

INVESTERINGS STRATEGI

Pacific Multi Asset är en Multi Tillgångsslag + Multi Strategi fond inom sektorn Likvida Alternativa Investeringar och arbetar med Mål om Absolut Avkastning som grund. Det årliga avkastningsmålet är OMRXTBILL +5%.

Fondens huvudstrategier är Räntor, Råvaror, L/S Aktier. Normalfördelningen är 15%, 30%, 55% men förvaltaren använder en obegränsad taktisk allokering mellan dessa och underliggande delstrategier (Råvaror: Guld & Softs) (L/S Aktier: Real World, Green World, Millennium World & Short World).

Fonden minimerar motpartsrisiker och använder valutahedgning för att både skydda portföljen och öka avkastningen. Volatilitetsmålet är 6 med mjukt intervall 4-8 och hårt intervall 2-10. Riskklassen skall alltså kunna variera mellan 3 och 4 men i normalfallet vara 4.

Fonden har en koncentrerad portfölj i mycket likvida innehav och i marknader med stor kapacitet vilket gör strategier samt avkastningspotential oberoende av såväl fondens framtida storlek som föränderliga marknadsklimat. Som svensk UCITS-fond är alla aspekter gällande säkerhet, kostnader och transparens optimerade.



ERIC STRAND
Fondförvaltare

NAV

106,69

Tröskel

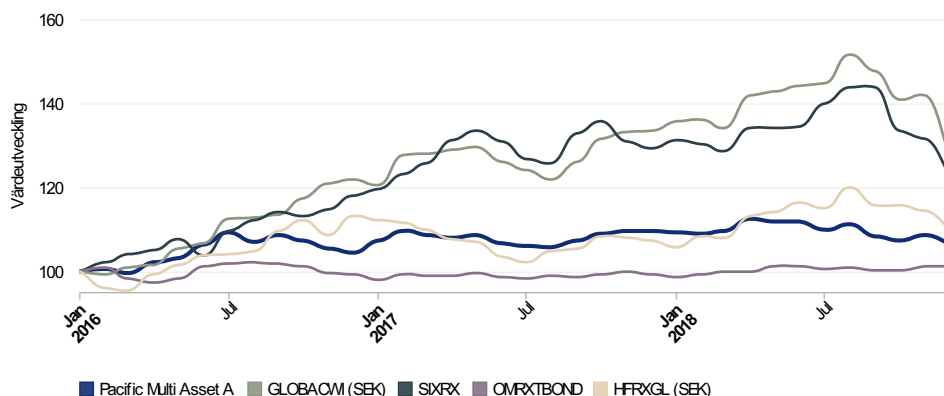
112,45

MÅNADSAVKASTNINGAR

	JAN	FEB	MAR	APR	MAJ	JUN	JUL	AUG	SEP	OKT	NOV	DEC	År
2018	-0,26	-0,10	0,60	2,52	-0,56	-0,15	-1,73	1,28	-2,48	-1,09	1,28	-1,72	-2,51
2017	2,84	2,15	-0,89	-0,76	0,57	-1,82	-0,56	-0,10	1,32	1,62	0,67	-0,19	4,84
2016		0,40	-0,90	2,61	0,99	2,98	2,83	-2,13	1,60	-1,26	-1,59	-1,04	4,40

All fakta baserad på månatlig data och Pacific Multi Asset A om inte annat anges.

VÄRDEUTVECKLING



RISKSTATISTIK

Sharpe-kvot	0,44
Sortino-kvot	0,70
Största sammanlagda värdefall	-5,13
Korrelation jmf GLOBACWI (SEK)	0,51
Korrelation jmf SIXRX	0,25
Korrelation jmf OMRXTBOND	0,43
Korrelation jmf HFRXGL (SEK)	0,47
Årlig standardavvikelse	5,34
Årlig standardavvikelse (nedsida)	2,46
Volatilitet (veckovis 5 år)	6,26
UCITS Riskklass	4/7

AVKASTNINGSRAPPORT

Period	Senaste	Snitt	Bästa	Sämsta	Andel positiva (%)
1 månad	-1,72	0,20	2,98	-2,48	45,71
12 månader	-2,51	2,54	9,23	-3,01	70,83
24 månader	2,20	5,10	10,25	-0,18	83,33
Alla månader	6,70	6,70	6,70	6,70	100,00

TAKTISK ALLOKERING & AVKASTNINGSBIDRAG

Pacific Multi Asset exponering Strategier Netto per NAV 2018-12-31 (föregående månad) [bidrag månad]:

15% > Ränta & Likviditet 11,5%(10,3%) [-0,06%].

30% > Råvaror: Guld 24,2%(23,2%) [+0,72%] & Mjuka Råvaror 6,9%(7,1%) [-0,23%].

55% > L/S Aktier Netto: Lång 22,3%(Lång 26,8%) [-2,82%].

FX > USD/SEK Hedge -48,1%(-30,2%) [+0,75%].

Antal innehav: 45(45).

Starkaste delstrategi under december: Råvaror Guld.

ALLMÄN INFORMATION

Andelsklass A (SEK)	SE0008015069
Andelsklass B (SEK)	-
Legal struktur	UCITS
Likviditet	Daglig
Förvaltningsavgift A/B	0,5% / -
Prestationsbaserad avgift A/B	15% / -
Tröskel	ATH+OMRXTBILL
Fondens säte	Sverige
Fondbolag	ISEC Services AB
Webb	isec.com
Förvaltarbolag	Pacific Fonder AB
Webb	pacificfonder.se
Hållbart visitkort	eric.pacificfonder.eu