

Fondbestämmelser

Systematiska BAS

Systematiska Fonder JPA AB

Fondbestämmelser för Systematiska BAS

Godkända av Finansinspektionen den 28 januari 2009.

§ 1 Fondens namn och rättsliga ställning

Fondens namn är Systematiska BAS, nedan kallad Fonden. Fonden är en specialfond enligt lagen (2004:46) om investeringsfonder (LIF). Verksamheten bedrivs, förutom enligt nämnda lag, enligt fondbestämmelserna, bolagsordningen för Systematiska Fonder JPA AB samt de övriga föreskrifter vilka utfärdas med stöd av lag eller annan författning.

Fonden riktar sig till allmänheten. Fondförmögenheten ägs av fondandelsägarna gemensamt och varje fondandel medför lika rätt till den egendom som ingår i fonden. Fondandelsägarna svarar inte för förpliktelser som avser fonden.

Fonden kan inte förvärva rättigheter eller ta på sig skyldigheter. Fonden kan inte heller föra talan inför domstol eller någon annan myndighet. Egendom som ingår i fonden får inte utmätas.

§ 2 Fondförvaltare

Fonden förvaltas av Systematiska Fonder JPA AB, organisationsnummer 556567-1756, nedan kallat Fondbolaget. Fondförvaltaren företräder andelsägarna i alla frågor som rör fonden, beslutar över den egendom som ingår i fonden och utövar rättigheter som följer med egendomen.

§ 3 Förvaringsinstitutet och dess uppgift

Fondens tillgångar förvaras av Handelsbanken AB (publ) organisationsnummer 502007-7862, såsom förvaringsinstitut, nedan kallat förvaringsinstitutet. Förvaringsinstitutet skall ta emot och förvara den egendom som ingår i fonden.

Förvaringsinstitutet skall dessutom se till att Fondbolaget följer LIF (2004:46) och dess fondbestämmelser i frågor som gäller fondens placeringar, vid beräkningen av fondandelarnas värde samt vid försäljning och inlösen av fondandelar.

§ 4 Fondens karaktär

Fonden är en specialfond. En specialfond är en fond som erhållit undantag från LIF (2004:46). Målsättningen är att skapa en konkurrenskraftig avkastning oavsett hur aktiemarknaden och/eller räntemarknaden utvecklas.

Fondens medel kommer i enlighet med Fondbolagets modell Systematiska BAS, att investeras i överlåtbara värdepapper, penningmarknadsinstrument, fondandelar, derivatinstrument samt placering på konto hos kreditinstitut inom EES. Systematiska BAS är en av fondbolagets

förvaltningsmodeller som identifierar tillfällen med förhöjd sannolikhet för rörelse i förutbestämd riktning. Systematiska BAS modellen fokuserar på låg risk och hög konsistens.

Fondens medel kan komma att placeras enbart, dvs. till 100 % av fondförmögenheten, i derivatinstrument avseende aktieindex, s.k. aktieindex derivat.

§ 5 Fondens placeringsinriktning

§ 5.1 Allmänt

Fondens medel får placeras i tillgångslagen överlåtbara värdepapper, penningmarknadsinstrument, fondandelar, derivatinstrument samt placering på konto hos kreditinstitut inom EES.

Fonden får placera i derivatinstrument vars underliggande tillgångar utgörs av finansiella index och/eller aktier.

Fonden får använda sig av derivatinstrument som ett led i placeringsinriktningen. Fonden får ta emot eller leverera de underliggande tillgångarna.

§ 5.2 Undantag från LIF samt FFFS 2008:11

Fonden har beviljats följande undantag från bestämmelserna i LIF (2004:46) samt FFFS2008:11 såvitt avser placeringsinriktningen.

Fonden får använda sig av derivatinstrument utan att ha leveranskapacitet av underliggande tillgångar eller likvärdiga tillgångar. Det innebär att fondens handel med derivatinstrument kan leda till att fonden erhåller en negativ exponering i underliggande tillgångar (undantag från 16 kap 8 § FFFS 2008:11).

Fonden får placera upp till 100 procent av fondförmögenheten i penningmarknadsinstrument som getts ut eller garanterats av en enskild stat inom EES. Skuldförbindelserna måste dock komma från minst sex olika emissioner och de som kommer från en och samma emission får inte överstiga 30 procent av fondens värde (undantag från 5 kap 6 § 2 stycket 1p. LIF).

