

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 31/12: kr: 61,07

Handelsstartskurs 2003-07-01: 100,00 kr

Totalavkastning: -23,28 %

Jämförelseindex: 0,46 %

Kostnader

Förvaltningsavgift: 1,50 % / år

Performanceavgift: 20 % över 30 dagars stadsskuldväxlar

Totalkostnadsandel 2008, TKA : 15,14 %

Total Expense Ratio 2008; TER: 1,62 %

Insättningsavgift: 0 %

Uttagsavgift: 0 kr

Förvaltningskostnader för engångsinsättning av 10 000 kr under 2009: 231 kr

Förvaltningskostnader för löpande månadssparande av 100 kr under 2009: 9 kr

Riskmått

Standardavvikelse 24 mån: 28,66 %

Totalrisk för jämförelseindex: 0,53 %

Riskmåten är beräknade som standardavvikelse för månadsförändring uttryckta på årsbasis

Övrig information

Fondens totalavkastning redovisas efter avdrag för kostnader

Minsta start belopp: 10 000 kr

Minsta månadssparande: 500 kr

Nyckeltal

	2009
Fondförmögenhet	4,8 mkr
Antal utelöpande andelar	78 839 st
Totalavkastning	-23,28 %
Jämförelseindex	0,46 %
Omsättningshastighet	-0,90 %

Förvaltningsberättelse

2009 var ett starkt börsår för den svenska, såväl som utländska börser. Den breda svenska aktiemarknaden mätt som OMXSPI steg 48 procent, vilket står i djup kontrast till utvecklingen under 2008 då den svenska börser föll nästa lika mycket. Två år i rad med en så stor spännvidd illustrerar väl den turbulens som rått i världsekonomin. Vart ekonomi och börs ska ta vägen råder det under inledningen av 2010 delade meningar om. Företagen kan aggregerat sägas se en något ljusare bild och en svag återhämtning bortom de kommande kvartalen. Ur ett makroekonomiskt perspektiv finns det dock många osäkra kort, inte minst PIGS-ländernas utveckling, vilken effekt det kan tänkas få för EU och EMU samt vilken turbulens det kommer att skapa på världens börser och valutamarknader. Det är svårt att vara överdrivet positiv och därmed är en defensiv hållning rimlig att ha.

Med detta scenario för ögonen är Systematiska Fonder välpositionerat med ett fondutbud som fokuserar på absolutavkastning. Scirocco arbetar sedan årsskiftet med en ny förvaltningsmodell för vilken vi har goda förhoppningar.

Sciroccos utveckling under 2009

Fonden lämnade en avkastning på -23,28 procent under året. Jämförelseindex avkastade 0,46 procent. Avkastningen är sämre än förväntat. Modellen som ligger till grund för förvaltningen är förändrad sedan årsskiftet 2009/2010.

Placeringsstrategi

Fonden arbetar med termins- och optionsstrategier som utnyttjar välkända avvikelser från informationseffektivitet. De instrument fonden placerar i är uteslutande derivat baserade på OMXS30.

Fondens inriktning

Scirocco är en högriskfond som riktar sig till placerare som accepterar hög risk i utbyte mot möjlig högre avkastning.

Fondens placeringar

	Antal	Marknadsvärde	del av fond- förmögenheten*
Terminskontrakt			
OMXS300 9A	-45	0	0%
Likvida medel		5 563	116%
Övriga tillgångar och skulder netto		-749	-16%
Fondförmögenhet		4 814	100%

*-Avrundat till närmsta heltal

Flerårsöversikt

Startår 2003

Fondens utveckling	2009	2008	2007	2006	2005
Andelsvärde slutkurs, kr	61,07	81,11	131,92	96,58	83,98
Insättningsavgifter	0	0	0	0	0
Uttagsavgifter	0	0	0	0	0
Årlig förvaltningskostnad	1,50%	1,50%	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					
-vid andelsinnehav på 10 000 kr	231	96	0	0	0
Avkastning %	-23,28	-38,29	36,60	17,35	5,20
Avkastning jämförelseindex %	0,46	3,91	3,43	2,24	1,7
Fondförmögenhet (KKR)	4 814	16 262	149	109	197
-antal andelar	78 839	200 503	1 129	1 129	2 342

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®

Scirocco	Årsberättelse 2009	
	2009-01-31	2008-01-31
RESULTATRÄKNING	2009-12-31	2008-12-31
INTÄKTER OCH VÄRDEFÖRÄNDRING		
Värdeförändringen på innehavda finansiella instrument		
Realiserade värdeförändringar på aktierelaterade finansiella instrument	-2 775	-39 395
Orealiserade värdeförändringar på aktierelaterade finansiella instrument	0	-110
Summa värdeförändring	-2 775	-39 505
RÄNTEINTÄKTER		
Ränteintäkter bankkonto	147	1 511
KOSTNADER		
Ersättning till bolaget som driver fondverksamheten	-160	-565
Utgiftsräntor	0	-36
Nettoresultat	-2 788	-38 595
BALANSRÄKNING		
	2009-12-31	2008-12-31
Kassa	5 563	5 269
Finansiella instrument med positivt marknadsvärde	0	12 945
Övriga tillgångar	0	70
Summa tillgångar	5 563	18 284
Finansiella instrument med negativt marknadsvärde	0	105
Övriga skulder	749	1 917
Fondförmögenhet	4 814	16 262
Summa skulder och eget kapital	5 563	18 284
Poster inom linjen		
Erhållna säkerheter för utlånade värdepapper	Inga	Inga
Utlånade värdepapper	Inga	Inga
Ställda säkerheter för inlånade värdepapper	Inga	Inga
Ställda säkerheter för derivat	Inga	105 tkr
Övriga ställda säkerheter	Inga	Inga
Förändring av fondförmögenhet (tkr)		
Fondförmögenhet vid årets början	16 262	149
Andelsutgivning	449	115 996
Andelsinlösen	-9 109	-61 288
Årets resultat enligt resultaträkning	-2 788	-38 595
Fondförmögenhet vid årets slut	4 814	16 262

SYSTEMATISKA®

Scirocco

Årsberättelse 2009

Årsberättelsen 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 2009-12-31 använts.

Stockholm den 26 april 2010

Arild Russ (ordf)

Ulf Christiansson

Carl-Johan Kjellander

Peter Nilsson (VD)

Martin Jönsson

Min revisionsberättelse har lämnats den 28 april 2010

Claes Thimfors
Auktoriserad revisor