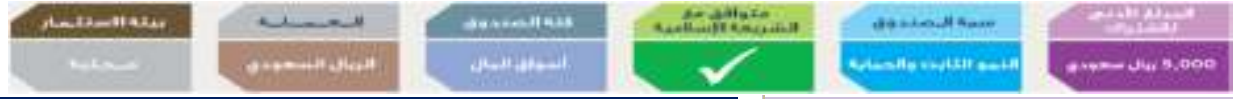


صندوق فالكم للمرابحة بالريال السعودي

September 29, 2016



| الأداء | | | | | | | |
|------------------------|------------------------|------------------------|------------------------|------------------------|------------------------|------------------------|------------------------|
| الأجل القصير | | | | | | | |
| شهر | شهر | شهر | شهر | شهر | شهر | شهر | شهر |
| صافي قيمة أصول الصندوق | صافي قيمة أصول الصندوق | صافي قيمة أصول الصندوق | صافي قيمة أصول الصندوق | صافي قيمة أصول الصندوق | صافي قيمة أصول الصندوق | صافي قيمة أصول الصندوق | صافي قيمة أصول الصندوق |
| 2.89000% | 2.85000% | 2.47000% | 1.41% | 1.95% | 1.71000% | 1.42375% | 1.71000% |
| مؤشر سايد 3 شهور | مؤشر سايد 3 شهور | مؤشر سايد 3 شهور | مؤشر سايد 3 شهور | مؤشر سايد 3 شهور | مؤشر سايد 3 شهور | مؤشر سايد 3 شهور | مؤشر سايد 3 شهور |
| 2.20700% | 2.09773% | 1.67833% | 0.71% | 1.25% | 1.42375% | 1.42375% | 1.42375% |
| تقويم العائد | | | | | | | |
| شهر | شهر | شهر | شهر | شهر | شهر | شهر | شهر |
| صافي قيمة أصول الصندوق | صافي قيمة أصول الصندوق | صافي قيمة أصول الصندوق | صافي قيمة أصول الصندوق | صافي قيمة أصول الصندوق | صافي قيمة أصول الصندوق | صافي قيمة أصول الصندوق | صافي قيمة أصول الصندوق |
| 3.08000% | 3.08000% | 1.03000% | 1.55% | 1.63% | 5.52000% | 3.96000% | 1.71000% |
| مؤشر سايد 3 شهور | مؤشر سايد 3 شهور | مؤشر سايد 3 شهور | مؤشر سايد 3 شهور | مؤشر سايد 3 شهور | مؤشر سايد 3 شهور | مؤشر سايد 3 شهور | مؤشر سايد 3 شهور |
| 2.23000% | 1.43250% | 0.73250% | 1.25% | 1.63% | 5.52000% | 3.96000% | 1.71000% |
| سنة | | | | | | | |
| صافي قيمة أصول الصندوق | صافي قيمة أصول الصندوق | صافي قيمة أصول الصندوق | صافي قيمة أصول الصندوق | صافي قيمة أصول الصندوق | صافي قيمة أصول الصندوق | صافي قيمة أصول الصندوق | صافي قيمة أصول الصندوق |
| 2.33% | 2.33% | 1.70% | 3.58% | 2.43% | 5.24% | 3.29% | 12.39% |
| مؤشر سايد 3 شهور | مؤشر سايد 3 شهور | مؤشر سايد 3 شهور | مؤشر سايد 3 شهور | مؤشر سايد 3 شهور | مؤشر سايد 3 شهور | مؤشر سايد 3 شهور | مؤشر سايد 3 شهور |
| 2.31% | 1.68% | 3.57% | 2.41% | 5.23% | 3.28% | 16.01% | 12.37% |
| نسبة شارب | | | | | | | |
| 0.14 | -0.18 | 0.44 | 0.18 | 0.62 | 0.39 | 0.88 | 0.84 |
| نسبة ترينور | | | | | | | |
| 0.00 | 0.00 | 0.02 | 0.00 | 0.03 | 0.01 | 0.18 | 0.10 |

