

# صندوق فالكم للأسهم السعودية

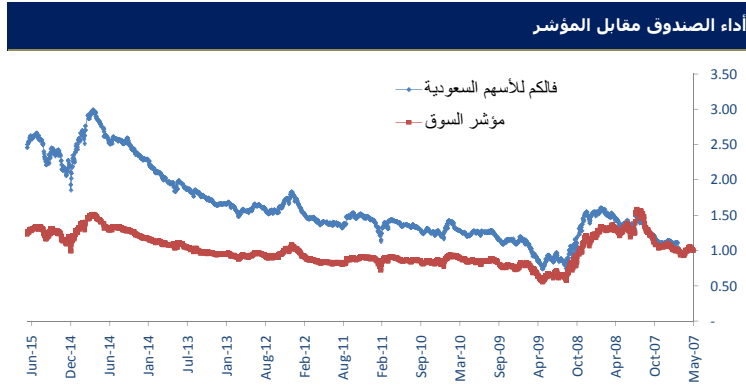
June 30, 2015

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

الأداء	الأجل القصير	شهر	3 شهور	6 شهور	9 شهور
الصندوق	-4.88%	9.89%	9.89%	16.83%	-15.20%
المؤشر	-6.21%	3.51%	3.51%	9.04%	-16.29%

العائد السنوي	2015YTD	2014	2013	منذ التأسيس
الصندوق	16.83%	-5.08%	39.07%	147.55%
المؤشر	9.04%	-2.37%	25.50%	22.97%

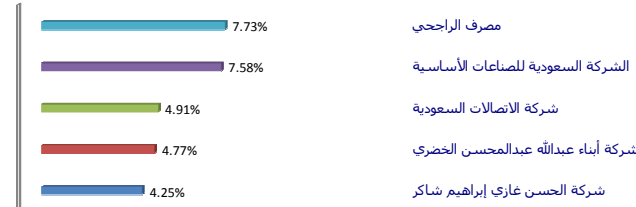
العوائد المتراكمة	سنة	سنتان	سنوات 3	منذ التأسيس
الصندوق	-1.86%	36.04%	60.16%	147.55%
المؤشر	-4.48%	21.21%	35.42%	22.97%
الانحراف المعياري	3.20%	34.91%	58.80%	145.36%
نسبة شارب	-1.21	0.98	0.99	1.00
نسبة ترينور	-4.05%	36.72%	63.16%	166.16%



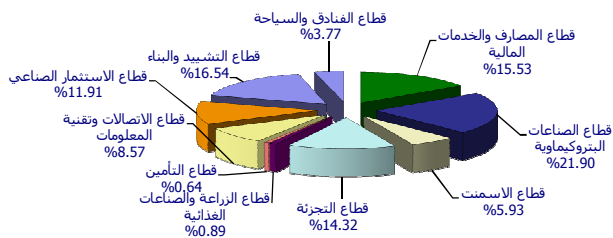
التحليل الاحصائي	مقابل المؤشر	سنة	سنتان	سنوات 3	4 سنوات	منذ التأسيس
ألفا	2.62%	14.83%	24.73%	26.17%	124.58%	
بيتا	1.0765	1.0594	1.0501	1.0607	0.9673	
معدل تطابق أداء الصندوق مع أداء المؤشر	95.33%	92.69%	92.08%	91.30%	87.60%	
معدل : العوائد فوق أداء المؤشر / تقلبات العوائد	0.03	0.07	0.08	0.06	0.07	
معدل أداء الصندوق مع أداء استثمار خالي من المخاطر	3.09%	14.51%	21.92%	23.49%	101.43%	
معدل تجاوز أداء الصندوق لأداء المؤشر	50.60%	53.71%	54.41%	52.61%	53.17%	

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

## أعلى 5 شركات (نسبة إلى إجمالي المحفظة)



## التوزيع القطاعي



## 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).

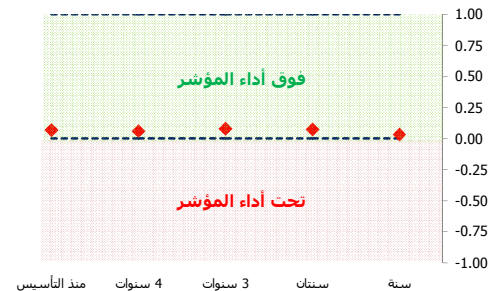
يسعى فريق إدارة الأصول المتخصص في فالكم إلى تحقيق أداء أفضل من المؤشر الإرشادي للصندوق وذلك عن طريق:  
 (1) التوزيع النشط على مستوى القطاعات  
 (2) الإقتناء النشط للأسهم التي تكون المحفظة الاستثمارية

## بيانات الصندوق

عملة الصندوق	ريال سعودي
تاريخ التأسيس	6-May-07
نوع الصندوق	متوافق مع الشريعة
الرسوم الإدارية (سنويا)	1.75% من صافي قيمة الأصول
رسوم المشاركة	1.50% من قيمة الاشتراك
يوم المشاركة	كل يوم عمل
يوم الاسترداد	كل يوم عمل
يوم التقييم	كل يوم عمل
الحد الأدنى للمشاركة	10,000 ريال
الحد الأدنى للرصيد	10,000 ريال
الحد الأدنى للمشاركة الإضافية	5,000 ريال
سعر الوحدة عند التأسيس	1 ريال
السعر الحالي	SAR 2.47552
صندوق صافي قيمة الأصول	SAR 193,388,449.38
مؤشر الصندوق	مؤشر تداول العام
مدير الصندوق	فالكم للخدمات المالية

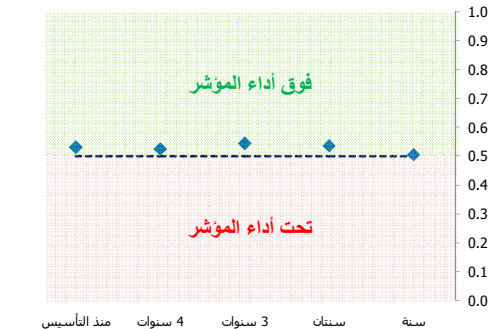
## أداء المدير

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

CMA License # : 06020-37 dated 29/04/1427 AH

لمزيد من المعلومات الرجاء الاتصال على 8004298888 أو زيارة الموقع [www.falcom.com.sa](http://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 المراجعات تقوم بقيمتها عند التقويم، والاستثمارات الأخرى تقوم بقيمتها الدفترية عند التقويم