

Mellemlange obligationer

2024-03-31

Investeringsbeskrivelse

Fonden investerer i danske stats- og realkreditobligationer, og henvender sig alene til danske almene boligorganisationer. Fonden søger at opnå en middel renterisiko ved at holde den samlede varighed mellem 3 og 6 år. Fonden investerer i overensstemmelse med § 49, stk. 2, i bekendtgørelse om drift af almene boliger m.v.

Produktinformation

ISIN	DK0016027485
Porteføljevaluta	DKK
Andelsklassevaluta	DKK
Indre værdi (Pr. 31-03-2024)	92,95
Morningstar rating (31-03-2024)	★ ★ ★ ★
AuM (DKK mill.)	1.532
Benchmark (BM)	50% Nykredit CM Gvt. 5Y og 25% Nykredit CM Bullet Cov. 3Y og 25% Nykredit CM Callable Mtg. 5Y
Startdato	30-09-1999
Risikoprofil	1 2 3 4 5 6 7
Positioner	77
Handelsomkostninger	0,05 %
Adm. omk.	0,20 %
Emissionstillæg	0,10 %
Indløsningsfradrag	0,10 %
Beskatningsform	Realisationsbeskattet
Udbyttebetalende	Ja
Børsstatus	Ikke børsnoteret
SFDR artikel	Artikel 8
Velegnet til	

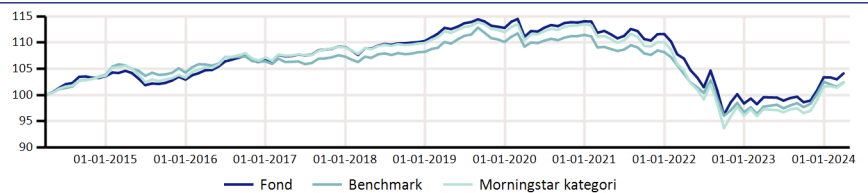
Afkast

	Fond	BM	MS
ÅTD	0,73%	-0,10%	0,67%
1 måned	1,10%	0,86%	0,89%
3 måneder	0,73%	-0,10%	0,67%
1 år	4,57%	4,73%	5,16%
3 år p.a.	-2,47%	-2,11%	-2,75%
5 år p.a.	-1,59%	-1,44%	-1,82%
10 år p.a.	0,40%	0,24%	0,23%
Siden start p.a.	3,23%	2,99%	2,84%

Nøgletal - 3 år

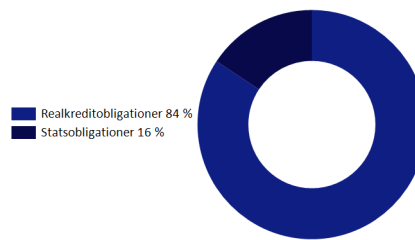
	Fond	BM
Volatilitet	5,62%	4,60%
Sharpe ratio	-0,72	-0,80
Tracking error		1,67%
Varighed	4,24	
Effektiv rente	3,28%	
OAS	5	2

Akkumulerede afkast

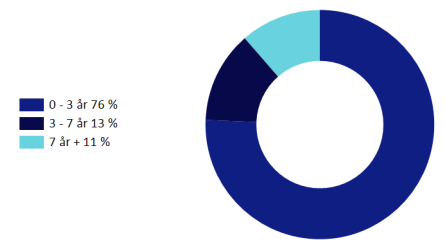


	2015	2016	2017	2018	2019	2020	2021	2022	2023	2024
Fond	-0,63%	3,74%	2,20%	1,06%	2,27%	1,12%	-2,13%	-11,87%	5,08%	0,73%
Benchmark	0,43%	2,04%	0,87%	0,84%	1,74%	1,22%	-2,94%	-10,61%	6,01%	-0,10%
Morningstar kategori	-0,35%	3,71%	1,80%	0,78%	1,88%	1,37%	-3,04%	-12,71%	5,78%	0,67%

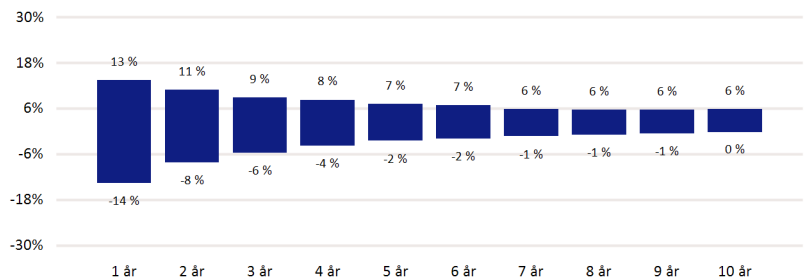
Obligationstypefordeling



Varighedsfordeling



Historisk afkastspænd



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

Top 5 udstedere

Selskab/Udsteder	Positioner	Land	Vægt
Nykredit A/S	20	Danmark	23,55%
Dir Kredit A/S	16	Danmark	21,38%
Danske Bank A/S	17	Danmark	19,07%
Kingdom Of Denmark	3	Danmark	15,76%
Nordea Bank Abp	9	Finland	11,14%