

in depth in focus in front



Man AHL Diversified Markets EU

Monthly summary report | As at 30 June 2008 NAV per unit EUR 32.81 | Total NAV EUR 472,692,588 | No. units 14,406,776

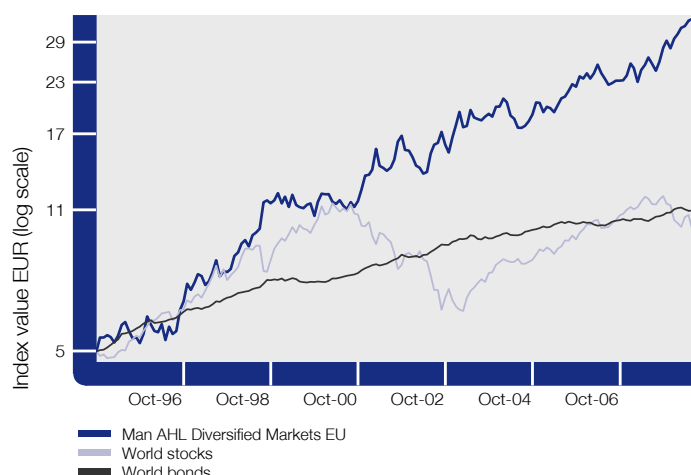
AHL experienced another positive month as equities fell sharply and crude oil surged to new highs. Amid highly volatile markets, the Programme has significantly outperformed major equity indices over the last 12 months.

The majority of gains were accrued from trading in the energy, agriculturals and short-term interest rate sectors. Commodities proved particularly profitable with our long positions in natural gas continuing to drive gains. Prices rose sharply buoyed by increased demand from the power sector as users shifted away from record crude oil prices. Returns were also accrued from the metals sector as copper positions were boosted by a miner's strike in Peru towards the end of the month. Within the agricultural sector, our long positions in corn performed well as the commodity continued its record-breaking run on increased concern about the outlook for this year's harvest. Returns were also secured from trading in the short-term interest

rate sector, particularly from short positions in Euribor contracts. Prices fell on heightened speculation that the European Central Bank would lift interest rates after eurozone inflation continued to rise. On the negative side, profits were slightly offset by long positions in the Canadian dollar against the US dollar on rising expectations that the Bank of Canada would cut interest rates.

Performance chart

1 November 1994 to 30 June 2008



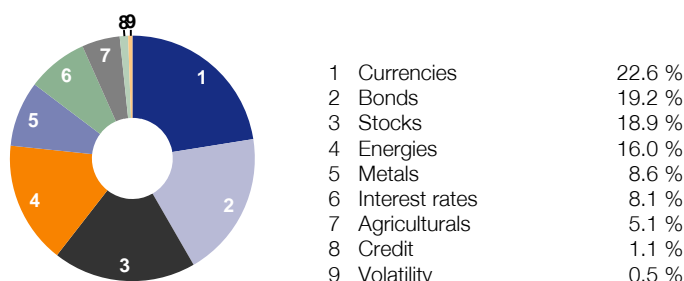
Performance statistics

1 November 1994 to 30 June 2008

	Product	World stocks	World bonds
Last month	1.2 %	-8.3 %	0.1 %
Last quarter	5.5 %	-1.5 %	-1.8 %
Year to date	19.1 %	-13.5 %	1.1 %
Last 12 months	25.8 %	-16.8 %	6.4 %
Last calendar year	17.5 %	2.8 %	4.7 %
Total return	623.0 %	106.5 %	131.0 %
Annualised return	15.6 %	5.4 %	6.3 %
Annualised volatility	17.5 %	13.5 %	3.0 %
Sharpe ratio	0.70	0.19	0.85
Worst drawdown	-20.2 %	-47.3 %	-2.5 %
Correlation		-0.13	0.36

