

KUVAUS

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

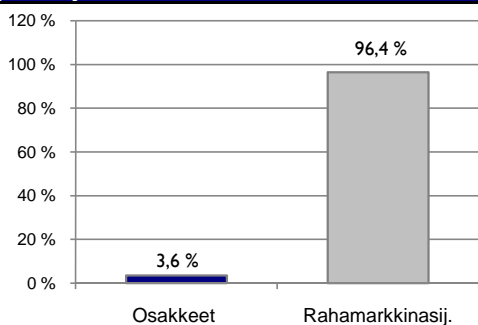
KEHITYS RAHASTON ALOITUKSESTA 15.6.2009 ALKAEN KULUJEN JÄLKEEN*

	Koko vuosi, %	% Tam	Hel	Maa	Huh	Tou	Kes	Hei	Elo	Syy	Lok	Mar	Jou
2009	1,39						0,00	0,05	-0,17	-0,47	-0,49	0,42	2,06
2010	3,10	0,54	0,72	0,74	-0,02	0,79	-0,11	0,47	-0,08				
2011													
2012													
2013													

TUOTTO- JA RISKILUKUJA*

SIIJOITUSJAKAUMA KUUKAUDEN LOPUSSA

	EUR System. L-O	EUR DJ Euro Stoxx	USD S&P 100
Tuotto			
Elokuu 2010, %	-0,08	-4,35	-4,96
Aloituksesta, %	4,53	17,71	22,17
Viimeinen 3 kk, %	0,29	0,49	-3,51
Viimeinen 12 kk, %	4,66	-5,49	0,21
Riski			
Volatiliteetti, %	0,39	20,44	16,6745
Huonoin kuukausi, %	-0,49	-7,33	-8,7399
Sharpe ratio	-4,15	-2,59	-3,61
Korrelaatio		0,11	0,14



SIIJOITUSASTE KUUKAUDEN AIKANA

OSAKESIIJOITUSTEN JAKAUMA KK:N LOPUSSA

Kuukauden alussa, %	0,0	Eurooppa, %	3,6
		Iso-Britannia, %	0,0
Kuukauden lopussa, %	3,6	Yhdysvallat, %	0,0
		Rahaston koko, EUR m	5,7

KATSAUS

Elokuun pörssikehitys oli ensimmäisen rajun nousupäivän jälkeen pääosin laskeva. Laskevalla markkinalla heilunta usein kasvaa - näin nytkin, tosin varovasti. Euroopan ja USA:n volaindeksit nousivat 2 (eur) ja 3 (us) prosenttiyksikköä (implisiittinen). Systematican mallin aktiivisuus tulee kasvamaan. Malli on laajennettu kattamaan noin tuhat yritystä. "Laajennetun sijoitusuniversumin" tuoma ensimmäinen ostosignaali tuli juuri noin viikko sitten: Sveitsissä listattu öljyalan yhtiö Petroplus.

***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 kehotuksena. 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. Öhman 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 samaan 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 Öhmanin toimintaperiaatteista ja kaupankäynnin riskeistä) ennen sijoituspäätöstä.



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