



# Altrua Macro

## Produktblad per februari 2019

Denna presentation är ett marknadsföringsdokument för delfonden ovan, en delfond i Coeli SICAV II. Informationen i denna presentation ska inte ses som en personlig rekommendation att investera i delfonden. Informationen ska inte heller anses utgöra juridisk-, skatte- eller annan investeringsrådgivning.

### Översikt

Basvaluta	USD
Kursnotering	Daglig
Startdatum	2018-07-06
Jämförelseindex	N/A

### Förvaltare

Namik Immelbäck
Filip Kozlowski

### Nyckeltal<sup>1)</sup>

Årlig avkastning	N/A
Korrelation, MSCI World <sup>2)</sup>	N/A
Korrelation, OMRX T-Bond <sup>2)</sup>	N/A
Sharpekvot <sup>2)</sup>	N/A
Positiva månader	25,00%

### Riskmått<sup>1)</sup>

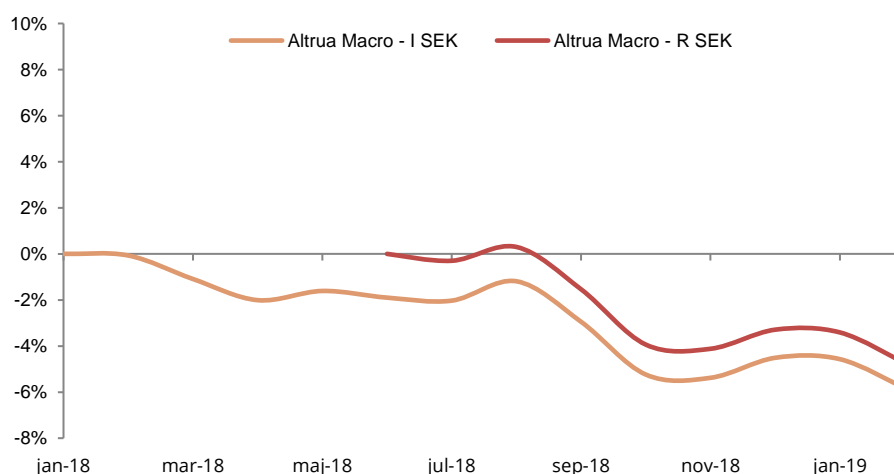
Bästa kvartal	0,55%
Sämsta kvartal	-4,41%
Standardavvikelse <sup>2)</sup>	N/A
Största ack.värdefall	-5,02%
VaR (augusti 2018)	-0,32%

### Placeringsinriktning

Altrua Macro fonden använder sig av ett kvant-fundamentalt ramverk för att konstruera en kärnportfölj allokerad till globala tillgångsklasser. Kärnportföljen kompletteras med icke-linjära strategier på tematiska möjligheter samt portföljskydd mot extrema marknadsutfall. Fonden handlar instrument som börshandlade terminer och optioner, börshandlade fonder, OTC forwards på underliggande tillgångsslag som aktie- och aktiesektorindex, ränteinstrument (statsobligationer och korräntor), valutor samt volatilitetsindex. Fonden kan investera i penningmarknadsinstrument och högt rankade statsobligationer som en del av

### Utveckling

#### Utveckling i SEK



### Månatlig utveckling (%)<sup>1)</sup>

	Jan	Feb	Mar	Apr	Maj	Jun	Jul	Aug	Sep	Okt	Nov	Dec	År
2019	-0,12%	-1,38%											-1,50%
2018						-0,30%	0,60%	-1,83%	-2,44%	-0,19%	0,87%		-3,29%

### Utveckling per andelsklass (%)

	1 mån	3 mån	6 mån	1 år	3 år	5 år	Från start
Altrua Macro - R SEK	-1,38%	-0,65%	-5,02%	N/A	N/A	N/A	-4,74%
Altrua Macro - I SEK	-1,32%	-0,48%	-4,70%	-5,76%	N/A	N/A	-5,83%

