

OPM Alfa L

NAV-kurs: 102,08
Avkastning januari: 2,08%

Fonden i korthet

OPM Alfa L investerar i fonden OPM Alfa SEK med belåning. I normalfallet är fonden exponerad tre gånger mot underliggande fond. Lånevillkoren är mycket fördelaktiga där krediten hanteras av SEB. OPM Alfa förvaltas efter en strukturerad process som utvecklats sedan 2003 som förenklat bygger på att identifiera de talangfullaste förvaltarna i de attraktivaste strategierna för att sedan kombinera dessa i effektiva portföljer. Mer information hittar Ni på www.optimized.se.

OPM är ett oberoende svenskt fondbolag som erbjuder systematiskt förvaldade fonder inom alternativa tillgångsslag. Nyckeln för fondbolagets strategi är att leverera kompletterande investeringar till institutionella portföljer bestående av i huvudsak aktier och obligationer. OPM är idag en av Europas ledande aktörer inom analys och utvärdering av internationella hedgefonder. OPM är reglerat av Finansinspektionen och delägt av Carnegie. Mer information hittar Ni på www.optimized.se.

Månatliga avkastningar *

| | Jan | Feb | Mar | Apr | Maj | Jun | Jul | Aug | Sep | Okt | Nov | Dec | Totalt |
|------|------|-----|-----|-----|-----|-----|-----|-----|-----|-----|-----|-----|--------|
| 2012 | 2,1% | | | | | | | | | | | | 2,1% |
| 2011 | | | | | | | | | | | | | |
| 2010 | | | | | | | | | | | | | |
| 2009 | | | | | | | | | | | | | |
| 2008 | | | | | | | | | | | | | |
| 2007 | | | | | | | | | | | | | |
| 2006 | | | | | | | | | | | | | |
| 2005 | | | | | | | | | | | | | |

Fondfakta

| | |
|--|---------------------|
| Placeringsinriktning | Globala Hedgefonder |
| Investerar i OPM Alfa SEK | |
| Belåningsgrad | 2 |
| Förvaltningsavgift OPM Alfa SEK | 0,75% |
| Prestationsbaserad avgift OPM Alfa SEK | 10% |
| Kursnotering | Månadsvis |
| Inlösen | Kvartalsvis |
| Valuta | SEK |
| Domicil | Sverige |
| Startdatum | 31 januari, 2012 |
| Administratör | Wahlstedt Sageryd |
| Revisor | PwC |
| Minsta initiala investering | 100 000 SEK |
| Bloomberg-kod | - |
| ISIN-kod | SE0004356897 |

Nyckeltal *

| | |
|--------------------------------|--------|
| Avkastning sedan start | 2,1% |
| Avkastning (12 månader) | 2,1% |
| Standardavvikelse | |
| Standardavvikelse (12 månader) | |
| Down side risk | |
| Down side risk (12 månader) | |
| Value at risk 1% (månad) | |
| Beta v.s. MSCI World | |
| Korrelation | |
| Konsistens | |
| Andel positiva månader | 100,0% |
| Sharpekvot | |
| Sortinokvot | |
| Treynorkvot | |

Nyckeltal - Nuvarande hedgefondportfölj

** Baserat på OPM Alfa SEK och aktuell belåningsgrad

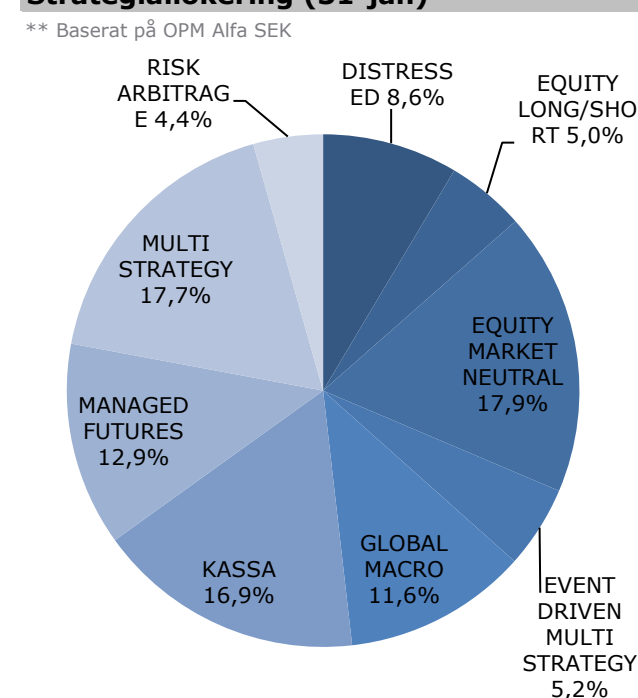
| | |
|-----------------------------------|-------|
| Avkastning (12 månader) | -0,6% |
| Standardavvikelse (12 månader) | 7,4% |
| Beta v.s. MSCI World (12 månader) | 0,13 |
| Avkastning (36 månader) | 20,8% |
| Standardavvikelse (36 månader) | 9,6% |
| Beta v.s. MSCI World (36 månader) | 0,29 |