Fondens fondförmögenhet (100 %) får placeras på konto hos bankaktiebolag inom EES. Placering hos ett och samma bankaktiebolag får uppgå till högst 40 % av fondförmögenheten (undantag från 5 kap 11 § LIF).

§ 5.3 Risknivå och riskmått

Fondbolaget eftersträvar att fondens genomsnittliga risknivå mätt som årlig standardavvikelse över en rullande tolv månadersperiod, skall understiga 12 procent. Fonden skall vid varje tillfälle tillämpa principen om riskspridning av fondens tillgångar.

§ 5.4 Säkerhetskrav

Fonden får vid varje tidpunkt vara utsatt för säkerhetskrav med anledning av handel i derivatinstrument som högst uppgår till 50 % av fondförmögenheten.

§ 6 Marknad och marknadsplats

Handel av finansiella instrument skall ske på en reglerad marknad inom EES. Handel får även ske på annan marknad inom EES som är reglerad och öppen för allmänheten.

§ 7 Särskild placeringsinriktning

Fonden får använda derivatinstrument som ett led i placeringsinriktningen. Fonden får inte placera i sådana överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument som avses i 5 kap. 5 § lagen om investeringsfonder. Fonden får inte placera i s.k. OTC-derivat.

Fondens handel med derivatinstrument kan leda till att fonden har en negativ exponering.

§ 8 Fondandelarnas värde

Fondens värde beräknas genom att från tillgångarna (finansiella instrument, likvida medel och upplupen avkastning) dra av de skulder som avser fonden (upplupen ersättning enligt § 11 samt skatter och övriga skulder). Kostnader för köp och försäljning av finansiella instrument skall belasta fonden.

Finansiella instrument som ingår i fonden värderas till marknadsvärde. Härmed avses senaste betalkurs eller, om sådan saknas, senaste köpkurs. Om sådana kurser saknas eller om kurserna enligt Fondbolagets bedömning är missvisande, får Fondbolaget fastställa värdet på objektiva grunder.

Värdet på en fondandel är fondens värde, beräknat enligt ovan, delat med antalet utestående andelar.

Fondandelsvärdet beräknas den sista bankdagen i varje månad, nedan kallat handelsdagen (undantag från 4 kap 10 § tredje stycket LIF). Fondandelsvärdet publiceras senast fem bankdagar efter handelsdagen på Fondbolagets webbsida, NAV center AB samt meddelas fondandelsägarna via saldobesked per post.

§ 9 Försäljning och inlösen av fondandelar

Fondbolaget säljer fondandelar per den sista bankdagen varje månad, nedan kallad handelsdagen.

Fondandelsägarna skall senast tre bankdagar före handelsdagen skriftligen via brev eller telefax anmäla till Fondbolaget att nyteckning skall ske och med vilket belopp. Andelsägaren ansvarar för att anmälan är behörigen undertecknad och att korrekt bankkontonummer har angetts. Betalning skall vara fondens bankkonto hos förvaringsinstitutet tillhanda senast två bankdagar före handelsdagen.

Inlösen av fondandelar kan ske på handelsdagen i varje månadsskifte (undantag från 4 kap 13 § första stycket LIF). Skriftlig begäran via brev eller telefax om inlösen av andelar skall vara Fondbolaget tillhanda senast tre bankdagar före handelsdagen. Sådan begäran får återkallas endast om Fondbolaget medger detta. Vid sådan återkallelse kommer samtliga

fondandelsägare att hanteras lika.

Priset vid försäljning och inlösen av fondandelar är fondandelsvärdet på handelsdagen. Ingen avgift utgår vid inlösen av fondandelar. Vad beträffar försäljningsavgift se § 11.3. fondbestämmelserna.

Försäljning respektive inlösen av fondandel kommer att ske till en för andelsägaren vid tillfället för begäran om försäljning respektive inlösen okänd kurs. Begäran om försäljning/inlösen kan inte limiteras.

Minsta insättning i fonden är 10000 SEK, därefter ingen begränsning. Minsta inlösen är likaledes 10000 SEK, eller en fondandelsägares totala fondinnehav.

Fondandelsvärdet meddelas fondandelsägaren genom en skriftlig avräkningsnota som utfärdas senast fem bankdagar efter handelsdagen. Vid inlösen av fondandelar utbetalas försäljningslikviden senast fem bankdagar efter handelsdagen.

