

OPM Omega

NAV-kurs: 127,8966
Avkastning januari: 1,45%

Fonden i korthet

OPM Omega är en fondandelsfond som investerar i en portfölj av internationella hedgefonder vilka förväntas uppvisa en låg systematisk korrelation med aktiemarknader. Fonden är konstruerad för att vara en optimal komponent i traditionella pensionsportföljer och ett tydligt substitut för räntebärande placeringar. 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 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	1,5%												1,5%
2011	0,4%	0,7%	-0,5%	0,7%	-1,5%	-1,2%	0,3%	-0,5%	0,7%	0,0%	0,2%	-0,1%	-0,9%
2010	-0,4%	1,0%	0,8%	0,4%	0,0%	-0,5%	-0,3%	0,5%	0,2%	0,9%	-0,7%	0,9%	2,9%
2009	1,8%	-0,2%	0,3%	0,5%	1,0%	-0,3%	0,8%	1,0%	0,9%	0,2%	0,2%	-0,7%	5,7%
2008	-1,2%	2,0%	-1,7%	0,4%	1,6%	1,3%	-1,2%	-0,3%	-4,1%	-1,8%	-0,8%	0,4%	-5,3%
2007	1,0%	0,1%	0,8%	0,8%	2,2%	1,1%	0,4%	-3,5%	2,3%	2,0%	-1,4%	-0,9%	4,9%
2006	2,3%	0,2%	1,4%	2,4%	-2,1%	-1,7%	-1,2%	-1,1%	-0,4%	1,2%	1,3%	1,9%	4,2%
2005	0,3%	1,2%	-0,6%	-1,7%	0,4%	1,7%	1,7%	0,7%	1,5%	-3,6%	1,4%	1,7%	4,7%

*Per 20120131 slogs OPM Omega SEK och OPM Global Hedge samman. Gråmarkerade fält visar realiserad avkastning för OPM Omega SEK april 2008 - december 2011, dessförinnan realiserad avkastning för OPM Global Hedge

Fondfakta

Placeringsinriktning	Globala Hedgefonder
Förvaltningsarvode	1,00%
Prestationsbaserat arvode	10%
High water mark	Ja
Kursnotering	Månadsvis
Inlösen	Månadsvis
Valuta	SEK
Fondstruktur	Svensk specialfond
Domicil	Sverige
Startdatum	31 januari, 2012
Administratör	Wahlstedt Sageryd
Revisor	PwC
Minsta initiala investering	1 000 000 SEK
Bloomberg-kod	-
ISIN-kod	SE0004356962

Nyckeltal

Avkastning sedan start	30,8%
Avkastning (12 månader)	0,2%
Standardavvikelse	4,3%
Standardavvikelse (12 månader)	2,9%
Down side risk	3,5%
Down side risk (12 månader)	2,0%
Value at risk 1% (månad)	2,9%
Beta v.s. MSCI World	0,12
Korrelation	0,45
Konsistens	39,4%
Andel positiva månader	65,4%
Sharpekvot	0,23
Sortinokvot	0,29
Treynorkvot	0,09

