



Sparinvest - INDEX USA Value KL

2024-06-30

Investeringsbeskrivelse

Investeringsstrategien er passiv med det formål at skabe lignende afkast- og risikoprofil som afdelingens benchmark. Der fokuseres udelukkende på nordamerikanske value-aktier, og universet udgøres af aktier, som indgår i afdelingens benchmark. Screeningen, som ligger til grund for benchmark-indekset, foretages på baggrund af tre nøgletal: Bogført værdi/pris, 12-måneders forward-indtjening/pris og udbetalingsprocent. Der foretages ikke valutaafdækning.

Produktinformation

ISIN	DK0010298439
Porteføljevaluta	DKK
Andelsklassevaluta	DKK
Indre værdi (Pr. 30-06-2024)	94,31
Morningstar rating (30-06-2024)	★ ★ ★
Morningstar kategori (MS)	Aktier - USA Large Cap Value
AuM (DKK mill.)	494
Benchmark (BM)	MSCI USA Value ex Select Securities Index
Startdato	18-05-2001
Risikoprofil	1 2 3 4 5 6 7
Positioner	388
Handelsomkostninger	0,01 %
Adm. omk.	0,50 %
Emissionstillæg	0,10 %
Indløsningsfradrag	0,10 %
Beskatningsform	Realisationsbeskattet
Udbyttebetalende	Ja
Børsstatus	Børsnoteret
SFDR artikel	Artikel 8
Velegnet til	Aktiesparekonto, Aldersopsparing, Børneopsparing, Frie midler, Pensionsopsparing, Selskabsmidler

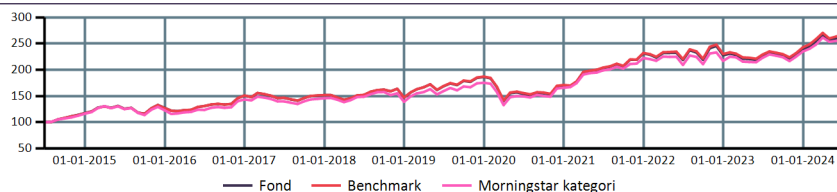
Afkast

	Fond	BM	MS
ÅTD	10,15%	10,11%	10,00%
1 måned	1,54%	1,51%	1,26%
3 måneder	-1,04%	-1,12%	-1,20%
1 år	16,26%	16,65%	15,89%
3 år p.a.	9,00%	9,38%	9,11%
5 år p.a.	9,36%	9,61%	10,15%
10 år p.a.	10,18%	10,33%	9,95%
Siden start p.a.	4,25%	4,79%	5,09%

Nøgletal - 3 år

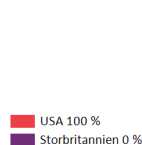
	Fond	BM
Volatilitet	13,05%	13,02%
Sharpe ratio	0,52	0,55
Tracking error		0,30%

Akkumulerede afkast

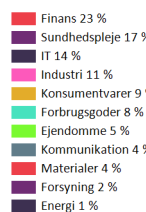


	2015	2016	2017	2018	2019	2020	2021	2022	2023	2024
Fond	8,44%	18,34%	0,63%	-2,99%	26,60%	-8,83%	36,13%	-1,62%	5,21%	10,15%
Benchmark	8,49%	18,86%	0,64%	-3,09%	27,08%	-8,57%	35,77%	-0,87%	5,53%	10,11%
Morningstar kategori	5,59%	16,78%	1,63%	-4,71%	26,21%	-5,41%	34,13%	-2,42%	8,26%	10,00%

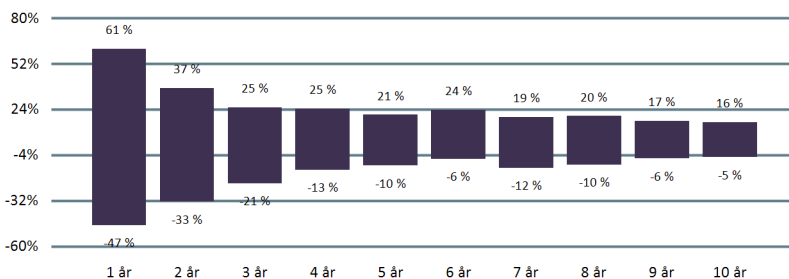
Landefordeling



Sektorfordeling



Historisk afkastspænd



Figuren viser udsvingene i de historiske afkast målt over forskellige investeringsperioder baseret på fondens investeringsmæssige afkast. Søjlernes yderpunkter viser det højeste (maks.) og laveste (min.) årlige afkast i investeringsperioden.

Top 5 positioner

Selskab/Udsteder	Sektor	Land	Vægt
Broadcom Inc	IT	USA	3,60%
Jpmorgan Chase & Co	Finans	USA	3,01%
Berkshire Hathaway Inc	Finans	USA	2,74%
Unitedhealth Group Inc	Sundhedspleje	USA	2,45%
Procter & Gamble Co/The	Konsumentvarer	USA	2,03%