

Fakta

Agerar i OMXS30 derivat noterade på Stockholms Fondbörs.

Ansvarig förvaltare:
Christer Andersson

Jämförelseindex: 30 dagars SSSV

Startår: 2003-07-01

Startkurs: 100 kr

Registreringsland: Sverige

Utveckling

Andelsvärde per den 30/6: 158,10 kr

Handelsstartkurs 2003-07-01: 100,00 kr

Totalavkastning: 4,77 %

Jämförelseindex: 1,51 %

Kostnader

Förvaltningsavgift: 1,50 % / år

Performanceavgift: 20 % över 30 dagars
statsskuldväxlar

Totalkostnadsandel; TKA : 4,63% /år

Total Expense Ratio; TER: 2,37 % /år

Insättningsavgift: 0 %

Utagsavgift: 0 kr

Förvaltningskostnader för engångsinsättning av
10 000 kr under 2009: 75,32 kr

Förvaltningskostnader för löpande
månadssparande av 100 kr under 2009: 2,73 kr

Riskmått

Standardavvikelse 24 mån: 18,14 %

Standardavvikelse 24 mån
jämförelseindex: 5,00 %

Riskmåttan är beräknade som standardavvikelse
för månadsförändring uttryckta på årsbasis

Övrig information

Fondens totalavkastning redovisas efter avdrag
för kostnader

Minsta startbelopp: 10 000 kr

Minsta månadssparande: 500 kr

Fondens org-nr: 504400-8034

Nyckeltal

Fondförmögenhet	20090630
Antal utelöpande andelar	22,6 mkr
Totalavkastning	142 824 st
Jämförelseindex	4,77 %
Omsättningshastighet årsbasis	4,65 %
	424,46

Förvaltningsberättelse

Stockholmsbörsen har under perioden haft en turbulent utveckling. I denna miljö är fondens avkastning på 4,77 procent ett resultat i linje med förväntningarna.

Fondens utveckling

Fonden lämnade en avkastning på 4,77 procent under året. Jämförelseindex förändrades med 1,51 procent.

Fondens mål är att med hjälp av regelbaserade system ge en absolut totalavkastning som signifikant överstiger 30 dagars statsskuldsväxelränta. Risken i fonden är medelhög. Fonden vänder sig till de som söker en fond som inte är beroende av en stigande börs för att kunna generera en positiv avkastning.

Placerings strategi

Fondens strategi kombinerar tidsdynamiska effekter på aktiemarknaden med trendföljande strategier. Fonden tillämpar high watermark principen.

Fondens inriktning

Fonden är en absolutavkastande specialfond. Tillgångsklassen är endast OMXS30 derivat noterade på Stockholms Fondbörs.

Avkastningsmål

Fonden är absolutavkastande.

SYSTEMATISKA®

Tornado

Halvårsberättelse Jan-Juni 2009

	Antal	Marknadsvärde	del av fond- förmögenheten
<u>Diskonteringspapper</u>			
Fabege	1 MSEK	998	4%
Trelleborg	2 MSEK	1 997	9%
<u>Terminskontrakt</u>			
OMXS30 9G		-204	
<u>Optioner</u>			
OMXS30 9S 710	-170	-10	
Summa finansiella instrument		2 781	12%
- varav finansiella instrument med positivt värde		2 995	
- varav finansiella instrument med negativt värde		-214	
Likvida medel		20 667	92%
Övriga tillgångar och skulder netto		-867	-4%
Fondförmögenhet		22 581	100%

Startår 2003

Fondens utveckling	Jan-juni 2009	2008	2007	2006	2005	2004
Andelsvärde slutkurs, kr	158,100131	153,566081	132,691009	97,874606	86,281724	80,91225
Insättningsavgifter	0	0	0	0	0	0
Uttagsavgifter	0	0	0	0	0	0
Årlig förvaltningskostnad	1,50%	1,50%	0	0	0	0
Performanceavgift tom 2008-03-31						50 % över stibor 30 dagars + 3 %
Performanceavgift from 2008-04-01						Fast avgift om 1,5 % samt 20 % över 30 dagars SSvX
Erlagd förvaltningskostnad under perioden						
-vid andelsinnehav på 10 000 kr	75,32	126	0	0	0	0
Genomsnittsavkastning %	4,77	16,35	35,86	13,44	6,63	1,10
Avkastning jämförelseindex %	1,51	3,91	3,43	2,24	1,7	2,13
Fondförmögenhet (KKR)	22 580	28 552	1 945	550	915	1 976
-antal andelar	142 824	185 929	14 628	5 623	10 606	24 291

Beträffande fondens resultat och ställning i övrigt hänvisas till efterföljande resultat- och balansräkningar med tillhörande tilläggsupplysningar och bokslutskommentarer.