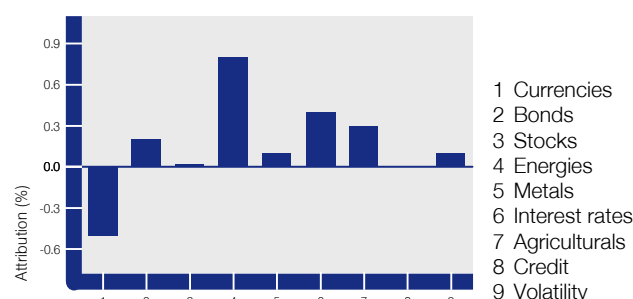
Sector allocations

As at 30 June 2008



Sector attribution

June 2008



Man AHL Diversified Markets EU

Monthly summary report | As at 30 June 2008

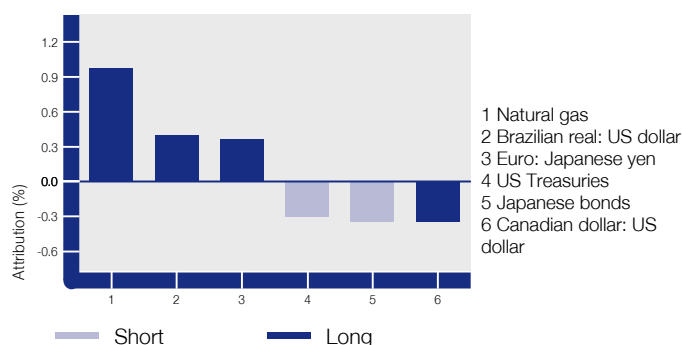
Economic highlights

June 2008

- June saw oil prices surge to a record above US\$143 per barrel, driven higher by supply concerns, US dollar weakness and heightened tensions in the Middle East. With commodity prices soaring and economic growth slowing, stagflation fears intensified over the month. With this in mind, the Bank of England, European Central Bank and Federal Reserve all left rates unchanged during the month.
- Global equities suffered a sharp sell-off, with the financial sector driving losses, after persistent speculation that further sub-prime related writedowns were imminent. The FTSE 100 and S&P 500 lost around 7% and 9%, respectively, while the MSCI Asia Pacific fell 8.8%. The slide in equities and gains in commodities increased gold's appeal, the precious metal rose 4.3% over the month.

Key market attribution

June 2008



Key facts summary

Investment manager	Man Investments Limited	Valor number	CH334898
Portfolio manager	AHL	Reuters page	MAN01
Target investment exposure	100.0 %	ISIN number	NL0000319606
Bloomberg ticker	EDFGCFI	Dealing frequency	Weekly

Historical performance

Year	Jan	Feb	Mar	Apr	May	Jun	Jul	Aug	Sep	Oct	Nov	Dec	YTD
1994											8.6 %	0.0 %	N/A
1995	1.4 %	-1.1 %	-3.2 %	4.2 %	6.6 %	1.8 %	-5.2 %	-4.3 %	0.6 %	-3.4 %	5.6 %	11.1 %	13.4 %
1996	-4.7 %	-3.8 %	-0.8 %	5.1 %	-9.1 %	8.3 %	-4.3 %	1.7 %	13.4 %	5.5 %	10.9 %	-3.5 %	17.1 %
1997	4.4 %	5.0 %	-1.1 %	-5.2 %	2.4 %	5.3 %	7.6 %	-9.2 %	3.1 %	-0.4 %	1.9 %	8.1 %	22.4 %
1998	2.0 %	5.4 %	2.2 %	-3.8 %	7.0 %	1.6 %	2.4 %	16.9 %	1.2 %	-1.8 %	1.8 %	4.4 %	45.2 %
1999	-6.0 %	4.1 %	-5.9 %	7.5 %	-5.9 %	-1.3 %	-0.6 %	2.1 %	0.7 %	-7.0 %	8.5 %	5.1 %	-0.3 %
2000	-0.4 %	0.1 %	-4.4 %	-1.2 %	2.2 %	-3.2 %	-2.1 %	4.3 %	-2.8 %	3.6 %	7.1 %	8.6 %	11.3 %
2001	0.5 %	3.1 %	13.2 %	-9.6 %	-1.3 %	-1.7 %	2.0 %	4.9 %	11.2 %	3.6 %	-8.1 %	-0.3 %	16.1 %
2002	-3.8 %	-5.0 %	-1.2 %	-3.4 %	0.9 %	11.5 %	5.4 %	1.1 %	6.8 %	-7.3 %	-4.5 %	9.4 %	8.1 %
2003	8.0 %	7.9 %	-8.8 %	0.8 %	10.0 %	-4.4 %	-0.9 %	-0.8 %	2.2 %	1.7 %	-1.7 %	5.9 %	19.9 %
2004	0.1 %	4.9 %	-2.2 %	-7.6 %	-1.9 %	-5.2 %	-0.1 %	1.3 %	2.8 %	4.1 %	7.3 %	-0.2 %	2.4 %
2005	-5.5 %	3.2 %	-0.8 %	-2.4 %	4.4 %	4.2 %	1.0 %	3.5 %	4.0 %	-1.5 %	6.4 %	-1.2 %	15.6 %
2006	3.1 %	-3.0 %	3.2 %	5.3 %	-4.9 %	-3.4 %	-3.4 %	1.0 %	1.4 %	-0.1 %	0.4 %	2.9 %	1.8 %
2007	7.4 %	-2.7 %	-8.0 %	7.5 %	3.1 %	4.5 %	-3.7 %	-4.1 %	5.4 %	8.9 %	4.2 %	-4.5 %	17.5 %
2008	5.8 %	2.7 %	3.8 %	1.1 %	3.1 %	1.2 %							19.1 %

Man AHL Diversified Markets EU

Monthly summary report | As at 30 June 2008

Important notes

Product performance is net of all manager and performance fees.

We continue to seek new trading opportunities as part of our ongoing research programme. From 1 May 2008, a number of new markets will be introduced which are expected to yield further diversification benefits for shareholders.

Please note this fund is valued weekly, however statistics have been calculated using the last weekly valuation of each month.

There is no guarantee of trading performance and past performance is no indication of current or future performance/results. The performance data does not take account of the commissions and/or costs incurred on the issue and redemption of units. Where this product is being compared to an index, it should be understood that the index is not a benchmark and is not representative of the product's investment strategy. It should be seen as a comparison of asset classes.

Sharpe ratios are calculated using the average risk-free rate in the appropriate currency over the period analysed. Where an investment has underperformed the risk-free rate, the Sharpe ratio will be negative. As the Sharpe ratio is an absolute measure of risk-adjusted return, negative Sharpe ratios are shown as N/A, as they can be misleading.

