

Fakta

Agerar i Svenska aktier, huvudsakligen OMXS 30 aktier.

Ansvarig förvaltare:
Christer Andersson

Jämförelseindex: OMXSPI

Startår: 2010-03-19

Startkurs: 100 kr

Registreringsland: Sverige

Utveckling

Andelsvärde per den 30/6: 97,13 kr

Handelsstartskurs 2009-03-19: 100,00 kr

Totalavkastning: -2,87 %

Jämförelseindex: -2,79 % (sedan start 19/3-09)

Kostnader

Förvaltningsavgift: 1,50 % / år

Totalkostnadsandel; TKA: 1,54 % /år

Total Expense Ratio; TER: 1,50 % /år

Insättningsavgift: 0 %

Uttagsavgift: 0 kr

Förvaltningskostnader för engångsinsättning av 10 000 kr sedan start 19/3-09: 43,15 kr

Förvaltningskostnader för löpande månadssparande av 100 kr sedan start 19/3-09 : 1,29 kr

Riskmått

Standardavvikelse sedan start ca: 14,71 %

Riskmålet är beräknade som standardavvikelse för dagsförändring uttryckta på årsbasis. Då fonden startade den 19 mars 2010 avser standardavvikelse denna period uttryckta på årsbasis

Övrig information

Fondens totalavkastning redovisas efter avdrag för kostnader

Minsta startbelopp: 10 000 kr

Minsta månadssparande: 500 kr

Fondens org-nr: 515602-3185

Nyckeltal

| | |
|----------------------------------|------------|
| | 2010-06-30 |
| Fondförmögenhet | 7,1 mkr |
| Antal utelöpande andelar | 73 160 st |
| Totalavkastning | -2,87% |
| Jämförelseindex sedan start 19/3 | -2,79 % |
| Omsättningshastighet årsbasis | 0,06% |

Förvaltningsberättelse

Stockholmsbörsen har under perioden förändrats från en mycket turbulent och svag utveckling till en positiv trend under andra halvan av perioden. Fonden avkastade -2,87 procent sedan starten den 19 mars till 30 juni, vilket är ett resultat i linje med förväntningarna.

Fondens utveckling

Fonden lämnade en avkastning på -2,87 procent sedan starten den 19 mars till 30 juni. Jämförelseindex förändrades med -2,79 procent sedan starten den 1 mars 2010. Fonden har handlats fyra månader under perioden och utfallet är väl i linje med förväntningarna.

Placeringsstrategi

Systematiska Sverige placerar i svenska aktier. Fonden följer en kvantitativ förvaltningsmodell. Historiskt har förvaltningsmodellen levererat betydligt högre avkastning än den svenska aktiemarknaden.

Risken i fonden är i nivå med risken för den svenska aktiemarknaden. Trots att fonden placerar brett i svenska aktier kan avkastningen komma att avvika från aktiemarknadens avkastning.

Fondens inriktning

Systematiska SVERIGE riktar sig till placerare vilka söker en svensk aktiefond vars målsättning är att generera en bättre avkastning än jämförelseindex över tiden.

Avkastningsmål

Fonden inriktning är att överträffa jämförelseindex över tiden.