### Årlig utveckling per andelsklass (%)

	YTD	2018	2017	2016	2015	2014	2013
Altrua Macro - R SEK	-1,50%	-3,29%	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
Altrua Macro - I SEK	-1,38%	-4,51%	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A

<sup>1)</sup>Sedan start om inget annat anges. Gäller andelsklass R SEK <sup>2)</sup> 24 månader

### Kontakt

Coeli Asset Management

Sveavägen 24 -26

111 57 Stockholm

Tel: 08-506 223 10

E-post: info.am@coeli.com

www.coeliam.se



# Altrua Macro

## Produktblad per februari 2019

### Information per andelsklass

Information per andelsklass	Start-datum	Andels-värde	Avgifter		Identifiering		
			Förv.avg.	Årlig avg.	Prestations-baserad avg.	Bloomberg ID	ISIN
Altrua Macro - R SEK	2018-07-06	95,26	2,00%	2,3% <sup>3)</sup>	JA <sup>4)</sup>		LU1735827492
Altrua Macro - W SEK	2018-06-01	95,28	1,50%	1,8% <sup>3)</sup>	JA <sup>4)</sup>		LU1735827575
Altrua Macro - I SEK	2018-02-23	94,17	1,00%	1,3% <sup>3)</sup>	JA <sup>4)</sup>	C2AMISE:LX	LU1735827906

<sup>3)</sup> Den årliga avgiften avser estimerade kostnader.

<sup>4)</sup> För ytterligare information, vänligen se basfakta för investeraren (KIID).

### Riskinformation

Varken historisk avkastning eller simulerad avkastning är en garanti eller en tillförlitlig indikation för framtida avkastning. Förutsägelser om framtiden är med nödvändighet behäftade med osäkerhet och kan komma att signifikant avvika från det verkliga utfallet. De pengar som placeras i fonden kan både öka och minska i värde och det är inte säkert att du får tillbaka hela det insatta kapitalet.

Ett investeringsbeslut ska grundas på den detaljerade informationen som finns i fondens faktablad, informationsbroschyrer med fondbestämmelser, fullständiga fondbestämmelser och den senast publicerade årsrapporten och halvårsrapporten. Dessa dokument finns på [www.coeliam.se](http://www.coeliam.se) och kan även erhållas gratis direkt från Coeli. För råd om placeringar anpassade efter din individuella situation bör du kontakta din rådgivare.

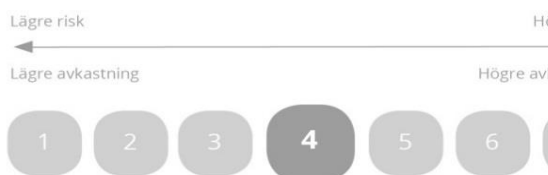
### Friskrivning

Denna presentation är inte avsedd för spridning i USA eller andra länder där innehåll eller spridning kan vara otillåten. Fonden som beskrivs i brevet är inte avsedd att erbjudas eller säljas till amerikansk medborgare eller person bosatt i USA eller till företag som är hemmahörande i USA eller lyder under amerikansk lagstiftning.

Informationen i publikationen är baserad på källor som bedömts som tillförlitliga. Coeli kan dock inte garantera nämnda informations riktighet och ansvarar inte för förluster eller skador som kan uppstå genom att någon använder sig av uppgifter lämnade i denna publikation.

### Övrig information

Mer information om delfonden finns i delfondens prospekt och faktablad. Sådana dokument är tillgängliga på Coelis hemsida, [www.coeli.se](http://www.coeli.se). Prospektet och faktabladet är tillgängligt på engelska. Faktabladet finns även på svenska.



### Kontakt

Coeli Asset Management

Sveavägen 24 -26

111 57 Stockholm

Tel: 08-506 223 10

E-post: [info.am@coeli.com](mailto:info.am@coeli.com)

[www.coeliam.se](http://www.coeliam.se)