World stocks: MSCI World Index hedged to EUR. World bonds: Citigroup World Government Bond Index hedged to EUR (Total return). These indices are not benchmarks as they are not representative of the fund's investment strategy. They should therefore be seen as comparisons of asset classes.

The range of strategies and the allocations to each are regularly refined by the investment manager based on continuing research.

The market sector and key market attributions above are to be used as indications only. The figures are estimated and generated from the underlying AHL Diversified Programme system and do not take into account the fees/interest/commission charges on any particular account. Differences may also occur due to slippage variation, portfolio changes, FX movements and post execution adjustments. Therefore the sum total of these sector indications will not necessarily equate to the reported performance for the month in question.

The European Union Savings Directive 2003/48/EC (the 'Directive') came into force with effect from 1 July 2005. The Directive requires a paying agent (as defined in the Directive), established in an EU member state, associated/dependent territories, or certain third countries, to either report or withhold tax from payments of savings income to an individual beneficial owner residing in another EU member state or covered territory. Savings income is defined in the Directive and can include coupon and dividend payments, distribution and redemption payments in respect of investments in bonds/shares and certain investment funds. Investors should seek independent advice on the impact of the Directive on their investment. It is the investment objective to generate capital gains rather than interest.

Access the latest performance and other information on the Man Investments website: <http://www.maninvestments.com>

With the introduction of MiFID, performance returns need to be shown on a 12 month rolling basis. As such the MiFID compliant returns within the Historical Returns table are highlighted. From 30 June 1995 to 30 June 2008 Man AHL Diversified Markets EU has a total return of 540.4 %.

Man AHL Diversified Markets EU

Monatlich bewertetes Portfolio | Per 30. Juni 2008

NAV pro Anteil EUR 32,81 | NAV Total EUR 472.692.588 | Anzahl Anteile 14.406.776

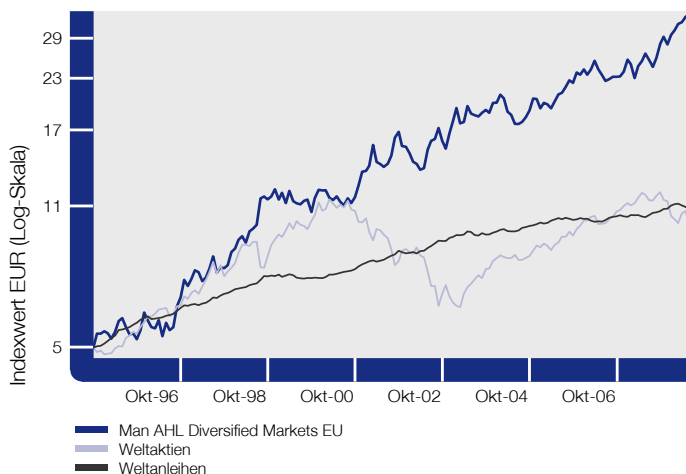
In einem Umfeld starker Kursrückgänge an den Aktienmärkten und neuer Allzeithochs des Rohölpreises verzeichnete AHL erneut ein positives Monatsergebnis. Das Handelssystem schnitt in den letzten zwölf Monaten vor dem Hintergrund hoch volatiler Märkte deutlich besser ab als die wichtigen Aktienindizes.

Der Grossteil der Gewinne wurde in den Segmenten Energie, Agrarprodukte und kurzfristige Zinsprodukte erzielt. Als besonders profitabel erwies sich der Rohstoffsektor, da unsere Long-Positionen in Erdgas erneut einen hohen Gewinnbeitrag leisteten. Die kräftigen Preissteigerungen wurden von der höheren Nachfrage des Stromsektors ausgelöst, da sich die Verbraucher vermehrt vom Öl und seinen rekordhohen Preisen abwandten. Positive Renditen wurden auch im Metallsektor verzeichnet, wo die Kupferpositionen gegen Monatsende

durch einen Bergarbeiterstreik in Peru Auftrieb erhielten. Im Agrarsektor schnitten unsere Long-Positionen in Mais gut ab. Der Preis des Agrarrohstoffs setzte seine Rekordserie wegen zunehmender Sorgen über die diesjährigen Ernteaussichten fort. Auch mit kurzfristigen Zinssätzen, insbesondere Short-Positionen in Euribor-Kontrakten, wurden positive Renditen verbucht. Die Kurse hatten nachgegeben, nachdem die Spekulationen zugenommen hatten, die Europäische Zentralbank werde wegen des anhaltenden Inflationsanstiegs in der Eurozone die Leitzinsen erhöhen. Aufgrund steigender Erwartungen einer Zinssenkung der Bank of Canada, wurden bestehende Erträge durch Verluste aus long Positionen im kanadischen Dollar gegen den US Dollar zum Teil aufgehoben.

