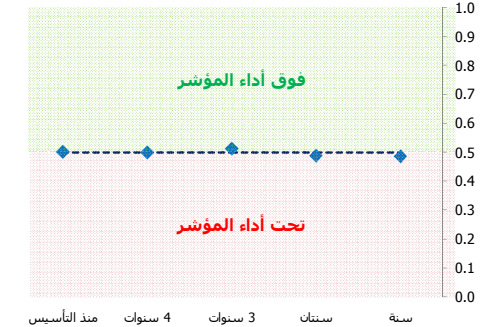


أداء المدير



الزيادة في العوائد فوق مستوى المؤشر (قياس المخاطر عن طريق معامل الإحتراف) 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 فرق أداء المؤشر. بشكل مثالي < 50%