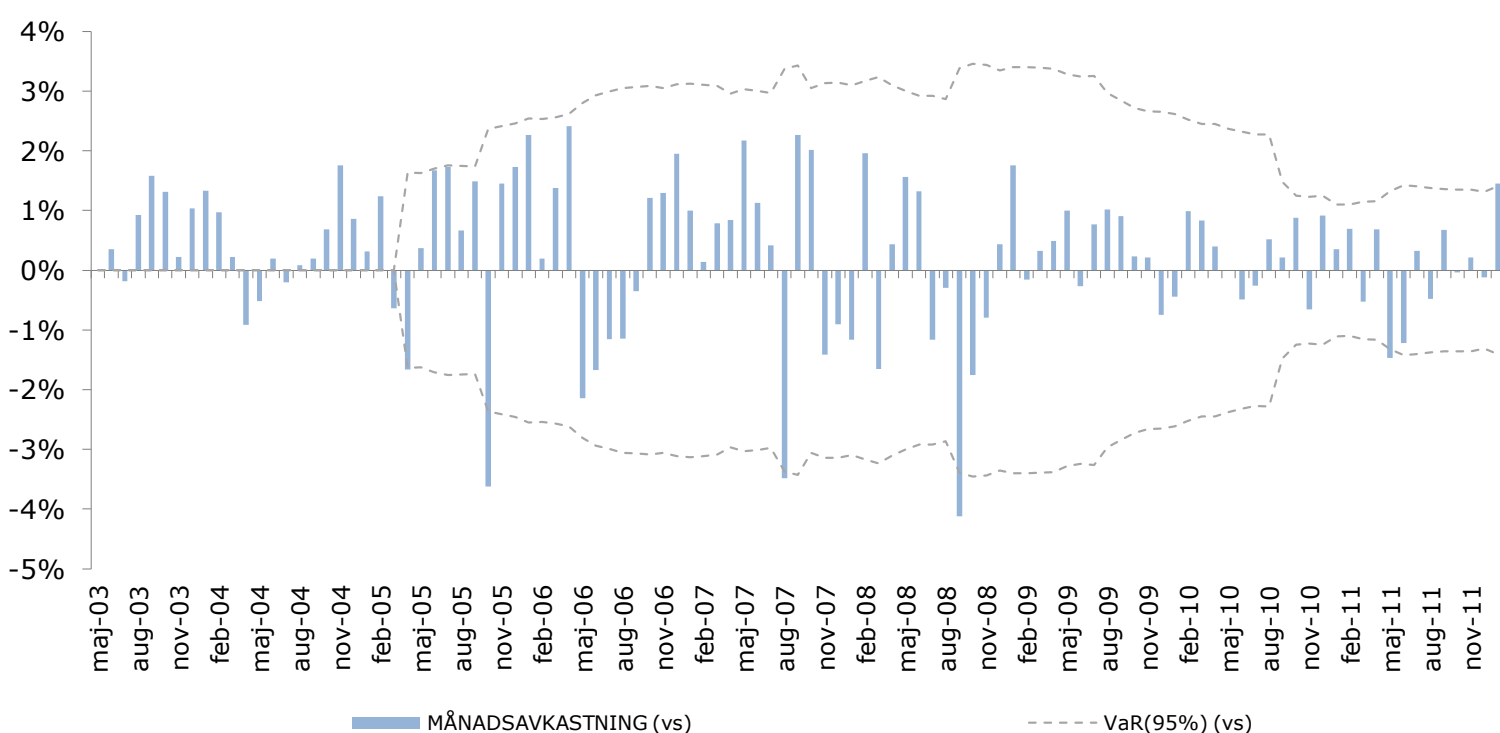
Nyckeltal - Nuvarande hedgefondportfölj

Antal innehav	21
Avkastning (12 månader)	3,0%
Standardavvikelse (12 månader)	2,9%
Beta v.s. MSCI World (12 månader)	0,13
Avkastning (36 månader)	8,5%
Standardavvikelse (36 månader)	3,3%
Beta v.s. MSCI World (36 månader)	0,08

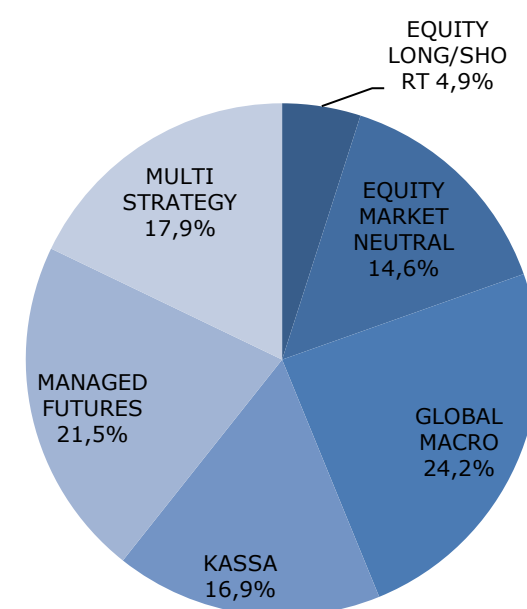
Exponering - Topp 5 (31-jan)

MACQUARIE ASIAN ALPHA	6,7%
MOORE EMERGING MARKETS FIC	6,1%
GLG ALPHA SELECT	5,8%
PLATINUM PARTNERS LIQUID OPP.	5,5%
STRATUS 1.5X	5,4%