Performance-Chart

1. November 1994 bis 30. Juni 2008



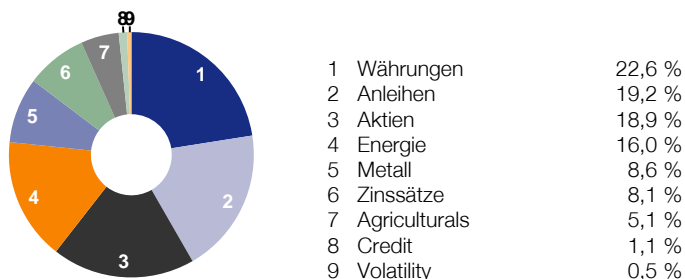
Performance Statistik

1. November 1994 bis 30. Juni 2008

	Produkt	Weltaktien	Weltanleihen
Letzter Monat	1,2 %	-8,3 %	0,1 %
Letzte 3 Monate	5,5 %	-1,5 %	-1,8 %
Year to date	19,1 %	-13,5 %	1,1 %
Letzte 12 Monate	25,8 %	-16,8 %	6,4 %
Letztes Kalenderjahr	17,5 %	2,8 %	4,7 %
Gesamtrendite	623,0 %	106,5 %	131,0 %
Annualisierte Rendite	15,6 %	5,4 %	6,3 %
Annualisierte Volatilität	17,5 %	13,5 %	3,0 %
Sharpe Ratio	0,70	0,19	0,85
Worst Drawdown	-20,2 %	-47,3 %	-2,5 %
Korrelation		-0,13	0,36

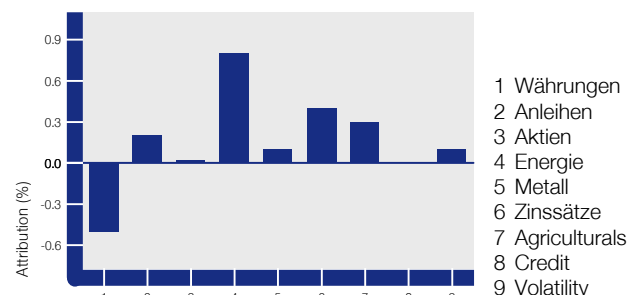
Sektorallokation

Per 30. Juni 2008



Sektorattribution

Juni 2008



Man AHL Diversified Markets EU

Monatlich bewertetes Portfolio | Per 30. Juni 2008

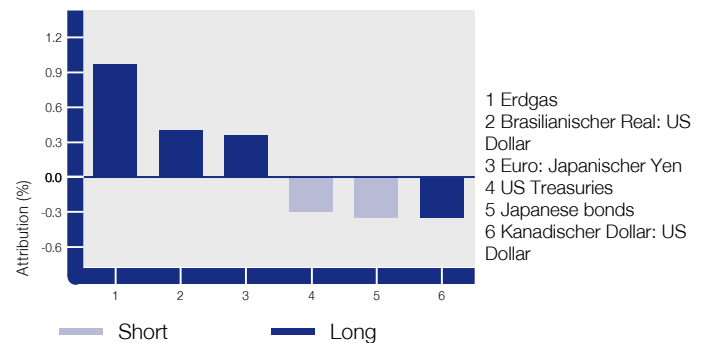
Ökonomische Höhepunkte

Juni 2008

- Der Juni war von einem durch Angebotssorgen ausgelösten Anstieg der Ölpreise auf Rekordstände von über 143 US-Dollar pro Barrel, der Schwäche des US-Dollar und steigenden Spannungen im Nahen Osten geprägt. Infolge des steilen Anstiegs der Rohstoffpreise und der Wachstumsabschwächung nahmen die Stagflationsängste zu. Vor diesem Hintergrund liessen die Bank of England, die Europäische Zentralbank und das Federal Reserve die Leitzinsen im Berichtsmonat unverändert.
- Die globalen Aktienmärkte waren einem starken Ausverkauf ausgesetzt. Grösster Verlierer war der Finanzsektor, nachdem sich hartnäckige Spekulationen über weitere bevorstehende Abschreibungen im Zusammenhang mit der Subprime-Krise gehalten hatten. Der FTSE 100 und der S&P 500 verloren 7% bzw. 9%. Der MSCI Asia Pacific gab um 8,8% nach. Die Kurverluste an den Aktienmärkten und die Preissteigerungen im Rohstoffsektor liessen Gold wieder attraktiver erscheinen: Der Preis des Edelmetalls legte im Monatsverlauf 4,3% zu.

Key-Market-Attribution

Juni 2008



Key Facts zusammengefasst

Investment Manager	Man Investments Limited	Valor Zahl	CH334898
Portfolio Manager	AHL	Reuters Seite	MAN01
Zielinvestmentengagement	100,0 %	ISIN Nummer	NL0000319606
Bloomberg Ticker	EDFGCFI	Handelsfrequenz	Weekly

