

OPM Alfa SEK

NAV-kurs: 119,4431
Avkastning januari: 0,95%

Fonden i korthet

OPM Alfa är en fondandelsfond som investerar i en bred portfölj av internationella hedgefonder. Fonden är konstruerad för att utgöra en attraktiv komponent i institutionella portföljer. Genom att fonden handlas med kvartalsvis likviditet kan fonden investera relativt fritt bland världens ledande förvaltare. Fonden 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. OPM Alfa startade i juli 2004 och har sedan starten väsentligt slagit HFRX Global HF Index med betydligt lägre risk.

OPM är ett oberoende svenskt fondbolag som erbjuder systematiskt förvaltade 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	1,0%												1,0%
2011	1,0%	0,6%	-0,3%	0,5%	-1,4%	-1,5%	0,4%	-2,1%	-0,7%	-0,3%	-0,3%	-0,2%	-4,2%
2010	0,7%	0,0%	1,2%	1,3%	-1,1%	-0,5%	0,5%	0,6%	0,0%	0,8%	-0,2%	1,8%	5,3%
2009	2,0%	0,1%	-0,1%	1,2%	1,1%	1,3%	1,4%	0,6%	0,9%	0,1%	0,7%	1,0%	10,8%
2008	-1,1%	1,3%	-0,6%	1,1%	1,2%	0,3%	-0,7%	-0,4%	-6,0%	-5,3%	-5,4%	0,7%	-14,3%
2007	1,0%	0,6%	0,5%	1,4%	1,1%	-0,7%	-0,5%	-2,8%	1,1%	2,0%	-0,9%	0,6%	3,2%
2006	1,4%	0,9%	0,9%	0,7%	-1,1%	-0,4%	-0,3%	0,8%	0,7%	1,1%	1,3%	1,7%	7,9%
2005	1,2%	0,9%	0,6%	0,1%	0,9%	1,5%	1,0%	0,3%	1,1%	-1,8%	0,8%	0,7%	7,6%

Fondfakta

Placeringsinriktning	Globala Hedgefonder
Förvaltningsarvode	0,75%
Prestationsbaserat arvode	10%
High water mark	Ja
Kursnotering	Månadsvis
Inlösen	Kvartalsvis
Valuta	SEK
Fondstruktur	Svensk specialfond
Domicil	Sverige
Startdatum	30 juni, 2004
Administratör	Wahlstedt Sageryd
Revisor	PwC
Minsta initiala investering	1 000 000 SEK
Bloomberg-kod	OPMALFA SS EQUITY
ISIN-kod	SE0001201716

Nyckeltal

Avkastning sedan start	23,4%
Avkastning (12 månader)	-4,2%
Standardavvikelse	4,9%
Standardavvikelse (12 månader)	3,2%
Down side risk	5,7%
Down side risk (12 månader)	2,5%
Value at risk 1% (månad)	3,3%
Beta v.s. MSCI World	0,17
Korrelation	0,62
Konsistens	42,9%
Andel positiva månader	69,2%
Sharpekvot	0,16
Sortinokvot	0,14
Treynorkvot	0,04