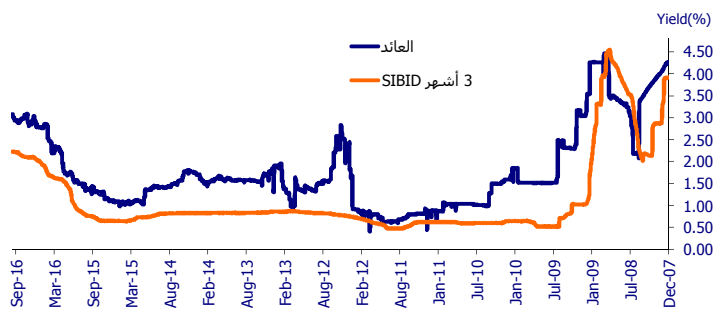
أهداف المحفظة

يسعى صندوق فالكم للمرابحة بالريال السعودي لتحقيق دخل جاري و سيولة تتوافق مع معدلات أسواق النقد على المدى القصير و المحافظة على قيمة الاستثمار. يوفر الصندوق للمستثمرين حلول استثمارية تتوافق مع الضوابط الشرعية و تحقق للمستثمرين عوائد منافسة من خلال الاستثمار في صفقات المراجحة قصيرة الأجل من أجل تحقيق درجة عالية من المحافظة على رأس المال و السيولة دون مخاطر صرف للعملة.

بيانات الصندوق

| | |
|---------------------------|-------------------------------|
| ريال سعودي | عملة الصندوق |
| 29-Aug-07 | تاريخ التأسيس |
| متوافق مع الشريعة | نوع الصندوق |
| 0.50% من صافي قيمة الأصول | الرسوم الإدارية (سنويا) |
| لا يوجد | رسوم المشاركة |
| كل يوم عمل | يوم المشاركة |
| كل يوم عمل | يوم الاسترداد |
| كل يوم عمل | يوم التقييم |
| SAR 5,000 | الحد الأدنى للمشاركة |
| SAR 2,000 | الحد الأدنى للرصيد |
| SAR 2,000 | الحد الأدنى للمشاركة الإضافية |
| SAR 1.00 | سعر الوحدة عند التأسيس |
| SAR 1.160298 | السعر الحالي |
| SAR 586,479,577.92 | صندوق صافي قيمة الأصول |
| شهور 3 | مؤشر الصندوق |
| فالكم للخدمات المالية | مدير الصندوق |

أداء الصندوق مقابل المؤشر



التحليل الاحصائي

| مقابل المؤشر | سنة | سنتان | سنوات 3 | سنوات 4 | منذ التأسيس |
|---|--------|--------|---------|---------|-------------|
| ألفا | 0.11% | 0.18% | 0.24% | 0.23% | 0.51% |
| بيتا | 1.30 | 1.32 | 1.36 | 1.38 | 0.88 |
| معدل تطابق أداء الصندوق مع أداء المؤشر | 98.08% | 96.96% | 95.04% | 93.93% | 76.39% |
| معدل : العوائد فوق أداء المؤشر / تقلبات العوائد | 1.11 | 1.12 | 1.19 | 1.19 | 0.57 |
| معدل أداء الصندوق مع أداء استثمار خالي من المخاطر | 0.65% | 1.20% | 2.05% | 2.75% | 4.67% |
| معدل تجاوز أداء الصندوق لأداء المؤشر | 97.60% | 98.79% | 99.20% | 99.40% | 80.68% |

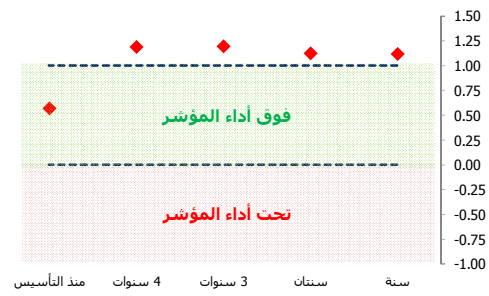
تحليل إحصائي على أساس الوسط الهندسي و معامل الانحراف المعياري الهندسي للفترة.

توزيع المحفظة



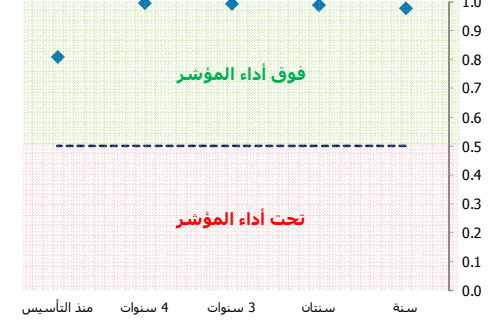
أداء المدير

معدل: العوائد فوق أداء المؤشر/ تقلبات تلك العوائد



الزيادة في العوائد فوق مستوى المؤشر (قياس المخاطر عن طريق معامل الانحراف) معدل مطروقات 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%