Historische Performance

Jahr	Jan	Feb	Mrz	Apr	Mai	Jun	Jul	Aug	Sept	Okt	Nov	Dez	YTD
1994											8,6 %	0,0 %	N/A
1995	1,4 %	-1,1 %	-3,2 %	4,2 %	6,6 %	1,8 %	-5,2 %	-4,3 %	0,6 %	-3,4 %	5,6 %	11,1 %	13,4 %
1996	-4,7 %	-3,8 %	-0,8 %	5,1 %	-9,1 %	8,3 %	-4,3 %	1,7 %	13,4 %	5,5 %	10,9 %	-3,5 %	17,1 %
1997	4,4 %	5,0 %	-1,1 %	-5,2 %	2,4 %	5,3 %	7,6 %	-9,2 %	3,1 %	-0,4 %	1,9 %	8,1 %	22,4 %
1998	2,0 %	5,4 %	2,2 %	-3,8 %	7,0 %	1,6 %	2,4 %	16,9 %	1,2 %	-1,8 %	1,8 %	4,4 %	45,2 %
1999	-6,0 %	4,1 %	-5,9 %	7,5 %	-5,9 %	-1,3 %	-0,6 %	2,1 %	0,7 %	-7,0 %	8,5 %	5,1 %	-0,3 %
2000	-0,4 %	0,1 %	-4,4 %	-1,2 %	2,2 %	-3,2 %	-2,1 %	4,3 %	-2,8 %	3,6 %	7,1 %	8,6 %	11,3 %
2001	0,5 %	3,1 %	13,2 %	-9,6 %	-1,3 %	-1,7 %	2,0 %	4,9 %	11,2 %	3,6 %	-8,1 %	-0,3 %	16,1 %
2002	-3,8 %	-5,0 %	-1,2 %	-3,4 %	0,9 %	11,5 %	5,4 %	1,1 %	6,8 %	-7,3 %	-4,5 %	9,4 %	8,1 %
2003	8,0 %	7,9 %	-8,8 %	0,8 %	10,0 %	-4,4 %	-0,9 %	-0,8 %	2,2 %	1,7 %	-1,7 %	5,9 %	19,9 %
2004	0,1 %	4,9 %	-2,2 %	-7,6 %	-1,9 %	-5,2 %	-0,1 %	1,3 %	2,8 %	4,1 %	7,3 %	-0,2 %	2,4 %
2005	-5,5 %	3,2 %	-0,8 %	-2,4 %	4,4 %	4,2 %	1,0 %	3,5 %	4,0 %	-1,5 %	6,4 %	-1,2 %	15,6 %
2006	3,1 %	-3,0 %	3,2 %	5,3 %	-4,9 %	-3,4 %	-3,4 %	1,0 %	1,4 %	-0,1 %	0,4 %	2,9 %	1,8 %
2007	7,4 %	-2,7 %	-8,0 %	7,5 %	3,1 %	4,5 %	-3,7 %	-4,1 %	5,4 %	8,9 %	4,2 %	-4,5 %	17,5 %
2008	5,8 %	2,7 %	3,8 %	1,1 %	3,1 %	1,2 %							19,1 %

Man AHL Diversified Markets EU

Monatlich bewertetes Portfolio | Per 30. Juni 2008

Wichtige Anmerkungen

Die Produktperformance versteht sich abzüglich aller Management Fees und Performance Fees.

Als Teil unseres permanenten Forschungsprogrammes fahren wir fort, neue Handelsmöglichkeiten zu suchen. Ab 1. Mai 2008 werden mehrere neue Märkte eingeführt, von denen erwartet wird, dass sie weitere Diversifikationsvorteile für die Anteilseigner mit sich bringen.

Bitte beachten Sie, dass dieser Fonds wöchentlich bewertet wird. Statistiken wurden unter Verwendung der jeweils letzten wöchentlichen Bewertung jedes Monats berechnet.

Eine Garantie für eine bestimmte Handelsperformance kann nicht gegeben werden und die Wertentwicklung in der Vergangenheit stellt keinen Indikator für zukünftige Resultate dar. Die Wertentwicklungsdaten berücksichtigen Kommissionen und / oder Kosten, die bei Emission und/ oder Kündigung von Einheiten anfallen nicht. Wird dieses Produkt mit einem Index verglichen, darf dieser Index nicht als Benchmark verstanden werden und ist auch nicht repräsentativ für die Investmentstrategie des Produkts. Es handelt sich dabei lediglich um einen Vergleich von Anlageklassen.

Die Sharpe Ratio wird mithilfe des risikofreien Zinssatzes in der entsprechenden Währung während der analysierten Periode berechnet. Die Sharpe Ratio ist negativ, sofern die Performance einer Anlage unter dem risikofreien Zinssatz liegt. Da die Sharpe Ratio ein absolutes Mass der risikoadjustierten Rendite darstellt, erfolgt bei negativen Sharpe Ratios wegen der Gefahr von Missverständnissen keine Angabe ('k.A.').

Weltaktien: MSCI World Index hedged to EUR. Weltanleihen: Citigroup World Government Bond Index hedged to EUR (Total return). Diese Indizes sind keine Benchmarks, da sie für die Anlagestrategie des Fonds nicht repräsentativ sind. Sie dienen lediglich dazu, unterschiedliche Anlagekategorien miteinander zu vergleichen.

Die Bandbreite der Strategien und die Allokation zu jeder einzelnen dieser Strategien wird regelmässig vom Investmentmanager, basierend auf andauernder Recherche, gebildet.

Der Marktsektor und die Schlüsselmarktattritionen sollen nur als Indikatoren gesehen werden. Die Zahlen werden geschätzt und generiert auf Basis des zugrundeliegenden AHL Diversified Programm Systems und berücksichtigen weder Gebühren noch Zinsen für ein bestimmtes Konto. Abweichungen können sich auch aus Portfolioänderungen, Wechselkursschwankungen oder nachträglichen Änderungen ergeben. Aus diesem Grund muss die Summe dieser Sektorindikatoren nicht notwendigerweise die berichtete Performance des betreffenden Monats widerspiegeln.