Belopp i kkr om inget annat anges

SYSTEMATISKA®

Tornado

Halvårsberättelse Jan-Juni 2009

Resultaträkning

(KKR)

	Not	2009-01-01 2009-06-30	2008-01-01 2008-12-31
Intäkter och värdeförändring			
Realiserade värdeförändringar på aktierelaterade finansiella instrument		1 960	1 969
Orealiserade värdeförändringar på aktierelaterade finansiella instrument		-10	0
Ränteintäkter	1	<u>116</u>	<u>612</u>
		2 066	2 581
Kostnader			
Courtage HQ		-77	0
Courtage Nordea		-277	-374
Courtage Avanza		-523	-746
Courtage Nordnet		-1	0
Courtage Handelsbanken		-4	-588
Ersättning till Systematiska Fonder JPA AB		<u>-303</u>	<u>-485</u>
		-1 185	-2 193
Resultat före skatt		<u>881</u>	<u>388</u>
Årets resultat		881	388

SYSTEMATISKA®

Tornado

Halvårsberättelse Jan-Juni 2009

Balansräkning

(KKR)

	Not	2009-01-01 2009-06-30	2008-01-01 2008-12-31
TILLGÅNGAR			
Kortfristiga likvidplaceringar		<u>2 995</u>	<u>26 920</u>
		2 995	26 920
Bank och övriga likvida medel		<u>20 667</u>	<u>10 201</u>
		20 667	10 201
Övriga fordringar		<u>23</u>	<u>0</u>
		23	0
SUMMA TILLGÅNGAR		23 685	37 121
SKULDER			
Finansiella instrument med negativt marknadsvärde	2	<u>10</u>	<u>0</u>
		0	0
Skuld inlösta andelar		906	8 342
Övriga skulder		<u>189</u>	<u>227</u>
		1 095	8 569
FONDFÖRMÖGENHET			
Fondförmögenhet	3	<u>22 580</u>	<u>28 552</u>
		22 580	28 552
SUMMA SKULDER OCH FONDFÖRMÖGENHET		23 685	37 121
POSTER INOM LINJEN			
Ställda säkerheter		Inga	Inga
Ansvarsförbindelser		Inga	Inga

UPPLYSNINGAR TILL ENSKILDA POSTER

NOT 1 Ränteintäkter	2009-06-30	2008
Ränteintäkter kortfristiga placeringar	74	68
Ränteintäkter Stadsskuldväxlar	0	208
Ränteintäkter Avanza	0	4
Ränteintäkter Svenska Handelsbanken	42	332
	<u>116</u>	<u>612</u>

NOT 2 Finansiella instrument

Posten avser OMX terminer januari

NOT 3 Fondförmögenhet	2009-06-30	2008-12-31
Fondförmögenhet vid årets början	28 552	1 945
Förändring andelsutgivning: (nominellt värde)	5 939	47 641
Förändring andelsinlösen	-12 792	-21 422
Årets resultat enligt resultaträkning	881	388
Fondförmögenhet vid årets slut	<u>22 580</u>	<u>28 552</u>

Halvårsberättelsen har upprättats enligt lagen om investeringsfonder (SFS 2004:46), Finansinspektionens föreskrifter (FFFS 2008:11) om investeringsfonder samt Fondbolagens förenings framtagna rekommendation för redovisning av nyckeltal avseende investeringsfonder. Såväl orealiserade som realiserade vinster och förluster redovisas över resultaträkningen. För värderingsprincip för fondens innehav av aktier och övriga finansiella instrument har sista betalkurs per 2009-06-30 använts.

Stockholm den 25 augusti 2009

Peter Nilsson (VD)