Fondandel skall inlösas på inlösendagen om medel finns tillgängliga i fonden. Om inte så är fallet skall medel anskaffas genom försäljning av fondens egendom och inlösen verkställas så snart som möjligt. Skulle en sådan försäljning väsentligen kunna missgynna övriga fondandelsägares intresse, får Fondbolaget efter anmälan till Finansinspektionen avvakta med försäljningen.

§ 10 Stängning av fonden

Fonden kan komma att stängas för in- och utträde om sådana extraordinära förhållande har inträffat som gör att en värdering av fondens tillgångar inte kan göras på ett sätt som säkerställer andelsägarnas lika rätt.

Styrelsen ska fatta beslut om stängning av fonden för nyteckning av andelar om förvaltningsvolymen överstiger det i informationsbroschyren angivna beloppet. Om fonden varit stängd på grund av styrelsens beslut enligt föregående mening, ska styrelsen fatta beslut om att öppna fonden igen sedan förvaltningsvolymen underskridit det i informationsbroschyren angivna beloppet. En stängning respektive öppning av fonden kommuniceras senast tio dagar före nästa handelsdag (dvs. nästkommande sista bankdag i månaden), varefter fonden stängs. Sådan kommunikation sker via brev samt på bolagets webbsida till samtliga fondandelsägare, samt till de fysiska- och juridiska personer som lämnat anmälan om nyteckning i fonden samt via brev till Finansinspektionen. Vid stängning eller öppning av fonden skall alla fondandelsägare behandlas lika.

§ 11 Fondbolaget och förvaringsinstitutets ersättning från fonden

Ersättning till Fondbolaget sker dels som en fast ersättning, dels i form av en resultatbaserad ersättning.

§ 11.1 Fast ersättning

Ur fondens medel skall erläggas 2 % per år av fondförmögenheten som en fast ersättning till fondbolaget för dess förvaltning av fonden. Ersättningen inkluderar kostnader till förvaringsinstitutet för dess förvaring av fondens tillgångar, Finansinspektionen för dess tillsynsverksamhet samt ersättning till revisorer. Den fasta ersättningen utbetalas varje månad på handelsdagen och beräknas på fondförmögenheten per den aktuella handelsdagen.

§ 11.2 Resultatbaserad avgift

Den resultatbaserade ersättningen till Fondbolaget är 20 % på värdestegringen. Denna värdestegring avser värdestegring efter avdrag för den fasta förvaltningsavgiften.

Den resultatbaserade ersättningen skall erläggas av fondandelsägaren vid utgången av varje månad, i relation till just denna fondandelsägares avkastning.

Den resultatbaserade ersättningen skall erläggas av fonden men belastar respektive fondandelsägare relation till just denna fondandelsägares avkastning, genom att fondandelsägarens fondandelsantal justeras. Antalet andelar för den individuella fondandelsägaren härleds genom att utgå från den fondandelsägare som skall erlägga det högsta resultatbaserade arvudet per andel. Denna fondandelsägares nettovärde per andel utgör basen vid beräkning av det nya antalet andelar i fonden.

Om en fondandelsägare erhåller en negativ avkastning och det under en senare period uppstår en positiv avkastning, skall inget resultatbaserat arvode erläggas förrän tidigare periods negativa avkastning kompenseras.

Eventuell negativ avkastning kompenseras ej vid försäljning av fondandelar. Att fonden använder sig av resultatbaserad avgift får till följd att fondandelsägare kompenseras med emitterade fondandelar. Konsekvensen för fondandelsägare som säljer fondandelar efter en förlustperiod blir att dessa fondandelar inte kompenseras, därvid kan den resultatbaserade avgiften i relation till fondandelsägarens vinst/förlust bli högre än 20 %.

Antalet andelar och NAV kurs avrundas med två decimaler. Avrundningen av storleken på ersättningen sker nedåt till närmaste hela SEK.

Courtage och andra transaktionskostnader hänförliga till köp och försäljning av överlåtbara värdepapper och andra instrument betalas av fonden.

§11.3 Försäljningsavgift

Fondbolaget äger rätt att uttaga en försäljningsavgift motsvarande högst 4 procent av det försålda andelsvärdet vid försäljning av andel. Försäljningsavgiften tillfaller fondbolaget.

§ 12 Utdelning

Till fondandelsägarna skall utdelning ske i den omfattning som Fondbolaget beslutar. Fonden lämnar utdelning med syfte att överföra beskattning av fondens avkastning på andelsägarna. Därigenom undviks beskattning i två led.

Det utdelningsbara beloppet beräknas som fondens resultat enligt resultaträkning för räkenskapsåret till den del detta utgör för fonden positivt beskattningsbart resultat.

