

Sparinvest INDEX Europa Value KL

2021-06-30



Investeringsbeskrivelse

Investeringsstrategien er sammensat med det ene formål at være placeret neutralt i forhold til benchmark. Succeskriteriet vil således være en så lav tracking error som muligt. Der fokuseres udelukkende på europæiske value-aktier, og universet udgøres af samtlige aktier, som indgår i indekset MSCI Europe value.

Screeningen, som ligger til grund for indekset, foretages på baggrund af tre nøgletal: bogført værdi/pris, 12-måneders forward indtjening/pris og udbetalingsprocent.

Der foretages ikke valutaafdækning.

Produktinformation

ISIN DK0010297704

Porteføljevaluta DKK

Morningstar rating (30-06-2021) ★ ★ ★

Morningstar kategori (MS) Aktier - Europa Large Cap Value

Benchmark (BM) MSCI Europe Value (DKK)

Startdato 18-05-2001

Risikoprofil **1 2 3 4 5 6 7**

Positioner 237

ÅOP 0,53 %

Indirekte handelsomkostninger 0,01 %

Adm. omk. 0,40 %

Emissionstillæg 0,32 %

Indløsningsfradrag 0,12 %

Beskatningsform Realisationsbeskattet

Udbyttebetalende Ja

Børsstatus Børsnoteret

SFDR artikel Artikel 6

Velegnet til Frie midler, pensions- og børneopsparing, samt midler i A/S, ApS og på Aktiesparekonto

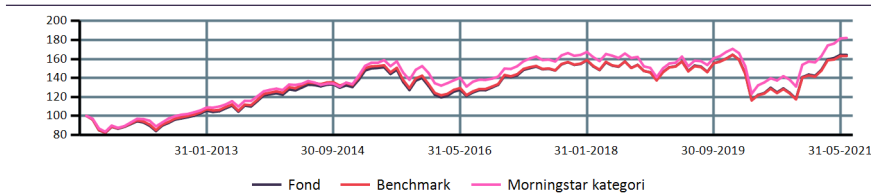
Afkast

	Fond	BM	MS
ÅTD	14,47%	14,35%	15,83%
1 måned	-0,06%	-0,02%	0,28%
3 måneder	2,97%	2,84%	4,55%
1 år	26,75%	26,80%	30,54%
3 år p.a.	2,67%	2,34%	4,19%
5 år p.a.	6,31%	6,00%	6,85%
10 år p.a.	5,09%	5,02%	6,18%
Siden start p.a.	2,07%	2,44%	2,92%

Nøgletal - 3 år

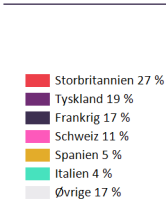
	Fond	BM
Volatilitet	21,10%	21,20%
Sharpe ratio	0,14	0,13
Tracking error		0,48%

Akkumulerede afkast

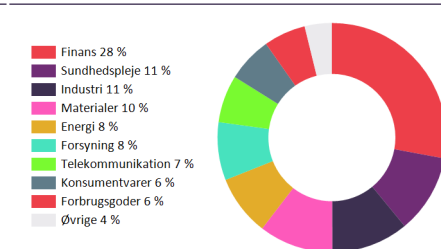


	2012	2013	2014	2015	2016	2017	2018	2019	2020	2021
Fond	20,94%	5,24%	0,96%	0,96%	7,95%	8,89%	-10,90%	19,31%	-12,71%	14,47%
Benchmark	21,34%	5,40%	0,87%	0,87%	7,02%	8,40%	-11,44%	19,72%	-13,25%	14,35%
Morningstar kategori	21,77%	3,66%	8,97%	8,97%	3,12%	9,64%	-14,31%	21,23%	-7,83%	15,83%

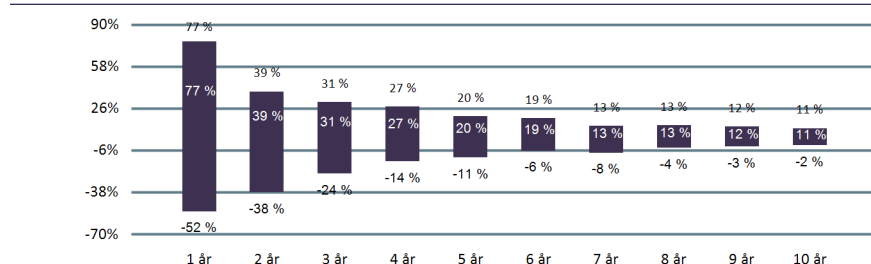
Landefordeling



Sektorfordeling



Historisk afkastspænd



Top 5 positioner

Selskab/Udsteder	Sektor	Land	Vægt
Novartis AG-REG	Sundhedspleje	Schweiz	3,88%
Siemens AG-REG	Industri	Tyskland	2,20%
Hsbc Holdings PLC	Finans	Storbritannien	2,19%
Sanofi	Sundhedspleje	Frankrig	2,19%
Glaxosmithkline PLC	Sundhedspleje	Storbritannien	1,99%