Am 1. Juli 2005 ist die EU-Richtlinie 2003/48/EG über die Besteuerung von Zinserträgen (die 'Richtlinie') in Kraft getreten. Die Richtlinie sieht vor, dass in einem EU-Mitgliedstaat, in einem der abhängigen oder assoziierten Gebiete oder in bestimmten Drittstaaten niedergelassene Zahlstellen (gemäss Definition in der Richtlinie) diejenigen Zinserträge zu melden oder einem Quellensteuerabzug zu unterziehen haben, welche natürlichen Personen (in ihrer Eigenschaft als wirtschaftliche Eigentümer) zufließen, die in einem anderen EU-Mitgliedstaat oder in einem sonstigen von der Richtlinie abgedeckten Gebiet ansässig sind. Der in der Richtlinie definierte Begriff 'Zinszahlung' umfasst unter anderem Coupon- und Dividendenzahlungen sowie die Ausschüttung und Rückzahlung von Beträgen im Zusammenhang mit Anlagen in Anleihen/Aktien und bestimmten Anlagefonds. Anlegern wird empfohlen, eine unabhängige Beratung über die Auswirkungen der Richtlinie auf ihre Anlage einzuholen. Die Anlage zielt auf die Realisierung von Kapitalgewinnen und nicht von Zinsen ab.

Die aktuellen Performance-Zahlen und sonstige Informationen sind auch über die Website von Man Investment unter <http://www.maninvestments.com> abrufbar

Mit der Einführung von MiFID müssen Performanceerträge auf einer 12 Monate rollierenden Basis ausgewiesen werden. Daher sind die MiFID-konformen Erträge innerhalb der Tabelle der historischen Erträge hervorgehoben. Von 30. Juni 1995 bis 30. Juni 2008 hat Man AHL Diversified Markets EU einen Gesamtertrag von 540,4 %.

Man AHL Diversified Markets EU

Fonds Rapportage | Per 30 juni 2008 Int.waarde per eenh EUR 32.81 | Totale intrinsieke waarde 472,692,588 | Aantal eenh 14,406,776

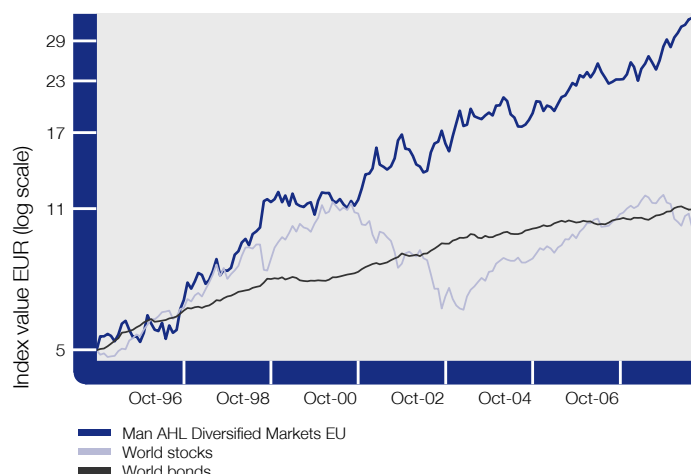
AHL had opnieuw een positieve maand bij sterk dalende aandelenkoersen en een naar nieuwe recordhoogten stijgende olieprijs. In zeer volatiele markten presteerde het programma de afgelopen 12 maanden aanzienlijk beter dan de belangrijkste aandelenindices.

De grootste winsten kwamen voort uit de handelsactiviteiten in energie, landbouwproducten en kortetermijnrentetarieven. Vooral de grondstoffen waren winstgevend en onze long-posities in aardgas hadden hierin een belangrijk aandeel. Door de hogere vraag uit de elektriciteitssector stegen de prijzen sterk, omdat de torenhoge olieprijs tot een verschuiving naar gas leidt. Ook de metaalsector boekte goede winsten; met name de posities in koper die profiteerden van een mijnstaking in Peru tegen het einde van de maand. In de landbouwsector deden onze long-posities in mais het goed. De maisprijs bleef op recordhoogte vanwege zorgen over de oogstvooruitzichten voor dit jaar. Handel in kortetermijnrentetarieven leverde ook winst op, vooral in short-posities in Euribor-contracten.

De koersen daalden naarmate het vermoeden toenam dat de Europese Centrale Bank de rente zou verhogen vanwege de toenemende inflatie in de eurozone.

Rendementsgrafiek

Van 01-11-1994 tot en met 30-06-2008



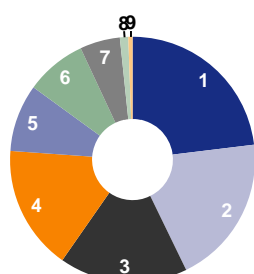
Rendements statistieken

Van 01-11-1994 tot en met 30-06-2008

	Product	World stocks	World bonds
Afgelopen maand	1.2 %	-8.3 %	0.1 %
Afgelopen kwartaal	5.5 %	-1.5 %	-1.8 %
Jaar tot nu	19.1 %	-13.5 %	1.1 %
Afgelopen 12 maanden	25.8 %	-16.8 %	6.4 %
Vorig kalenderjaar	17.5 %	2.8 %	4.7 %
Totaal rendement	623.0 %	106.5 %	131.0 %
Jaarlijks rendement	15.6 %	5.4 %	6.3 %
Jaarlijks volatiliteit	17.5 %	13.5 %	3.0 %
Sharpe ratio	0.70	0.19	0.85
Slechtste resultaat	-20.2 %	-47.3 %	-2.5 %
Correlatie		-0.13	0.36

