

صندوق فالكم المتداول للأسهم السعودية ("الصندوق")

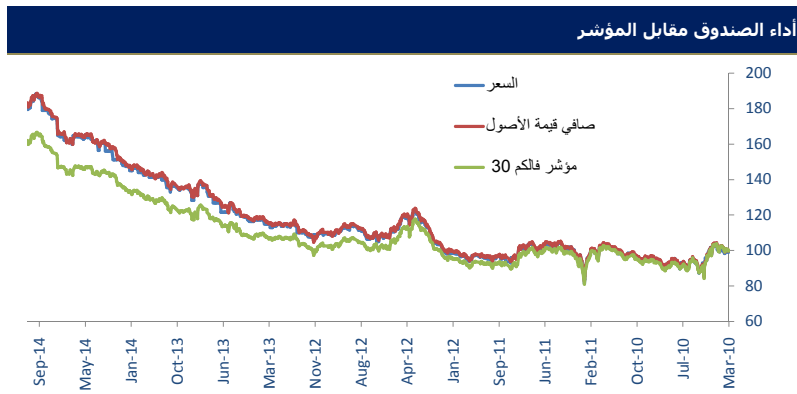
September 30, 2014

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

| الأداء | الأجل القصير | شهر | 3 شهور | 6 شهور | 9 شهور |
|---------|--------------|--------|--------|--------|--------|
| الصندوق | -2.11% | 14.02% | 14.44% | 27.28% | 27.28% |
| المؤشر | -2.06% | 13.21% | 12.55% | 24.59% | 24.59% |

| تقويم العائد | 2012 | 2013 | 2014YTD | منذ التأسيس |
|--------------|--------|--------|---------|-------------|
| الصندوق | 10.74% | 30.61% | 27.28% | 90.51% |
| المؤشر | 7.70% | 26.67% | 24.59% | 68.41% |

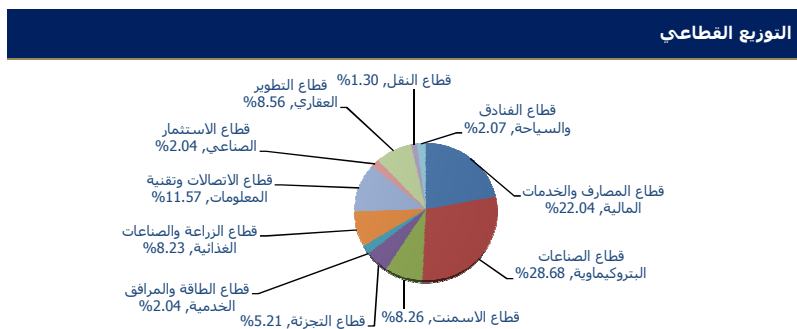
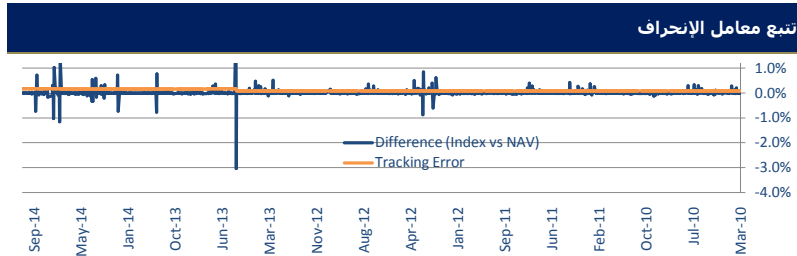
| العوائد المتراكمة | سنة | سنتان | 3 سنوات | منذ التأسيس |
|-------------------|--------|--------|---------|-------------|
| الصندوق | 35.88% | 65.98% | 89.83% | 68.40% |
| المؤشر | 33.08% | 62.94% | 88.35% | 68.34% |
| الانحراف المعياري | 34.77% | 64.66% | 88.35% | 68.34% |
| نسبة شارب | 0.97 | 0.99 | 0.99 | 0.97 |
| نسبة ترينور | 37.99% | 73.21% | 95.67% | 66.40% |



