

Sparinvest INDEX Stabile Obligationer KL A

2021-06-30



Investeringsbeskrivelse

Investeringsstrategien er sammensat med det formål at være placeret neutralt i forhold til markedsindekset, dvs. det bestræbes at skabe samme afkast- og risikoprofil som på markedsindekset, og succeskriteriet vil således være en så lav tracking error som mulig. Afdelingen har en varighedsbegrænsning på 3. Den korte porteføljevaregthed betyder, at man som investor sjældent vil opleve store og meget pludselige kursudsving. Afdelingen investerer primært i korte stats- og realkreditobligationer, hvilket betyder, at obligationerne har særlig høj sikkerhed.

Produktinformation

ISIN	DK0060057487
Porteføljevaluta	DKK
Morningstar rating (30-06-2021)	★★
Formue andelsklasse (DKK mill.)	2.199
Benchmark (BM)	20% Bloomberg Barclays Series-E Denmark Govt 1-5 + 30% Nykredit Lange Plus Index + 50% Nordea CM 3 NC (DKK) (SPI)
Startdato andelsklasse	18-12-2006
Startdato	18-12-2006
Strategi lancering	16-01-2014
Risikoprofil	1 2 3 4 5 6 7
Positioner	103
ÅOP	0,22 %
Indirekte handelsomkostninger	0,05 %
Adm. omk.	0,19 %
Emissionstillæg	0,13 %
Indløsningsfradrag	0,13 %
Beskatningsform	Realisationsbeskattet
Udbyttebetalende	Ja
Børsstatus	Børsnoteret
SFDR artikel	Artikel 8
Velegnet til	Frie midler, pensions- og ørneopsparing, samt midler i A/S og ApS

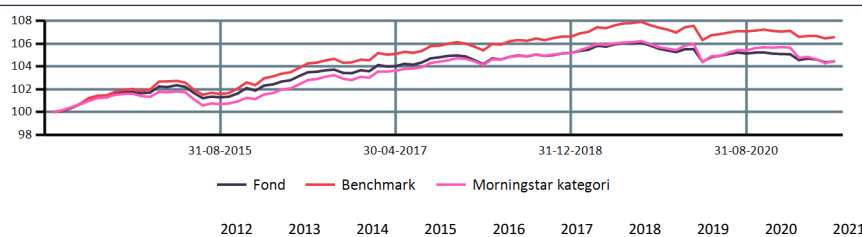
Afkast

	Fond	BM	MS
ÅTD	-0,61%	-0,45%	-1,15%
1 måned	0,08%	0,10%	0,19%
3 måneder	-0,24%	-0,09%	-0,34%
1 år	-0,62%	-0,38%	-0,70%
3 år p.a.	-0,17%	0,08%	-0,14%
5 år p.a.	0,18%	0,44%	0,33%
Siden start p.a.	0,65%	0,92%	0,65%

Nøgletal - 3 år

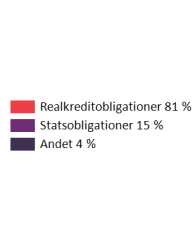
	Fond	BM
Volatilitet	0,85%	0,95%
Sharpe ratio	0,22	0,46
Tracking error		0,21%
Varighed	2,56	
Effektiv rente	0,27%	

Akkumulerede afkast

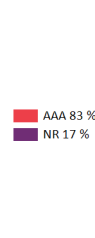


	2012	2013	2014	2015	2016	2017	2018	2019	2020	2021
Fond	0,17%	0,17%	1,76%	1,16%	0,30%	0,07%	-0,16%	-0,61%		
Benchmark	0,38%	0,38%	2,18%	1,35%	0,59%	0,33%	0,08%	-0,45%		
Morningstar kategori	-0,19%	-0,19%	1,94%	1,54%	0,47%	0,26%	0,25%	-1,15%		

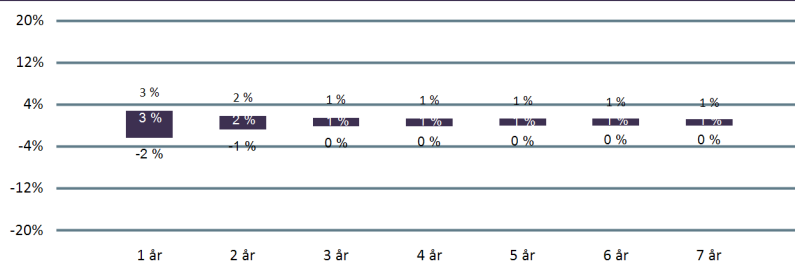
Obligationstypefordeling



Ratingfordeling



Historisk afkastspænd



Top 5 positioner

Selskab/Udsteder	Positioner	Land	Vægt
Realkredit Danmark	24	DK	22,94%
Nykredit Realkredit	27	DK	22,61%
Jyske Realkredit A/S	17	DK	19,68%
Denmark Govt.	2	DK	14,31%
Nordea Realkredit	25	DK	10,96%