

Stiftelseportföljen

februari 2019



Förvaltare: Frans Wehtje och Johan Thorén

Beskrivning

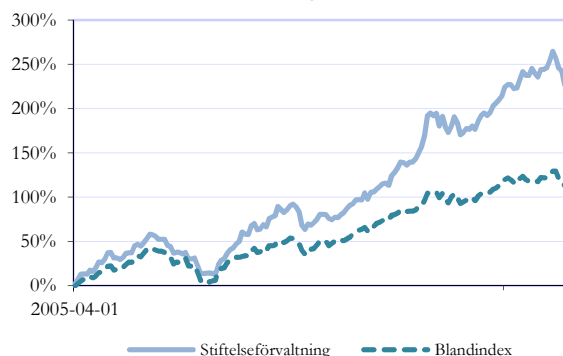
Stiftelseportföljen är en diskretionär förvaltningsportfölj med fokusering på både värdetillväxt och utdelningsbar avkastning. Kapitalet kan investeras i aktier, räntebärande instrument och externa fonder. Aktieandelen varierar beroende på marknadsläge och varierar i normalfallet mellan 30 och 70%.

Målsättningen

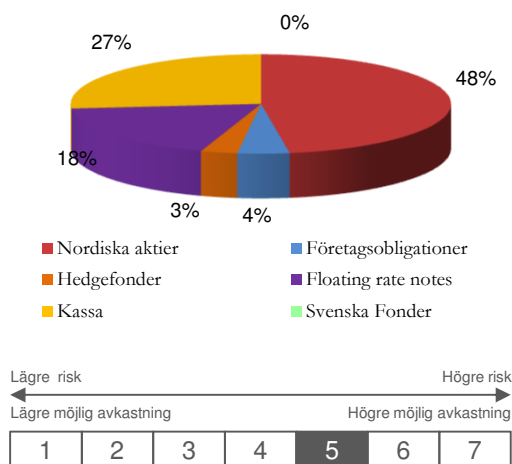
Målsättningen med förvaltningen är att långsiktigt uppnå en god värdetillväxt till en lägre risk än aktiemarknaden samtidigt som en god direktavkastning skapas. Produkten riktar sig till stiftelser och andra kundgrupper som är i behov av en hög direktavkastning och som samtidigt vill ha en balanserad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

Strand stiftelseportfölj startades i mars 2005.

Avkastning sedan start

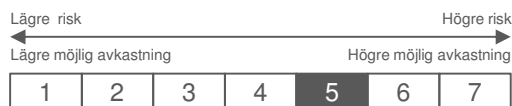


Stiftelseportföljen allokering



Statistik	Stiftelseförvaltning	Blandindex*
Akkumulerad årsavkastning	9,3%	6,0%
Sharpekvot	0,80	0,56
Standardavvikelse	9,8%	8,11%
Korrelation till Six Return Index	0,89	1,00
Månader under förvaltning	168	168
Antal positiva månader	106	106
Akkumulerad månadsavkastning	0,7%	0,5%
Total avkastning sedan start	245,5%	125,2%

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



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

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
2019	3,35	2,42											5,85

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.