Sector allocations

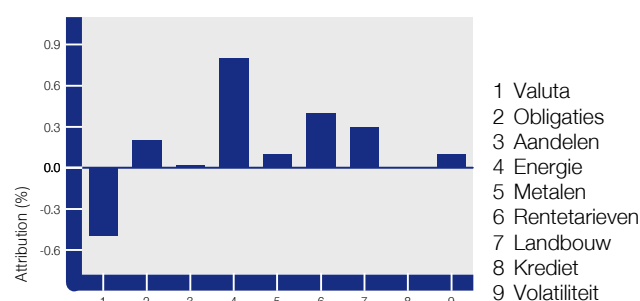
Per 30 juni 2008



1	Valuta	22.6 %
2	Obligaties	19.2 %
3	Aandelen	18.9 %
4	Energie	16.0 %
5	Metalen	8.6 %
6	Rentetarieven	8.1 %
7	Landbouw	5.1 %
8	Krediet	1.1 %
9	Volatiliteit	0.5 %

Sector attribution

juni 2008



Man AHL Diversified Markets EU

Fonds Rapportage | Per 30 juni 2008

Economische hoofdpunten

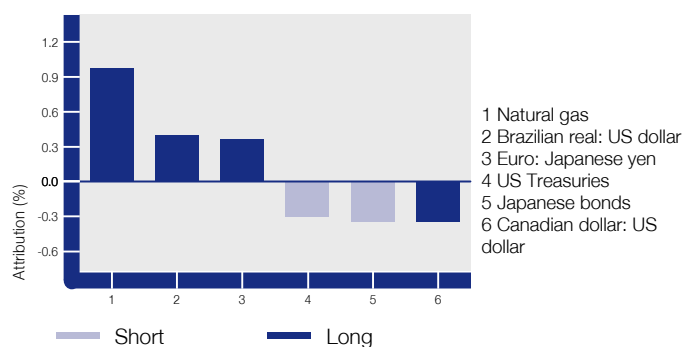
juni 2008

Door zorgen over de aanvoer, de zwakke US dollar en toenemende spanningen in het Midden-Oosten steeg de olieprijs in juni naar een recordhoogte van meer dan USD 143 per vat. Door de stijgende grondstofprijzen en de lagere economische groei werd de angst voor stagflatie deze maand sterker. In het licht van deze ontwikkelingen lieten de Bank of England, de Europese Centrale Bank en de Federal Reserve de rente in juni ongewijzigd.

Aandelen hadden wereldwijd te lijden onder een verkoopgolf. Het sterkst getroffen werd de financiële sector, door de aanhoudende speculatie dat nog meer afschrijvingen gerelateerd aan de kredietcrisis voor de deur stonden. De FTSE 100 en de S&P 500 verloren respectievelijk rond 7 en 9%, terwijl de MSCI Asia Pacific met 8,8% daalde. De daling van de aandelenkoersen en stijging van de grondstofprijzen maakten goud weer aantrekkelijk en het edelmetaal steeg deze maand met 4,3% in waarde.

Attributie naar markten

juni 2008



Gegevensoverzicht

Beleggingsadviseur	Man Investments Limited
Portefeuillebeheerder	AHL
Beoogde beleggingsparticipatie	100.0 %
Bloomberg ticker	EDFGCFI

Valor - code	CH334898
Reuters pagina	MAN01
ISIN - nummer	NL0000319606
Handelsfrequentie	Wekelijks

Historische Rendements

Year	Jan	Feb	Mar	Apr	May	Jun	Jul	Aug	Sep	Oct	Nov	Dec	YTD
1994											8.6 %	0.0 %	N/A
1995	1.4 %	-1.1 %	-3.2 %	4.2 %	6.6 %	1.8 %	-5.2 %	-4.3 %	0.6 %	-3.4 %	5.6 %	11.1 %	13.4 %
1996	-4.7 %	-3.8 %	-0.8 %	5.1 %	-9.1 %	8.3 %	-4.3 %	1.7 %	13.4 %	5.5 %	10.9 %	-3.5 %	17.1 %
1997	4.4 %	5.0 %	-1.1 %	-5.2 %	2.4 %	5.3 %	7.6 %	-9.2 %	3.1 %	-0.4 %	1.9 %	8.1 %	22.4 %
1998	2.0 %	5.4 %	2.2 %	-3.8 %	7.0 %	1.6 %	2.4 %	16.9 %	1.2 %	-1.8 %	1.8 %	4.4 %	45.2 %
1999	-6.0 %	4.1 %	-5.9 %	7.5 %	-5.9 %	-1.3 %	-0.6 %	2.1 %	0.7 %	-7.0 %	8.5 %	5.1 %	-0.3 %
2000	-0.4 %	0.1 %	-4.4 %	-1.2 %	2.2 %	-3.2 %	-2.1 %	4.3 %	-2.8 %	3.6 %	7.1 %	8.6 %	11.3 %
2001	0.5 %	3.1 %	13.2 %	-9.6 %	-1.3 %	-1.7 %	2.0 %	4.9 %	11.2 %	3.6 %	-8.1 %	-0.3 %	16.1 %
2002	-3.8 %	-5.0 %	-1.2 %	-3.4 %	0.9 %	11.5 %	5.4 %	1.1 %	6.8 %	-7.3 %	-4.5 %	9.4 %	8.1 %
2003	8.0 %	7.9 %	-8.8 %	0.8 %	10.0 %	-4.4 %	-0.9 %	-0.8 %	2.2 %	1.7 %	-1.7 %	5.9 %	19.9 %
2004	0.1 %	4.9 %	-2.2 %	-7.6 %	-1.9 %	-5.2 %	-0.1 %	1.3 %	2.8 %	4.1 %	7.3 %	-0.2 %	2.4 %
2005	-5.5 %	3.2 %	-0.8 %	-2.4 %	4.4 %	4.2 %	1.0 %	3.5 %	4.0 %	-1.5 %	6.4 %	-1.2 %	15.6 %
2006	3.1 %	-3.0 %	3.2 %	5.3 %	-4.9 %	-3.4 %	-3.4 %	1.0 %	1.4 %	-0.1 %	0.4 %	2.9 %	1.8 %
2007	7.4 %	-2.7 %	-8.0 %	7.5 %	3.1 %	4.5 %	-3.7 %	-4.1 %	5.4 %	8.9 %	4.2 %	-4.5 %	17.5 %
2008	5.8 %	2.7 %	3.8 %	1.1 %	3.1 %	1.2 %							19.1 %