التحليل الاحصائي

| مقابل المؤشر | سنة | سنتان | 3 سنوات | 4 سنوات | منذ التأسيس |
|--|--------|--------|---------|---------|-------------|
| الفا | 0.00% | 4.69% | 3.90% | 3.08% | 3.11% |
| بيتا | 0.9978 | 0.9110 | 0.9371 | 0.9644 | 0.9711 |
| معدل تطابق أداء الصندوق مع أداء المؤشر | 89.16% | 87.40% | 91.80% | 95.78% | 96.80% |
| معدل : العوائد فوق أداء المؤشر / تقلبات العوائد | 0.10 | 0.09 | 0.08 | 0.07 | 0.07 |
| معدل أداء الصندوق مع أداء استثمار خالي من المخاطرة | 5.35% | 11.49% | 13.37% | 13.23% | 14.68% |
| معدل تجاوز أداء الصندوق لأداء المؤشر | 49.20% | 48.30% | 47.07% | 46.64% | 46.58% |

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



أهداف المحفظة

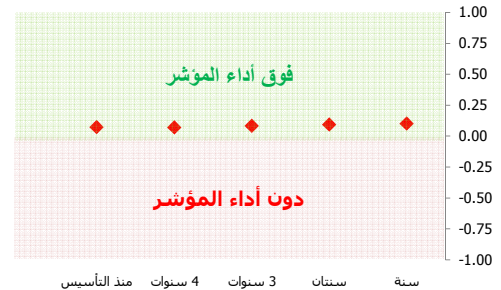
يهدف صندوق فالكم المتداول للأسهم السعودية لتحقيق مكاسب رأسمالية للمستثمرين و نمو لرأس مالهم على المدى الطويل. يستثمر الصندوق بشكل غير نشط في الأسهم السعودية المدرجة من أجل تحقيق مستوى أداء يتطابق مع أداء مؤشر القياس (مؤشر فالكم 30)، قبل الرسوم والمصاريف.

بيانات الصندوق

| | |
|------------------------|--------------------------------|
| عملية الصندوق | ريال سعودي |
| تاريخ التأسيس | 27-Mar-10 |
| نوع الصندوق | صندوق النقد المتداول |
| الرسوم الإدارية (سنوي) | 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 38.10180 |
| صندوق صافي قيمة الأصول | SAR 37,149,303.00 |
| مؤشر الصندوق | فالكم مؤشر الأسهم السعودية F30 |
| مدير الصندوق | فالكم للخدمات المالية |
| الأمين | فالكم للخدمات المالية |
| مقدم المؤشر | تداول (البورصة السعودية) |

أداء المدير

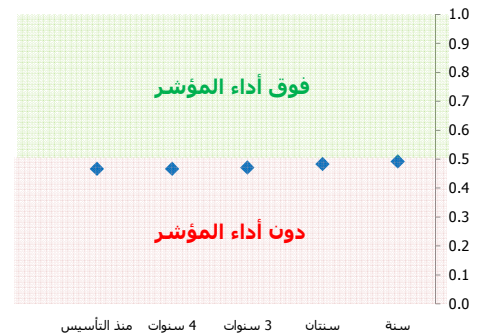
معدل: العوائد فوق أداء المؤشر/ تقلبات تلك العوائد



سنة سنتان 3 سنوات 4 سنوات منذ التأسيس

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



سنة سنتان 3 سنوات 4 سنوات منذ التأسيس

معدل الفترة التي تجاوز فيها مدير الصندوق أداء المؤشر. معدل أعلى يعكس تجاوز ثابت فوق أداء المؤشر. بشكل مثالي < 50%

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 يضمنها مدير الاستثمار. الأداء السابق لا يضمن استمرار نفس النتائج في المستقبل والصندوق معرض لمخاطر الاستثمار. الأوراق المالية المدرجة يتم تقويمها بسعر إقفالها، و صفقات المراجعات تقوم بقيمتها عند التقويم، والاستثمارات الأخرى تقوم بقيمتها الدفترية عند التقويم