

**KUVAUS**

Erikoissijoitusrahasto Systematica keskittyy etsimään ylireaktioita kansainvälisiltä osakemarkkinoilta. Rahaston tavoitteena on positiivinen tuotto keskipitkällä aikavälillä kaikissa markkinaolosuhteissa. Strategia perustuu suoriin osakesijoituksiin. Systematica etsii ylireaktioita matemaattisin perustein ja mallinnetusti. Rahaston kehitys on pitkällä aikavälillä neutraali osakemarkkinoiden yleiselle kehitykselle. Tarkemmat tiedot: Systematica -informaatiopaketti.

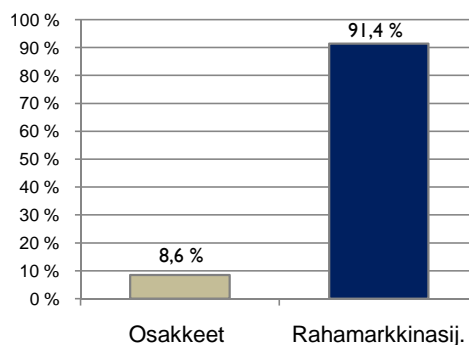
**KEHITYS RAHASTON ALOITUKSESTA 13.2.2009 ALKAEN KULUJEN JÄLKEEN\***

	Koko vuosi, %	% Tam	Hel	Maa	Huh	Tou	Kes	Hei	Elo	Syy	Lok	Mar	Jou
2009	0,36		-0,75	2,96	-2,93	0,76	0,66	0,04	-0,68	-1,48	1,47	-0,95	1,41
2010	4,62	1,81	0,86	0,5	-0,68	2,08	-0,02						
2011													
2012													
2013													

**TUOTTO- JA RISKILUKUJA\***

	EUR Systematica	EUR DJ Euro Stoxx	USD S&P 100
Tuotto			
Toukokuu 2010, %	-0,02	-1,42	-5,15
Aloituksesta, %	5,00	15,48	20,10
Viimeinen 3 kk, %	1,37	-12,21	-12,57
Viimeinen 12 kk, %	4,37	7,15	8,84
Riski			
Volatiliteetti, %	2,90	25,91	24,0897
Huonoin kuukausi, %	-2,93	-11,66	-11,01
Sharpe ratio, kk	-0,23	-0,67	-2,59
Korrelaatio		0,40	0,20

**SIJOTUSJAKAUMA KUUKAUDEN LOPUSSA**



**OSAKESIJOTUSASTE KUUKAUDEN AIKANA**

Kuukauden alussa, %	2,1
Kuukauden lopussa, %	8,6

**OSAKESIJOTUSTEN JAKAUMA KK:N LOPUSSA**

Eurooppa, %	2,6
Iso-Britannia, %	6,0
Yhdysvallat, %	0,0
Rahaston koko, EUR m	13,1

**KATSAUS**

Kesäkuun pörssikehitys oli ylöspäin olevan U-kirjaimen muotoinen. Kurssien heilunnan voimakkuutta mittaavat Vix ja VStoxx -indeksit heiluivat kolmenkymmenen (prosentin) molemmin puolin. BP plc, jonka pitemmänjänteen volatiliteetti on luokkaa 20, antoi ostosignaalin ja sitä on salkussa painolla 6.1%. Muiden osakesijoitusten osuus on 2.5%.

**\*VASTUUNRAJOITUSLAUSEKE**

Tämä katsaus on laadittu sellaisille sijoittajille, joiden uskotaan olevan kiinnostuneita sijoittamaan esiteltävään rahastoon. Katsauksen sisältöä ei tule pitää juridisena, taloudellisena tai muunakaan ohjeena, suosituksena tai kehoituksena. Katsauksessa esitettyjen tietojen on tarkoitus vain ja ainoastaan helpottaa sijoituspäätöksen tekemistä. Sijoittajien tulee erityisesti kiinnittää huomiota ja ottaa selvää sijoituspäätöksensä sisältäviin juridisiin, verotuksellisiin, taloudellisiin sekä muihin riskeihin sekä ymmärtää sijoituspäätöksen tekemiseen liittyvät seikat. Sijoittajan tulee omaa sijoituspäätöstä tehdessään hankkia itse riittävästi informaatiota omilta asiantuntijoiltaan. Katsausta ei ole laadittu ottaen huomioon kenenkään yksittäisen lukijan sijoitustavoitteita tai taloudellista tilannetta. Katsausta voidaan muuttaa ilman erillistä ilmoitusta. Katsauksen sisältö edustaa E. Ohman Jor Rahastoyhtiö Suomi Oy:n näkemystä ja arviota julkaisuhetkellä ja tiedot on annettu tiivistetyssä ja epätäydellisessä muodossa. Vaikka pyrkimyksenä on antaa mahdollisimman oikeita tietoja, Rahastoyhtiö tai sen kanssa samana konserniin kuuluva yhtiö eivät voi taata esitettyjen tietojen, arvioiden tai mielipiteiden oikeellisuutta tai täydellisyyttä, eivätkä vastaa mistään suorista tai epäsuorista kuluista, vahingoista tai menetyksistä, joita materiaalin tai siinä esitettyjen tietojen käyttö voi aiheuttaa. Historiallinen tuotto ja riski eivät ole tae tulevasta. Sijoitusten arvo voi nousta tai laskea ja sijoittaja saattaa menettää osan sijoittamistaan varoista. Sijoittajan on tutustuttava Systematica -informaatiopakettiin (mm. esite, säännöt ja tietoa Ohmanin toimintaperiaatteista ja kaupankäynnin riskeistä) ennen sijoituspäätöstä.



Tilaa informaatiopaketti: 09 - 8866 6096 tai info@ohmangroup.fi