

Sparinvest INDEX USA 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 amerikanske value-aktier, og universet udgøres af samtlige aktier, som indgår i indekset MSCI USA 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, hvorfor danske investorer er fuldt eksponeret mod udvikling i den amerikanske dollar (USD).

Produktinformation

ISIN DK0010298439

Porteføljevaluta DKK

Morningstar rating (30-06-2021) ★ ★ ★

Morningstar kategori (MS) Aktier - USA Large Cap Value

Benchmark (BM) MSCI USA Value (DKK)

Startdato 18-05-2001

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

Positioner 395

ÅOP 0,54 %

Indirekte handelsomkostninger 0,01 %

Adm. omk. 0,50 %

Emissionstillæg 0,10 %

Indløsningsfradrag 0,10 %

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

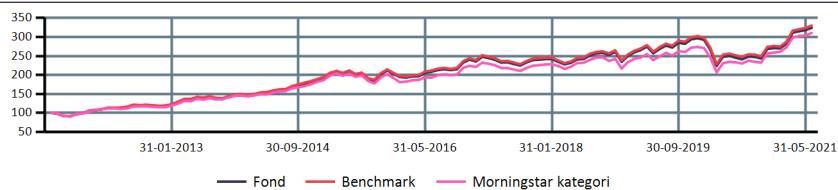
Afkast

	Fond	BM	MS
ÅTD	19,83%	19,50%	19,99%
1 måned	1,99%	2,06%	2,14%
3 måneder	4,12%	4,25%	4,19%
1 år	32,22%	31,30%	33,23%
3 år p.a.	10,28%	10,32%	10,22%
5 år p.a.	9,25%	9,31%	10,03%
10 år p.a.	12,49%	12,70%	12,01%
Siden start p.a.	3,56%	4,12%	4,50%

Nøgletal - 3 år

	Fond	BM
Volatilitet	18,57%	18,46%
Sharpe ratio	0,55	0,55
Tracking error		0,43%

Akkumulerede afkast

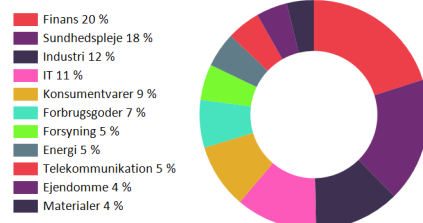


	2012	2013	2014	2015	2016	2017	2018	2019	2020	2021
Fond	25,24%	27,13%	8,43%	8,43%	18,34%	0,63%	-2,99%	26,60%	-8,83%	19,83%
Benchmark	25,53%	26,57%	8,49%	8,49%	18,86%	0,64%	-3,09%	27,08%	-8,57%	19,50%
Morningstar kategori	26,98%	24,77%	5,59%	5,59%	16,78%	1,63%	-4,71%	26,21%	-5,41%	19,99%

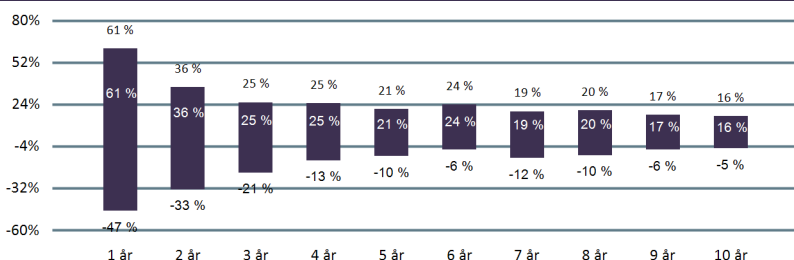
Landefordeling



Sektorfordeling



Historisk afkastspænd



Top 5 positioner

Selskab/Udsteder	Sektor	Land	Vægt
Jpmorgan Chase & Co	Finans	USA	2,40%
Johnson & Johnson	Sundhedspleje	USA	2,29%
Berkshire Hathaway Inc-CL B	Finans	USA	2,04%
Unitedhealth Group Inc	Sundhedspleje	USA	1,95%
Procter & Gamble Co/The	Konsumentvarer	USA	1,80%