

Faktablad specialfonden Scirocco, Systematiska Fonder JPA AB

Strategi och målsättning

Scirocco investerar i OMXS30-derivat. Placeringarna kan vara både för uppgång samt för nedgång. Strategin i fonden är systematisk. Fonden får använda sig av optioner på innehavda terminskontrakt. Detta för att skydda innehav vid extrema situationer på marknaden.

Fonden strävar efter att skapa en konkurrenskraftig absolut avkastning oavsett hur aktiemarknaden utvecklas. Målet är att risken skall vara lägre än för aktiemarknaden och att korrelationen skall vara låg med aktiemarknaden.

Fonden riktar sig mot alla som söker absolut avkastning snarare än exponering mot en specifik marknad, t ex aktiemarknaden.

Riskprofil

Fonden får maximalt vara 500 % investerad. Det innebär att fondförmögenheten kan belånas med som mest 500 % för att öka fondens hävstång. Det ger fonden en möjlighet till större exponering när så bedöms vara rimligt, men det innebär också ett större risktagande. Fondbolaget eftersträvar att fondens genomsnittliga risknivå mätt som årlig standardavvikelse över en rullande tolv månadersperiod, skall uppgå till ca 25 %.

En investering i fonden kan såväl öka som minska i värde. En investerare kan få tillbaka en mindre summa än vad som investerats i fonden om utvecklingen inte lever upp till vad som är förväntat.

I informationsbroschyren finns en mer detaljerad beskrivning av de risker en placering i fonden innebär.

Systematiska Fonder JPA AB

Fonden startades 2003-07-01 och har sedan dess förvaltats av Systematiska Fonder JPA AB med säte i Lund. Fonden hette tidigare Västgöta- Smålands fonden. Systematiska Fonder JPA AB har Finansinspektionens tillstånd att bedriva fondverksamhet sedan 2007-01-29.

Förvaringsinstitut för fonden är Handelsbanken (Publ.). Fondens revisor är Claes Thimfors, Price Waterhouse Coopers.

Fonden är en specialfond enligt 2004:46 LIF. Finansinspektionen utövar tillsyn över fonden och Fondbolaget Systematiska Fonder JPA AB.

Arvoden och avgifter

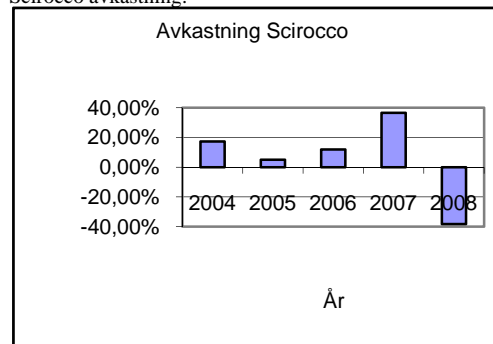
Fondbolaget erhåller dels ett fast arvode om 1,5 % om året på förvaltningskapitalet samt ett resultatbaserat arvode om 20 % på avkastning som överstiger referensräntan. Referensräntan beräknas som genomsnitts räntan av Riksbanken redovisade 30 dagars statsskuldväxel på föregående kalendermånad. Referensräntan per månad blir således (ingående (SSVX 1M) + utgående (SSVX 1M)) / 2 / 12

Det finns inga tecknings- eller inlösenkostnader. Kostnader för courtage och andra transaktionskostnader hänförliga till köp och försäljning av fondpapper och andra instrument betalas av fonden. Ersättning till förvaringsinstitut betalas av Systematiska Fonder JPA AB. Ersättning till företag som förmedlar fondandelar betalas av Systematiska Fonder JPA AB.

TER (totala kostnader i förhållande till genomsnittlig

Historisk avkastning

Scirocco avkastning:



Den genomsnittliga årsavkastningen för fonden är 6,5 %. Avkastningen inkluderar avgifter i enlighet med den nu rådande avgiftsstrukturen. Historisk positiv avkastning är ingen garanti för framtida avkastning.

Skatteregler

För fysiska andelsägare skall vinst eller förlust beskattas i inkomstslaget kapital. En fondandelsägares skatt kan komma att påverkas av individuella omständigheter, investerare som är osäkra på eventuella skattekonsekvenser bör söka experthjälp.

För fonden gäller inte reavinstbeskattning, istället tas en schablonintäkt upp som uppgår till 1,5 % av marknadsvärdet vid ingången av beskattningsåret.

Teckning och inlösen av andelar

Teckning och inlösen av fondandelar sker dagligen. Anmälan och betalning för teckning skall vara Systematiska Fonder JPA AB tillhanda senast klockan 13.00 på handelsdagen samt klockan 11.00 vid halvdagar. Anmälan om försäljning av fondandelar skall vara Systematiska Fonder JPA AB tillhanda senast klockan 13.00 på handelsdagen samt klockan 11.00 vid halvdagar. Vid inlösen erhålls likvid senast den femte bankdagen i efterföljande månad.

Minsta investering är 10 000 SEK.

Information och anmälningsedel för teckning kan beställas per telefon 0771-422 000, fax 040-120371 eller e-post info@systematiska.se eller laddas ner på www.systematiska.se.

Information

Systematiska Fonder JPA AB redovisar fonden Sciroccos teckning och inlösen via saldobesked. Uppdatering finns på Fondbolagets webbsida med daglig kursuppdatering.

Fondbolaget upprättar årsberättelse och halvårsredogörelse som tillställs fondandelsägarna.

Informationsbroschyr samt årsberättelse och halvårsredogörelse kan erhållas av Systematiska Fonder JPA AB innan en investering görs i fonden.

Övrigt

Klagomålsansvarig är Carl-Johan Kjellander.

Faktabladets publiceringsdag är 2010-01-18.

fondförmögenhet) är 0,055.