

صندوق فالكم المتداول للأسهم السعودية ("الصندوق")

December 31, 2015

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

الأداء				
الأجل القصير	شهر	شهور 3	شهور 6	شهور 9
الصندوق	-4.91%	-6.24%	-22.87%	-18.79%
المؤشر	-4.97%	-6.39%	-23.74%	-20.46%
تكوين العائد				
الصندوق	2015	2014	2013	منذ التأسيس
الصندوق	-14.18%	-2.96%	30.61%	24.66%
المؤشر	-16.39%	-4.95%	26.67%	7.42%
العوائد المترابطة				
الصندوق	السنة	سنتان	سنوات 3	منذ التأسيس
الصندوق	-14.18%	-16.71%	8.78%	7.42%
المؤشر	-16.39%	-20.53%	8.86%	7.52%
الإنحراف المعياري				
الصندوق	0.98	-0.93	0.77	0.72
المؤشر	-0.98	-0.87	-0.95	0.92
نسبة شارب				
الصندوق	-18.39%	-18.94%	6.98%	5.42%
المؤشر	-16.25%	-22.53%	6.98%	23.08%

أهداف المحفظة	
يهدف صندوق فالكم المتداول للأسهم السعودية لتحقيق مكاسب رأسمالية للمستثمرين ونمو لرأس مالمهم 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	
رمز 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 24.93120
صندوق صافي قيمة الأصول	SAR 22,438,099.00
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	
معدل: العوائد فوق أداء المؤشر	فوق أداء المؤشر
معدل: العوائد دون أداء المؤشر	دون أداء المؤشر

التحليل الإحصائي					
مقابل المؤشر	سنة	سنتان	سنوات 3	سنوات 4	منذ التأسيس
الفا	0.00%	2.25%	2.61%	2.71%	2.63%
بيتا	0.9836	0.9906	0.9737	0.9738	0.9799
معدل تطابق أداء الصندوق مع أداء المؤشر	99.55%	98.80%	97.17%	97.29%	98.15%
معدل: العوائد فوق أداء المؤشر / تقلبات العوائد	0.10	0.06	0.05	0.06	0.07
معدل أداء الصندوق مع أداء استثمار خالي من المخاطر	2.49%	4.47%	7.93%	11.17%	15.98%
معدل تجاوز أداء الصندوق لأداء المؤشر	36.65%	41.12%	39.47%	39.56%	39.04%