Exponering - Topp 5 (31-jan)

** Baserat på OPM Alfa SEK

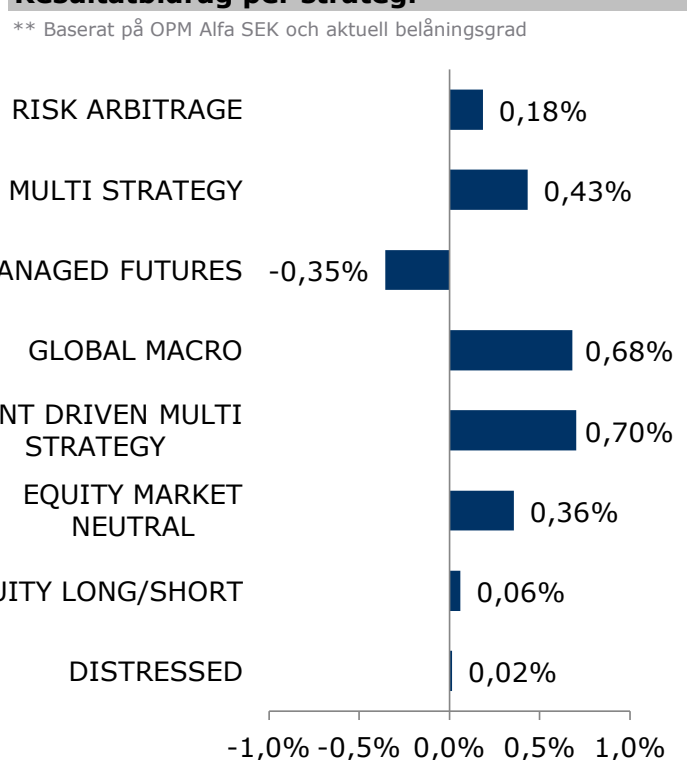
| | |
|------------------------------|------|
| ATLAS GLOBAL | 5,5% |
| MACQUARIE ASIAN ALPHA | 5,4% |
| CLAREN ROAD CREDIT | 5,0% |
| PLATINUM PARTNERS VALUE ARB. | 4,9% |
| BREXAN HOWARD CLASS B | 4,6% |

Strategiallokering (31-jan)



Avkastningsfördelning *

Resultatbidrag per strategi



Risk/ Avkastning *

DISCLAIMER

OPM Alfa L (Fonden) är en specialfond enligt lagen (2004:46) om investeringsfonder. Sålunda är Fonden inte en så kallad UCITS-fond. Informationen häri kompletteras av den information som finns i informationsbroschyren och fondbestämmelserna för Fonden. Dessa kan erhållas från Optimized Portfolio Management Stockholm AB. Andelarna i Fonden har inte registrerats och kommer inte att registreras utanför Sverige. Utländsk lag kan innebära att en investering inte får göras av investerare utanför Sverige. Optimized Portfolio Management Stockholm AB har inget som helst ansvar för att kontrollera att en investering från utlandet sker i enlighet med sådant lands lag. Det finns inga garantier för att en investering i Fonden ger en god avkastning, trots en positiv utveckling på de finansiella marknaderna. Det finns inga garantier för att en investering i Fonden inte kan leda till förlust. Historisk avkastning är ingen garanti för framtida avkastning. Alla beslut om investering i Fonden bör baseras på informationen i informationsbroschyren och faktabladet. En investering i Fonden bör betraktas som en långsiktig investering. Tvist rörande information om Fonden eller Fonden skall avgöras enligt svensk lag och av svensk domstol exklusivt.