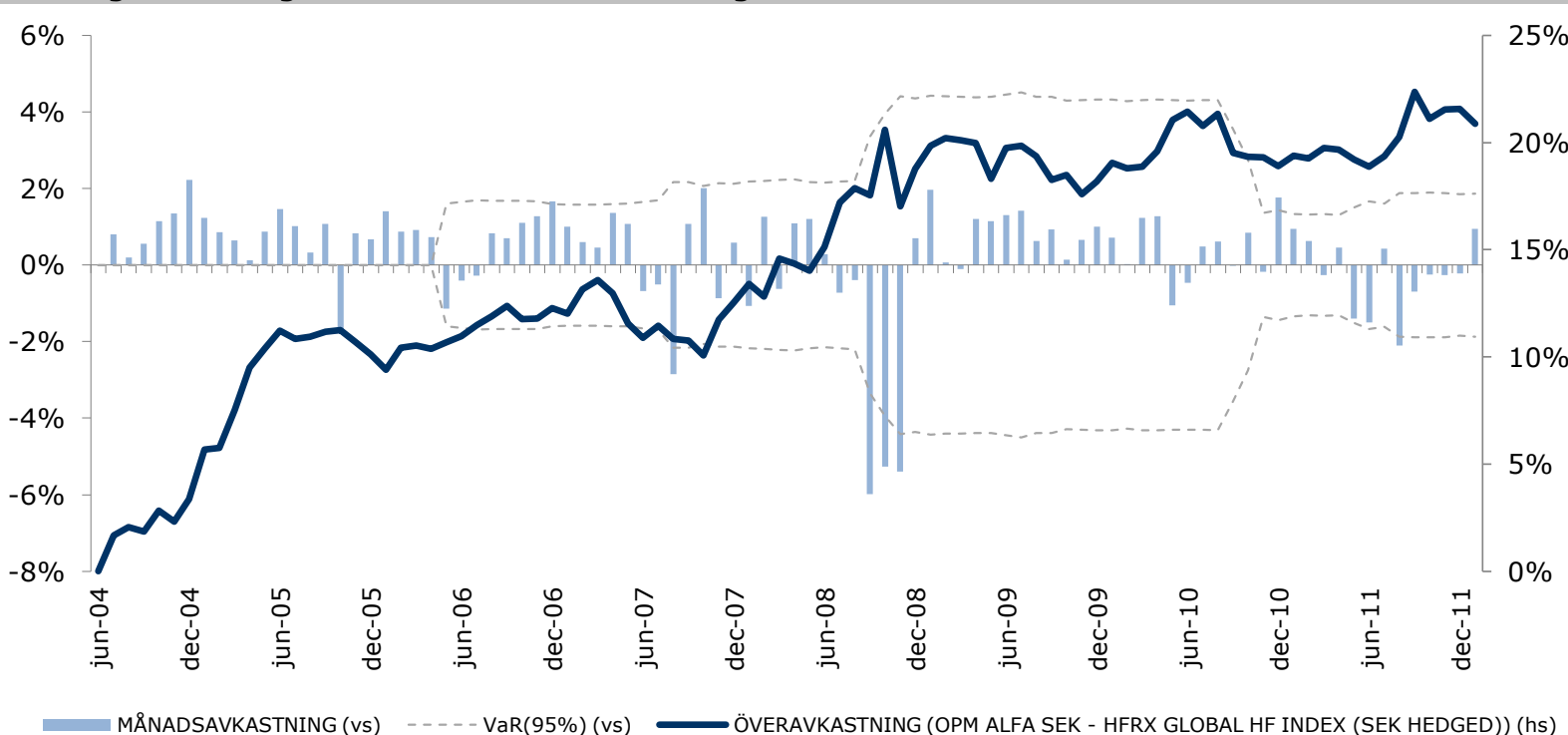
Nyckeltal - Nuvarande hedgefondportfölj

Antal innehav	25
Avkastning (12 månader)	2,6%
Standardavvikelse (12 månader)	2,5%
Beta v.s. MSCI World (12 månader)	0,04
Avkastning (36 månader)	8,9%
Standardavvikelse (36 månader)	3,2%
Beta v.s. MSCI World (36 månader)	0,10

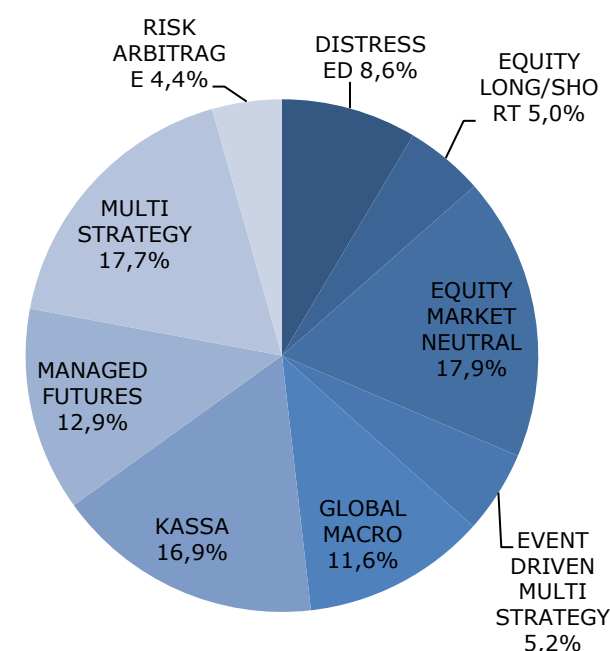
Exponering - Topp 5 (31-jan)