Innehavs fördelning Systematiska Sverige 2010-06-30

| Bransch | Antal/ Nom. | Marknads- | Andel | | | | |
|---------------------------------|-------------|------------|-------------------|--------------------------------------|-------|------------------|-------------|
| Värdepapper | belopp | Värde (kr) | (%) ¹⁾ | | | | |
| SummaEnergy | | | | Hea Care.Equip.Serv | | | |
| LUNDIN PETROLEUM | 3 468 | 120 097 | 2% | ELEKTA B | 653 | 129 555 | 2% |
| Summa Energy | | 120 097 | 2% | Summa Hea Care.Equip.Serv | | 129 555 | 2% |
| Health Care | | | | Pharma.Bio | | | |
| GETINGE B | 803 | 121 815 | 2% | AZN | 381 | 140 208 | 2% |
| Summa Health Care | | 121 815 | 2% | MEDA A | 2 042 | 116 088 | 2% |
| | | | | Summa Pharma.Bio | | 256 296 | 4% |
| Materials | | | | Bank | | | |
| BOLIDEN | 1 318 | 114 996 | 2% | NORDEA | 1 929 | 125 192 | 2% |
| HOLMEN B | 691 | 128 457 | 2% | SEB A | 3 023 | 126 361 | 2% |
| LUNDIN MINING CORP | 4 148 | 92 210 | 1% | SHB A | 648 | 124 546 | 2% |
| SCA SV CELLULOSA B | 1 356 | 125 159 | 2% | SWEDBANK AB | 1 756 | 127 398 | 2% |
| SSAB SVENSKT STÅL A | 1 074 | 113 629 | 2% | Summa Bank | | 503 497 | 7% |
| STORA ENSO R | 2 129 | 121 140 | 2% | | | | |
| Summa Materials | | 695 591 | 10% | Div. Finan. | | | |
| Industri | | | | KINNEVIK B | 1 011 | 127 285 | 2% |
| ABB LTD | 926 | 127 418 | 2% | RATOS B | 625 | 122 938 | 2% |
| Summa Industri | | 127 418 | 2% | Summa Div. Finan. | | 250 222 | 4% |
| Cap. Goods | | | | Realestate | | | |
| ALFA LAVAL | 1 246 | 127 341 | 2% | HUFVUDSTADEN A | 2 235 | 133 318 | 2% |
| ASSA ABLOY B | 783 | 123 088 | 2% | Summa Realestate | | 133 318 | 2% |
| ATLAS COPCO A | 1 113 | 127 995 | 2% | Finans | | | |
| HEXAGON B | 1 263 | 129 205 | 2% | INVESTOR B | 980 | 124 460 | 2% |
| LINDAB | 1 504 | 123 704 | 2% | Summa Finans | | 124 460 | 2% |
| NCC B | 1 040 | 121 680 | 2% | Telecom.serv | | | |
| SAAB B | 1 196 | 106 564 | 2% | MILLICOM INTERNA.SDB | 199 | 126 664 | 2% |
| SANDVIK | 1 340 | 128 774 | 2% | TELE2 B | 1 094 | 128 217 | 2% |
| SCANIA B | 1 078 | 129 360 | 2% | TELIASONERA | 2 630 | 132 420 | 2% |
| SKF B | 902 | 127 362 | 2% | Summa Telecom.serv | | 387 301 | 5% |
| TRELLEBORG B | 2 589 | 121 683 | 2% | Telecomm | | | |
| VOLVO B | 1 517 | 132 510 | 2% | ERICSSON B | 1 562 | 136 284 | 2% |
| Summa Cap. Goods | | 1 499 266 | 21% | Summa Telecomm | | 136 284 | 2% |
| Automob. & Component | | | | Media | | | |
| AUTOLIV SDB | 327 | 123 900 | 2% | MTG B | 303 | 130 351 | 2% |
| Summa Automob. & Component | | 123 900 | 2% | Summa Media | | 130 351 | 2% |
| Cons Durab. | | | | Tjänster | | | |
| ELECTROLUX B | 704 | 126 650 | 2% | SECURITAS B | 1 778 | 126 416 | 2% |
| HUSQVARNA B | 2 536 | 119 674 | 2% | Summa Tjänster | | 126 416 | 2% |
| Summa Cons Durab. | | 246 323 | 3% | Fastigheter | | | |
| Retailing | | | | CASTELLUM | 1 817 | 129 189 | 2% |
| HAKON INVEST | 1 088 | 114 893 | 2% | FABEGE B | 2 825 | 131 193 | 2% |
| HENNES O MAURITZ B | 560 | 120 736 | 2% | LUNDBERG FÖRETAGEN B | 359 | 125 112 | 2% |
| Summa Retailing | | 235 629 | 3% | SKANSKA B | 1 074 | 122 006 | 2% |
| Food.Staples Retaili | | | | Summa Fastigheter | | 507 500 | 7% |
| AXFOOD | 616 | 126 280 | 2% | | | | |
| ORIFLAME COSMET SDB | 319 | 129 865 | 2% | Summa finansiella instrument | | 6 241 570 | 88% |
| Summa Food.Staples Retaili | | 256 145 | 4% | Övriga tillgångar och skulder | | 884 315 | 12% |
| Food Beverag. Tobacco | | | | | | | |
| SWEDISH MATCH | 760 | 130 188 | 2% | Fondförmögenhet | | 7 125 885 | 100% |
| Summa Food Beverag. Tobacco | | 130 188 | 2% | | | | |

¹⁾ Siffrorna är avrundade till närmast hela procent.

SYSTEMATISKA®

Systematiska SVERIGE

Halvårsberättelse Jan - Juni 2010

RESULTRÄKNING **2010-03-18**
2010-06-30

INTÄKTER OCH VÄRDEFÖRÄNDRING

Värdeförändringen på innehavda finansiella instrument

| | |
|--------------------------------|-------------|
| Realisationsvinster | 26 |
| Realisationsförluster | 0 |
| Orealiserade vinster/förluster | -216 |
| Summa värdeförändring | -190 |

RÄNTEINTÄKTER

| | |
|-------------------------|---|
| Ränteintäkter bankkonto | 1 |
|-------------------------|---|

UTDELNINGAR

| | |
|--------------------|-----|
| Utdelningar aktier | 118 |
|--------------------|-----|

KOSTNADER

| | |
|---|-----|
| Ersättning till bolaget som driver fondverksamheten | -16 |
| Utländs utdelningsskatt | -1 |

Nettoresultat **-88**

BALANSRÄKNING **2010-06-30**

| | |
|---|-------|
| Kassa | 892 |
| Finansiella instrument med positivt marknadsvärde | 6 242 |
| Övriga tillgångar | 0 |
| Summa tillgångar | 7 134 |
| Övriga skulder | 8 |
| Fondförmögenhet | 7 126 |
| Summa skulder och eget kapital | 7 134 |

Poster inom linjen

| | |
|--|------|
| Erhållna säkerheter för utlånade värdepapper | Inga |
| Utlånade värdepapper | Inga |
| Ställda säkerheter för inlånade värdepapper | Inga |
| Ställda säkerheter för derivat | Inga |
| Övriga ställda säkerheter | Inga |

Förändring av fondförmögenhet (tkr) **2010-06-30**

| | |
|---|--------------|
| Fondförmögenhet vid årets början | 0 |
| Andelsutgivning | 10 396 |
| Andelsinlösen | -3 182 |
| Årets resultat enligt resultaträkning | -88 |
| Fondförmögenhet vid periodens slut | 7 126 |

SYSTEMATISKA®

Systematiska SVERIGE

Halvårsberättelse Jan - Juni 2010

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 2010-06-30 använts.

Stockholm den 25 augusti 2010

Arild Russ (VD)