



INSINGER DE BEAUFORT

BNP PARIBAS WEALTH MANAGEMENT

MULTI-MANAGER FUNDS >> MAANDOVERZICHT

(CONFORM ARTIKEL 50 LID 2 Bgfo)

Absolute Return Strategy SICAV - Directional Managers

30 juli 2010

Netto vermogenswaarde	\$	62.801.232
Aantal uitstaande participaties A klasse (USD)		15.217
Intrinsieke waarde per participatie A klasse (USD)	\$	115,53
Aantal uitstaande participaties B klasse (EUR)		447.776
Intrinsieke waarde per participatie B klasse (EUR)	€	104,16

Vermogenssamenstelling	% van nvw
Beleggingsfondsen	83,45%
Bank	13,52%
Overig	3,03%
Totaal	100,00%

Beleggingsportefeuille	Kostprijs (USD)	Marktwaaarde (USD)	%
Altima Global Special Situations Fund Class B Various Series-17	2.569.525	2.635.387	4,20%
Altima Global Special Situations Fund Class B Various Series-20	3.055.426	3.352.370	5,34%
Castlerigg FS02 0109	2.095.301	2.285.160	3,64%
Castlerigg SCS02 0109	478.001	471.492	0,75%
Comac Glob Macro Fund Eur Cap	3.027.045	2.793.755	4,45%
Davidson KDOI A Tr 2 01Jan10	5.000.000	8.921.553	14,21%
Egerton European Equity Fund Class B	2.333.557	3.763.103	5,99%
Global Trading Strategies D	2.500.024	2.334.499	3,72%
Horizon Port 1 EUR Vot Shs	3.665.250	3.935.218	6,27%
Ionic Capital Int	3.000.000	2.869.209	4,57%
JPMIF High St Mkt N SHS B EC	2.553.740	2.146.307	3,42%
OZ Europe OVS II Prime 33	3.000.000	3.075.859	4,90%
The Raptor Private Holdings	1.173.880	764.859	1,22%
Rohatyn Group Asia Opp A5 NI	2.500.000	2.402.226	3,83%
The Tell Fund	1.460.425	4.104.487	6,54%
Westlb Horizon MM Target A Cap	2.559.690	2.301.639	3,66%
Winton Futures Fund Ltd, Class B Lead series 16 / 11	2.589.334	4.251.511	6,77%
Totaal Beleggingsfondsen	43.561.198	52.408.633	83,45%

Aan deze opgave kunnen geen rechten worden ontleend. De cijfers zijn niet door de externe accountant gecontroleerd.

Insinger de Beaufort Asset Management N.V. • Herengracht 537, 1017 BV Amsterdam • T +31 (0)20 5215 000
F +31 (0)20 5215 009 • www.insinger.com • Handelsregister Nr. 330055195 • Geregistreerd bij de Autoriteit Financiële Markten