Man AHL Diversified Markets EU

Fonds Rapportage | Per 30 juni 2008

Belangrijke gegevens

De prestaties van het product zijn netto na alle beheers- en prestatievergoedingen

Dit fonds wordt wekelijks gewaardeerd. De grafiek is gebaseerd op de laatste wekelijkse waardering van elke maand.

Met betrekking tot de prestaties kunnen geen garanties worden gegeven. In het verleden behaalde rendementen of prognoses bieden geen garantie voor huidige of toekomstige prestaties/resultaten. Bij de informatie over resultaten is geen rekening gehouden met commissies en/of kosten bij uitgifte en verkoop van eenheden. In gevallen waarbij dit product wordt vergeleken met een index, dient in aanmerking te worden genomen dat de index geen benchmark is noch representatief is voor de beleggingsstrategie van het product. Het gaat hierbij om een vergelijking van beleggingscategorieën.

Aandelen wereldwijd: MSCI World Stocks Index (gehedged naar EUR). Obligaties wereldwijd: Citigroup World Government Bond Index gehedged naar EUR (Totale rendement)

De Sharpe-ratio wordt berekend aan de hand van het gemiddelde risicovrije tarief in de betreffende valuta over de geanalyseerde periode. Als het resultaat van een belegging onder het risicovrije tarief uitkomt, is de Sharpe-ratio negatief. Aangezien de Sharpe-ratio een maatstaf is die het rendement corrigeert voor het gelopen risico, worden negatieve Sharpe-ratio's als N/A weergegeven omdat deze misleidend kunnen zijn.

De spreiding van verhandelde contracten en de allocatie naar elke sector wordt regelmatig geoptimaliseerd door de beleggingsbeheerder op basis van doorlopend onderzoek.

De bovenstaande attributie naar marktsectoren en markten is louter indicatief. De cijfers zijn ramingen en komen uit het onderliggende systeem van het AHL Diversified Programma, waarbij geen rekening wordt gehouden met kosten/rente/commissies voor bepaalde partijen. Verschillen kunnen ook ontstaan als gevolg van slippagevariatie, portefeuilveranderingen, valutabewegingen en aanpassingen na uitvoering. Daarom komt de som van de afzonderlijke sectorindicaties niet altijd uit op het vermelde resultaat van de betreffende maand.

De Europese Spaartegoedenrichtlijn 2003/48/EC (de 'richtlijn') werd van kracht op 1 juli 2005. Volgens de Richtlijn dient een betalingsagent (zoals beschreven in de richtlijn), gevestigd in een EU-lidstaat, aangesloten/afhankelijke gebieden, of bepaalde andere landen, ofwel belasting aan te geven of in te houden op betalingen van spaarinkomsten aan een individuele begunstigde eigenaar in een andere EU-lidstaat of bijbehorend gebied. Het begrip spaarinkomsten is beschreven in de Richtlijn en omvat o.a. coupon- en dividenduitkeringen, betalingen bij distributie en verkoop in verband met beleggingen in obligaties/aandelen en bepaalde beleggingsfondsen. Beleggers dienen onafhankelijk advies in te winnen over de gevolgen van deze richtlijn voor hun beleggingen. De doelstelling van de belegging is het realiseren van kapitaalwinst en niet van renteopbrengsten.

Actuele informatie over resultaten en overige informatie vindt u op de website van Man Investment: <http://www.maninvestments.com>

Door de inwerkingtreding van MiFID moeten de resultaten worden getoond op een 12-maands voortschrijdende basis. De resultaten volgens de MiFID-voorschriften worden als zodanig gemarkeerd in de tabel met historische resultaten. Van 30 juni 1995 tot 30 juni 2008 Man AHL Diversified Markets EU heeft een total rendement van 540.4 %.