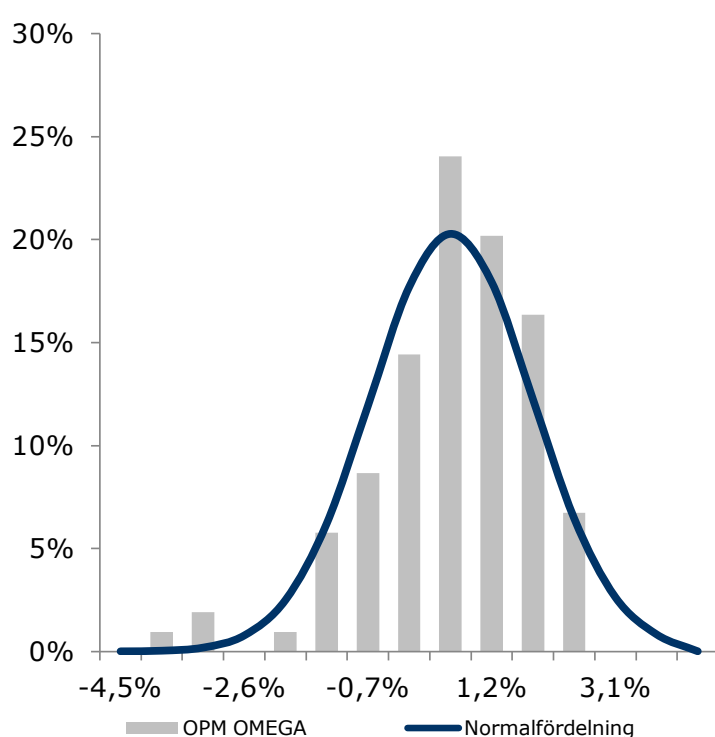
Månatliga avkastningar



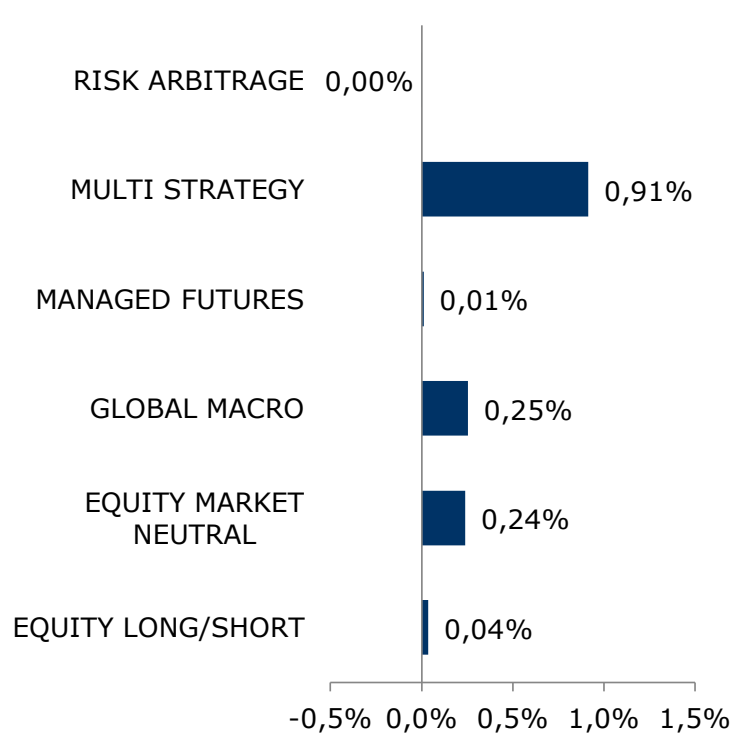
Strategiallokering (31-jan)



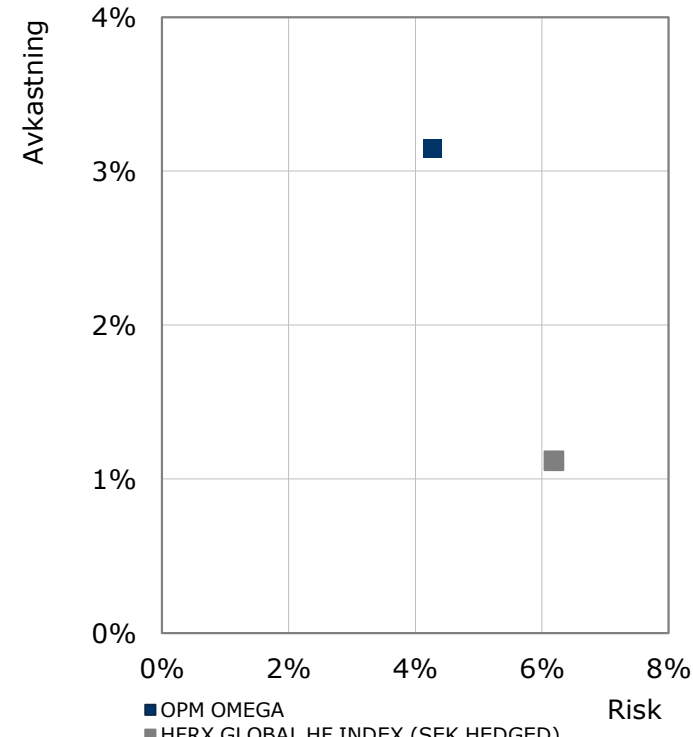
Avkastningsfördelning



Resultatbidrag per strategi



Risk/ Avkastning



DISCLAIMER

OPM Omega (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.