

Sparinvest INDEX Globale Aktier Min. Risiko KL

2021-06-30



Investeringsbeskrivelse

Der investeres i selskaber, som indgår i MSCI World Minimum Volatility (EUR Optimized) indekset. Udvælgelsen som ligger til grund for indekset foretages på baggrund af en optimeringsproces blandt aktierne, der indgår i det globale markedsindeks MSCI World Index. Bemærk dog at selvom denne optimeringsproces sigter mod at reducere risikoen, vil aktieinvestering altid være forbundet med risiko. Porteføljen sammensættes med eneste formål at skabe lignende afkast- og risikoprofil som markedsindekset under behørigt hensyn til handelsomkostninger. Investorerne skal være forberedt på, at afdelingens beviser kan svinge i værdi. Der foretages ikke afdækning af valutarisikoen.

Produktinformation

ISIN DK0060031847

Porteføljevaluta DKK

Morningstar rating (30-06-2021) ★ ★ ★ ★

Morningstar kategori (MS) Aktier - Globale Large Cap Blend

Benchmark (BM) MSCI World Minimum Volatility Optimized in EUR (DKK/SPI)

Startdato 16-03-2007

Strategi lancering 05-07-2010

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

Positioner 302

ÅOP 0,55 %

Indirekte handelsomkostninger 0,01 %

Adm. omk. 0,50 %

Emissionstillæg 0,12 %

Indløsningsfradrag 0,11 %

Beskatningsform Realisationsbeskattet

Udbyttebetalende Ja

Børsstatus Børsnoteret

SFDR artikel Artikel 6

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

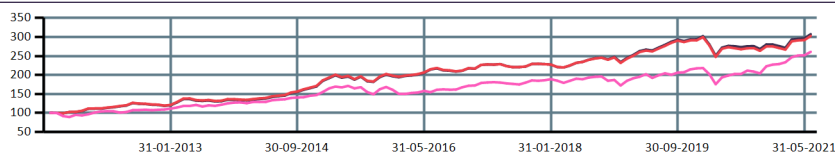
Afkast

| | Fond | BM | MS |
|------------------|--------|--------|--------|
| ÅTD | 9,76% | 10,09% | 14,87% |
| 1 måned | 3,72% | 3,79% | 3,63% |
| 3 måneder | 4,77% | 4,94% | 5,78% |
| 1 år | 11,50% | 12,01% | 28,89% |
| 3 år p.a. | 9,45% | 8,95% | 11,41% |
| 5 år p.a. | 7,50% | 7,09% | 11,05% |
| 10 år p.a. | 11,89% | 11,72% | 10,07% |
| Siden start p.a. | 11,71% | 11,39% | 10,19% |

Nøgletal - 3 år

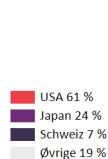
| | Fond | BM |
|----------------|--------|--------|
| Volatilitet | 12,72% | 12,85% |
| Sharpe ratio | 0,74 | 0,69 |
| Tracking error | | 0,55% |

Akkumulerede afkast

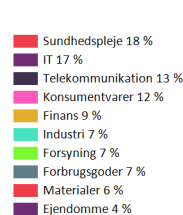


| | 2012 | 2013 | 2014 | 2015 | 2016 | 2017 | 2018 | 2019 | 2020 | 2021 |
|----------------------|--------|--------|--------|--------|--------|-------|--------|--------|--------|--------|
| Fond | 13,05% | 26,83% | 15,92% | 15,92% | 10,68% | 5,08% | 2,30% | 25,82% | -4,75% | 9,76% |
| Benchmark | 13,47% | 26,58% | 15,93% | 15,93% | 9,93% | 4,88% | 1,36% | 25,76% | -5,55% | 10,09% |
| Morningstar kategori | 17,31% | 15,16% | 9,61% | 9,61% | 6,51% | 8,47% | -7,47% | 26,31% | 4,54% | 14,87% |

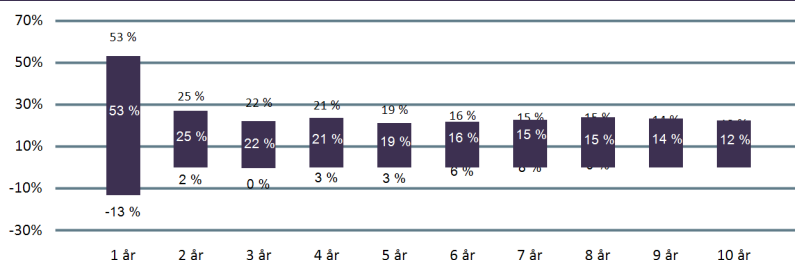
Landefordeling



Sektorfordeling



Historisk afkastspænd



Top 5 positioner

| Selskab/Udsteder | Sektor | Land | Vægt |
|----------------------------|-------------------|----------|-------|
| Deutsche Telekom AG-REG | Telekommunikation | Tyskland | 1,54% |
| Nestle SA-REG | Konsumentvarer | Schweiz | 1,40% |
| Verizon Communications Inc | Telekommunikation | USA | 1,31% |
| Nextera Energy Inc | Forsyning | USA | 1,24% |
| Johnson & Johnson | Sundhedspleje | USA | 1,21% |