Utdelning sker med ett belopp motsvaranden det utdelningsbara beloppet, vilket får reduceras med utbetald upplupen utdelning förutsatt att detta avdrag minskas med inbetald upplupen utdelning.

Utdelning skall ske senast två månader efter räkenskapsårets utgång. Bolaget skall göra avdrag för den skatt som enligt lag skall innehållas för fondandelsägare på utdelning.

Utdelat belopp, efter skatteavdrag, med undantag för utdelning vid andelsinlösen, återinvesteras automatiskt i fonden avgiftsfritt om inte andelsägaren senast den 31 december året innan utdelningsåret hos Fondbolaget begärt att erhålla utdelningen kontant.

Utdelningen tillkommer fondandelsägare som på av Fondbolaget fastställd utdelningsdag är registrerad för fondandel.

Andelsägare som är registrerad för fondandel på utdelningsdagen, men som inte ägt sina fondandelar hela räkenskapsåret kan komma att erhålla en utdelning som överstiger fondandelsägarens värdestegring.

§ 13 Fondens räkenskapsår

Räkenskapsår för fonden skall vara 1 januari - 31 december (kalenderår).

§ 14 Årsberättelse och halvårsredogörelse och ändring av fondbestämmelser

Årsberättelse och halvårsredogörelse för fonden skall hållas tillgänglig hos bolaget inom fyra respektive två månader efter rapportperiodens utgång. Årsberättelse och halvårsredogörelse finns tillgängliga på fondbolagets webbsida www.systematiska.se. Årsberättelse och halvårsredogörelse kan även rekvireras hos fondbolaget.

Beslutar Fondbolaget om ändringar av dessa fondbestämmelser skall beslutet underställas Finansinspektionen för godkännande. Beslutet skall hållas tillgängligt hos Fondbolaget och förvaringsinstitut.

§ 15 Pantsättning av fondandelar

Fondandelar kan pantsättas och överlåtas.

Pantsättning av fondandel skall anmälas skriftligen till bolaget. Av anmälan skall framgå andelsägare, panthavare, av pantsättningen omfattade fondandelar samt begränsningar av pantsättningens omfattning. Anmälan skall vara undertecknad av pantsättaren. Bolaget skall notera uppgifter om pantsättning i andelsägarregistret samt underrätta andelsägaren om noteringen. Uppgift om pantsättning skall borttas ur registret efter anmälan från panthavaren. Bolaget har rätt att ta ut ersättning av andelsägaren för den kostnad som pantsättningen medför.

Kostnaden för pantsättning är 500 SEK.

§ 16 Ansvarsbegränsning

Bolaget eller förvaringsinstitutet är inte ansvarigt för skada som beror av svenskt eller utländskt lagbud, svensk eller utländsk myndighets åtgärd, krigshändelse, terroristhandling, strejk, blockad, bojkott, lockout eller annan liknande omständighet. Förbehållet i fråga om strejk, blockad, bojkott och lockout gäller även om bolaget eller förvaringsinstitutet är föremål för eller själv vidtar sådan konfliktåtgärd.

Skada som uppkommer i andra fall skall inte ersättas av Fondbolaget och/eller förvaringsinstitutet om normal aktsamhet iakttagits. Fondbolaget och/eller förvaringsinstitutet ansvarar inte i något fall för indirekt skada eller annan följskada. Att andelsägare i vissa fall ändå är berättigade till skadestånd följer av 2 kap 21 § LIF.

Fondbolaget och/eller förvaringsinstitutet svarar inte för skada som orsakats av depåbank eller annan uppdragstagare som Fondbolaget eller förvaringsinstitutet med tillbörlig omsorg anlitat. Fondbolaget och/eller förvaringsinstitutet svarar inte heller för skada som uppkommer för fonden eller andelsägare eller annan i anledning av förfogandeinskränkning som kan komma att tillämpas mot Fondbolaget och/eller förvaringsinstitutet beträffande finansiella instrument.

Föreligger hinder för Fondbolaget och/eller förvaringsinstitutet att helt eller delvis vidta åtgärd på grund av omständighet som anges ovan får åtgärden skjutas upp till dess hinder inte föreligger. Om Fondbolaget och/eller förvaringsinstitutet till följd av en sådan omständighet är förhindrat att verkställa eller ta emot betalning skall Fondbolaget och/eller förvaringsinstitutet respektive andelsägaren inte vara skyldig att erlagga dröjsmålsränta.