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%

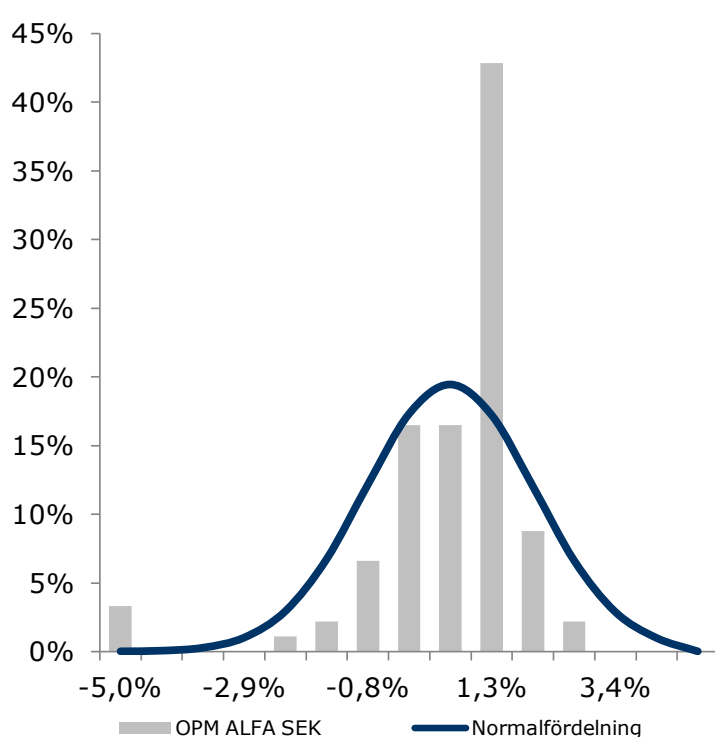
Månatlig avkastning och kumulativ överavkastning



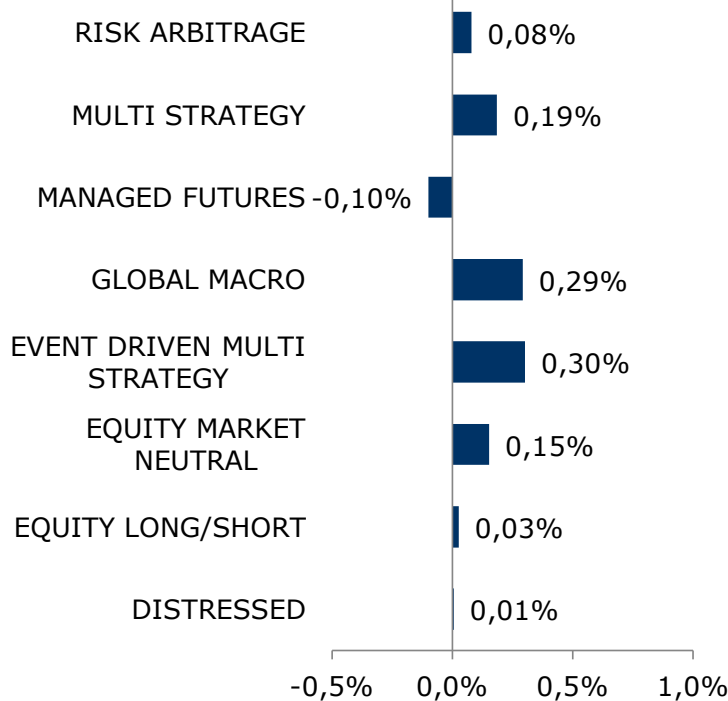
Strategiallokering (31-jan)



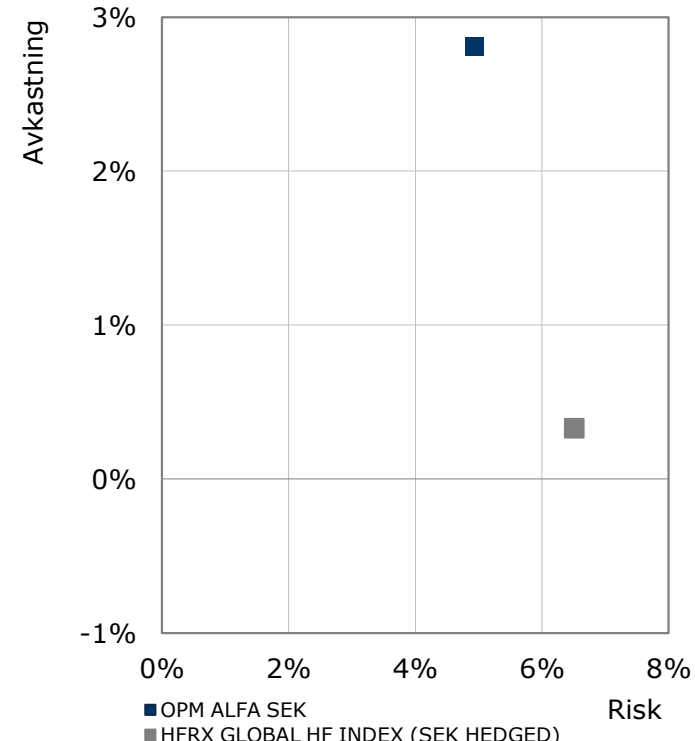
Avkastningsfördelning



Resultatbidrag per strategi



Risk/ Avkastning



DISCLAIMER

OPM Alfa SEK (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.