

Kat: Hedge Fonds  
 Stil: Directional/Opportunistic  
 Strat: Global Macro  
 UCITS Konform: Nein

# Hedgeweb Sample Fund Outperformer Ltd

Report vom: 09.05.2012

Rechtsform: Limited Liability Company  
 Gründungsdatum: 04/2004  
 Domizil: United Kingdom - Großbritannien  
 Portfolio Manager: Hedgeweb Sample Co.  
 NAV per 03/2008: 120,00

Stockticker: HEWE (LSE-AIM)  
 Ticker: HEWEOP (Bloomberg)  
 Volumen: 100,00 Mio GBP  
 Lead Manager: John Doe III

## Kontakt:

**Hedgeweb Sample Co.**  
 190, Route de Thionville  
 2611 Luxembourg  
 Luxembourg

www.hedgeweb.net  
 global@hedgeweb.net  
 Tel: +352-20 20 20 20 20 | Fax: +352 20 20 20 20

## Übersicht:

Das Anlageziel ist eine hohe absolute Rendite, bei gleichzeitig konservativem Risikomanagement zu erzielen. Die jährliche Zielrendite liegt bei 15 Prozent, mit einer Volatilität von 6-7% und einem Max Drawdown von 3-4%. Dabei legen wir Wert auf eine möglichst geringe Korrelation zu globalen Aktien- und Fixed-Income-Märkten.

Jahr	YTD	Jan	Feb	Mrz	Apr	Mai	Jun	Jul	Aug	Sep	Okt	Nov	Dez
2008	-1,05	-0,68	0,63	-1,00	--	--	--	--	--	--	--	--	--
2007	3,89	-2,36	1,15	1,23	-0,58	1,70	-1,55	-1,89	1,90	2,30	-0,55	0,88	1,74
2006	13,25	-1,00	4,00	3,00	2,00	-1,00	-3,00	5,00	2,20	-0,50	1,30	-0,45	1,25
2005	37,19	2,00	7,00	4,00	-3,00	-2,00	-4,00	5,00	8,00	9,00	3,00	1,00	3,00
2004	12,05	--	--	--	3,00	4,00	-5,00	6,00	2,00	1,00	-3,00	5,00	-1,00

## Portfolio Statistik und Analyse\*

### Seit Gründung

Positive Monate:	30	Ø Gewinn pos. Monate:	3,11%
Negative Monate:	18	Ø Verlust neg. Monate:	-1,81%
Max. Leverage:	1.5:1	Längste Verlustperiode:	3 Monat(e)
Maximum Drawdown:	8,74%	Höchster Gewinn (09/2005):	9,00%
Best 12 Mo. (08/2005-08/2006):	37,58%	Größter Verlust (06/2004):	-5,00%
Worst 12 Mo. (09/2006-09/2007):	1,08%		

### Letzte 36 Monate

Alpha:	11,29%	Sortino:	1,80
Beta:	0,148	Sharpe:	0,90
R <sup>2</sup> :	0,017	Calmar:	1,38
Volatilität:	9,95%	Kurtosis:	1,07
Down Deviation:	1,36%	Skewness:	0,83

## Drawdown Analyse (seit Gründung)

Tiefe	Dauer	Erholung	Anfang	Tief
8,74%	3	2	4/2005	6/2005
5,00%	1	1	6/2004	6/2004
3,97%	2	1	5/2006	6/2006

## Drawdown Analyse (letzte 36 Monate)

Tiefe	Dauer	Erholung	Anfang	Tief
8,74%	3	2	4/2005	6/2005
3,97%	2	1	5/2006	6/2006
3,41%	2	2	6/2007	7/2007

\* Wertentwicklung: Nach Abzug aller Gebühren | Risk free rate=3%  
 Alpha, Volatilität, Sharpe und Sortino = annualisierte Werte | Vergleichsindex: S&P 500



## Vermögensallokation

**Long:** 130%  
**Short:** 40%  
**Net:** 90%  
**Aktien:** 10%  
**Anleihen:** 10%  
**Rohstoffe:** 45%  
**Derivative:** 10%  
**Währungen:** 10%  
**Liquidität:** 10%  
**High Yield:** 5%

