

Stiftelseportföljen

december 2018



Förvaltare: Frans Wehtje och Johan Thorén

Beskrivning

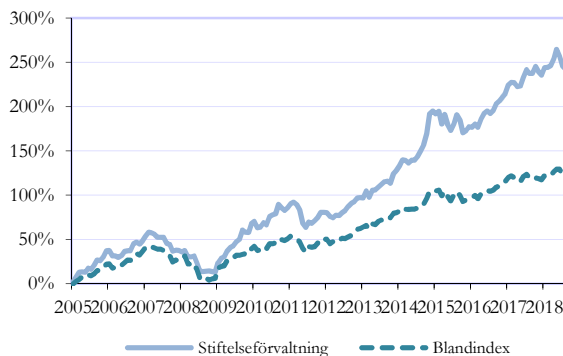
Stiftelseportföljen är en diskretionär förvaltningsportfölj med fokusering på både värdetillväxt och utdelningsbar avkastning. Kapitalet kan investeras i aktier, räntebärande instrument och externa fonder. Aktieandelen varierar beroende på marknadsläge och varierar i normalfallet mellan 30 och 70%.

Målsättningen

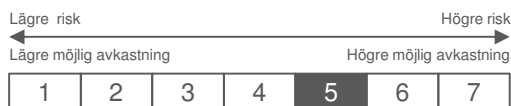
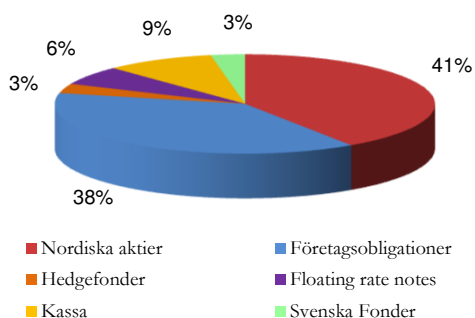
Målsättningen med förvaltningen är att långsiktigt uppnå en god värdetillväxt till en lägre risk än aktiemarknaden samtidigt som en god direktavkastning skapas. Produkten riktar sig till stiftelser och andra kundgrupper som är i behov av en hög direktavkastning och som samtidigt vill ha en balanserad risk i portföljen.

Strand stiftelseportfölj startades i mars 2005.

Avkastning sedan start



Stiftelseportföljen allokering



Riskenivå: Risk/avkastningsindikatorn visar sambandet mellan risk och möjlig avkastning vid en investering. Indikatorn baseras på hur värdet har förändrats de senaste fem åren.

Statistik	Stiftelseförvaltning	Blandindex*
Akkumulerad årsavkastning	9,7%	6,1%
Sharpekvot	0,83	0,56
Standardavvikelse	9,9%	8,22%
Korrelation till Six Return Index	0,89	1,00
Månader under förvaltning	166	166
Antal positiva månader	104	104
Akkumulerad månadsavkastning	0,8%	0,5%
Total avkastning sedan start	226,4%	112,7%

* 50% Six return index, 50% OMRX T-Bill

Avkastning (%) inklusive fast avgift													
År	Jan	Feb	Mar	Apr	Maj	Jun	Jul	Aug	Sep	Okt	Nov	Dec	År
2005			1,48	0,55	5,04	5,43	0,36	-0,27	4,18	-1,17	3,94	4,72	26,75
2006	-0,60	3,10	5,79	0,04	-4,38	0,04	-1,36	1,75	3,52	0,50	-0,04	5,80	14,57
2007	1,16	-1,41	2,60	3,27	3,17	-0,54	-1,19	-2,02	-0,13	0,19	-4,55	-0,83	-0,57
2008	-5,09	0,62	-0,22	-1,20	1,13	-5,27	0,13	0,95	-6,08	-7,65	-0,25	0,10	-21,05
2009	0,29	-0,42	-0,69	9,72	3,85	1,18	5,00	3,03	1,06	3,47	1,69	7,19	40,99
2010	-1,61	-0,19	6,35	1,65	-4,34	0,52	2,97	-1,35	5,54	0,97	0,90	5,90	18,07
2011	-2,07	-1,72	1,61	2,48	0,98	-1,43	-3,07	-8,53	-2,50	3,82	-0,84	1,54	-9,86
2012	2,50	2,95	0,11	-0,18	-2,51	-0,75	1,54	-0,17	1,95	1,29	2,38	1,96	11,49
2013	0,91	2,30	0,22	-0,28	4,08	-3,44	3,84	0,27	1,61	1,35	1,58	0,22	13,18
2014	-1,19	5,18	1,61	2,36	2,79	-0,35	-1,17	1,39	-0,04	1,77	2,63	2,56	18,80
2015	5,12	8,22	1,21	-1,12	0,91	-4,90	3,94	-4,16	-2,15	2,73	3,66	-2,07	11,06
2016	-4,98	0,89	1,57	-0,28	1,40	-1,35	3,37	2,17	1,06	-1,01	1,20	2,43	6,38
2017	1,07	1,37	1,28	3,15	0,93	-0,15	-1,28	0,18	2,98	2,64	-1,21	-0,02	11,37
2018	2,31	-1,65	-1,16	2,52	0,01	0,61	2,24	3,05	-2,17	-3,16	-0,86	-4,72	-3,27

Historisk avkastning är ingen garanti för framtida avkastning. De pengar som placeras kan både öka och minska i värde och det är inte säkert att du får tillbaka hela det insatta kapitalet.

Avgifter: Vår arvodesstruktur är individuellt anpassad och sätts tillsammans med kunden. Arvodet består vanligtvis av ett fast förvaltningsarvode samt en prestationsrelaterad ersättning. Så kallat High Watermark tillämpas, vilket innebär att förlorat värde måste hämtas in innan rörlig avgift kan tas ut.

Strand Kapitalförvaltning AB

Besöksadress	Telefon	Org.nr	E-post	Hemsida
Artillerigatan 6, 114 51 Stockholm	08-442 54 70	556345-2266	info@strandkapital.se	www.strandkapital.se