

صندوق فالكم للأسهم السعودية

December 31, 2015

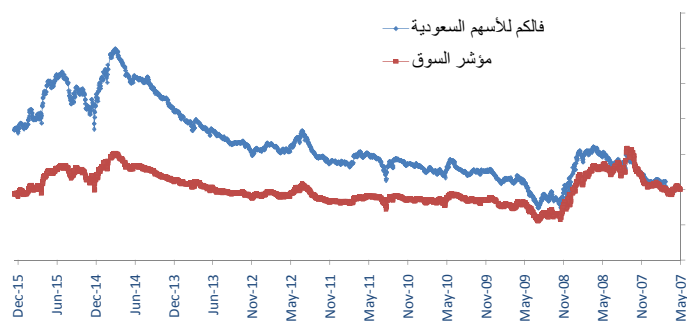
بيئة الاستثمار	العملة	قوة الصندوق	متوافق مع الشريعة الإسلامية	حصة الصندوق	البيانات الإدارية
محلية	الريال السعودي	الأوراق المالية	✓	النمو	16,000 ريال سعودي

الأداء	الأجل القصير	شهر	3 شهور	6 شهور	9 شهور
الصندوق	-4.77%	-7.84%	-25.82%	-18.49%	-21.27%
المؤشر	-4.53%	-6.65%	-23.94%	-18.49%	-21.27%

العائد السنوي	2013	2014	2015	منذ التأسيس
الصندوق	39.07%	-5.08%	-13.34%	83.63%
المؤشر	25.50%	-2.37%	-17.06%	-6.46%

العوائد المتراكمة	سنة	سنتان	3 سنوات	منذ التأسيس
الصندوق	-13.34%	-17.06%	-17.74%	-6.46%
المؤشر	-13.34%	-17.06%	-19.02%	-6.46%
الانحراف المعياري	15.41%	20.54%	21.58%	83.61%
نسبة شارب	-1.00	-0.93	-0.91	0.98
نسبة ترينور	-16.41%	-19.06%	-21.08%	92.61%

أداء الصندوق مقابل المؤشر

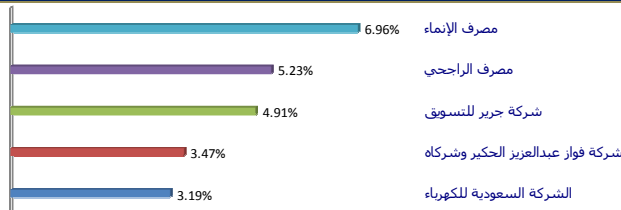


التحليل الاحصائي

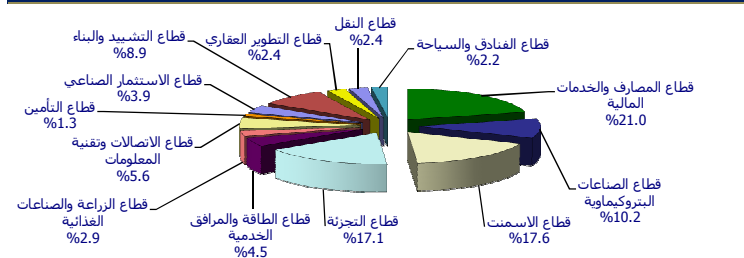
مقابل المؤشر	سنة	سنتان	3 سنوات	4 سنوات	منذ التأسيس
ألفا	3.72%	1.29%	12.78%	17.52%	90.09%
بيتا	0.9676	1.0174	1.0177	1.0202	0.9649
معدل تطابق أداء الصندوق مع أداء المؤشر	93.48%	93.60%	93.17%	92.06%	88.14%
معدل : العوائد فوق أداء المؤشر / تقلبات العوائد	0.03	0.00	0.05	0.05	0.06
معدل أداء الصندوق مع أداء استثمار خالي من المخاطر	3.22%	0.67%	13.29%	17.75%	94.44%
معدل تجاوز أداء الصندوق لأداء المؤشر	51.00%	49.10%	52.80%	52.25%	52.64%

تحليل احصائي على أساس الوسط الهندسي و معامل الانحراف المعياري الهندسي للفترة.

أعلى 5 شركات (نسبة إلى إجمالي المحفظة)



التوزيع القطاعي



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 الاستمرار في الاستثمار في قطاعات 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 معرض لمخاطر الاستثمار.

الأوراق المالية المدرجة يتم تقييمها بسعر إقفالها، و صفقات المرايجات تقوم بقيمتها عند التقييم، والاستثمارات الأخرى تقوم بقيمتها الدفترية عند التقييم

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).

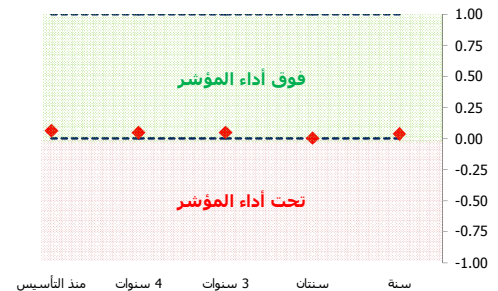
يسعى فريق إدارة الأصول المتخصص في فالكم إلى تحقيق أداء أفضل من المؤشر الإرشادي للصندوق وذلك عن طريق:
 (1) التوزيع النشط على مستوى القطاعات
 (2) الإقتناء النشط للأسهم التي تكون المحفظة الاستثمارية

بيانات الصندوق

ريال سعودي	عملة الصندوق
6-May-07	تاريخ التأسيس
متوافق مع الشريعة	نوع الصندوق
1.75% من صافي قيمة الأصول	الرسوم الإدارية (سنويا)
1.50% من قيمة الاشتراك	رسوم المشاركة
كل يوم عمل	يوم المشاركة
كل يوم عمل	يوم الاسترداد
كل يوم عمل	يوم التقييم
10,000 ريال	الحد الأدنى للمشاركة
10,000 ريال	الحد الأدنى للرصيد
5,000 ريال	الحد الأدنى للمشاركة الإضافية
1 ريال	سعر الوحدة عند التأسيس
SAR 1.83630	السعر الحالي
SAR 143,504,906.35	صندوق صافي قيمة الأصول
مؤشر تداول العام	مؤشر الصندوق
فالكم للخدمات المالية	مدير الصندوق

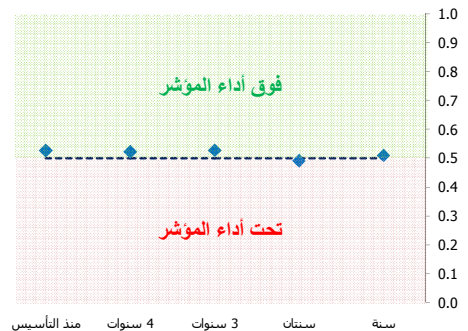
أداء المدير

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%