## Regionale Allokation

**Australien/NZ/Ozeanien:** 5%  
**BRIC-Staaten:** 5%  
**Ost-Europa:** 10%  
**Emerging Markets:** 10%  
**Japan:** 5%  
**Nord Amerika:** 10%  
**Südamerika:** 5%  
**West-Europa:** 20%  
**South Africa:** 5%

**Administrative Daten****Wirtschaftsprüfer:**

Young, Cooper & Ernest  
10 Palace Road  
SE1 7EU London

**Prime Broker:**

HSBC Bank plc  
Harcourt Street  
Dublin

**Administrator:**

International Fund Services Ltd  
Bishop's Square  
Dublin

**Custodian:**

McAbbey  
Riverside  
Dublin

**Investmentdetails**

Basiswährung: GBP  
Min. Investment: 25.000 GBP  
Folgeinvestment: 25.000 GBP  
Mindestanlagedauer: 60 Tage  
Rücknahmeintervall: Monatlich  
Akzeptierte Investoren:

- Privat
- Institutionell
- Professionell
- Vermögensverwaltung
- Unternehmen
- Staatsfonds

Kapitalgarantie: Nein  
Wertermittlung: Monatlich  
Offen für neue Investoren: Ja

**Gebühren**

Managementgebühr (jähr.): 1,50%  
Erfolgsgebühr: 10,00%  
Ausgabeaufschlag: --  
Rücknahmegebühr:  
1 % within first 6 months  
Sonst. Geb.: 0.3%  
High Watermark: Ja  
Hurdle Rate: LIBOR +1.5

**Hedgeweb Sample Fund Outperformer Ltd****Management Company:****Hedgeweb Sample Co.**

Gründungsdatum: 05/2000  
Aufsichtsbehörde: SEC  
Anzahl Fonds unter Management: 2  
Verwaltetes Vermögen gesamt: 185,00 Mio USD

Jährl. Rendite	2008	2007	2006	2005	2004	2003
Fonds	-1,05 (03/2008)	3,89	13,25	37,19	12,05	--
Peer Group	-20,36	13,23	15,31	13,24	12,13	24,59
S&P 500	-38,49	3,53	13,62	3,00	8,99	26,38

Peer Group= Morgan Hedge - Hedge Fonds Universe

	<u>Seit Gründung</u>	<u>Letzte 36 Monate</u>
Kumulierte Rendite:	78,95%	40,70%
Aufgezinstе jährl. Rendite (CAGR):	15,66%	12,06%
Aufgezinstе monatl. Rendite:	1,22%	0,95%
Durchschn. monatl. Rendite:	1,27%	0,99%

**Investment Manager:**John Doe II

John Doe is the CEO of Hedgeweb Sample Co. After graduating from college in 1985 he worked for several high profile Investment Banks. In 1995 he founded his first hedge fund Y2K Partners which was very successful and later sold to Bear Stearns in 1999. In 2000 he founded Hedgeweb Sample Co.

**Beschreibung:**

Erzielung von unkorrelierten, absoluten Erträgen in jeder Marktlage. Kapitalerhalt und geringe Volatilität stehen im Vordergrund.

**Haftungsausschluss:**

Trotz größtmöglicher Sorgfalt kann die Richtigkeit und Vollständigkeit der Informationen nicht garantiert werden. Die historische Wertentwicklung ist keine Indikator für zukünftige Wertentwicklungen.

Eine Anlage in dem vorgeannten Fonds/Investmentprogramm ist möglicherweise nicht für jeden geeignet und abhängig von speziellen Kenntnissen, gesetzlichen Bestimmungen und persönlichen Anlagezielen. Diese Informationen dürfen ohne Einverständnis von Morgan Hedge nicht weitergegeben, vervielfältigt, kopiert oder veröffentlicht werden. Sie dienen ausschließlich Informationszwecken und sind registrierten Nutzern des Morgan Hedge Internet-Portals vorbehalten.

Dieser Report stellt keine Anlageberatung dar. Es gelten die allgemeinen Nutzungsbedingungen.