

Sparinvest SICAV - Global Ethical High Yield DKK R H

2024-08-31

Investeringsbeskrivelse

Fonden søger at levere et positivt afkast på langt sigt ved at investere mindst 2/3 af sine samlede nettoaktiver i højtforrentede virksomhedsobligationer. Fonden kan, i begrænset omfang, investere i ikke-vurderede virksomhedsobligationer, CoCo-værdipapirer (under 10 % af de samlede nettoaktiver) og/eller andre fastforrentede omsættelige værdipapirer og/eller likvide aktiver og/eller almindeligt handlede pengemarkedsinstrumenter med en restløbetid på op til 12 måneder. Fonden kan eje aktier og aktielignende værdipapirer, der erhverves i forbindelse med restruktureret af en udstedende virksomhed eller en anden virksomhedsrelateret hændelse. Der er ingen begrænsninger i forhold til investeringernes valuta. Fonden kan investere i alle regioner, herunder nye markeder. Fonden anvender derivater til at beskytte porteføljen mod valutaudsving. Miljømæssige og sociale egenskaber samt god selskabsledelse af de virksomheder, der investeres i, tages i betragtning, når der træffes investeringsbeslutninger. Fonden anvender etisk screening af potentielle investeringsvirksomheder, hvilket kan udelukke visse virksomheder eller værdipapirer fra investering. De etiske screeningkriterier omfatter involvering i produktion og/eller distribution af visse varer og tjenesteydelser såsom eksempelvis alkohol, hasardspil, tobak, pornografi, militært udstyr, oliesand og termisk kul samt overholdelse af internationale standarder for menneskerettigheder, miljø, arbejdsmarkedsforhold og bekæmpelse af korruption. Fonden støtter miljømæssige og sociale egenskaber, men har ikke bæredygtig investering som målsætning.

Produktinformation

Strategi	Bonds / Value
ISIN	LU1735614155
Porteføljevaluta	EUR
Andelsklassevaluta	DKK
Indre værdi (Pr. 31-08-2024)	871,14
Morningstar rating (31-08-2024)	★ ★ ★
Morningstar kategori (MS)	Obligationer - Globale Højrente EUR Valutasikret
Formue andelsklasse (DKK mill.)	165
AUM subfund (DKK mill.)	877
Formue strategi	12.307
Benchmark (BM)	ICE BofAML Global High Yield - DKK Hedged
Porteføljemanager	Cristina Stef, Anders Kjær Glibstrup, Jacob Beck Petersen
Forening	Sparinvest SICAV
Startdato andelsklasse	15-12-2017
Startdato	15-12-2017
Risikoprofil	1 2 3 4 5 6 7
Positioner	210
Forventet adm. omk.*	1,35 %
Administrationsgebyr	1,07 %
SFDR artikel	Artikel 8
Velegnet til	

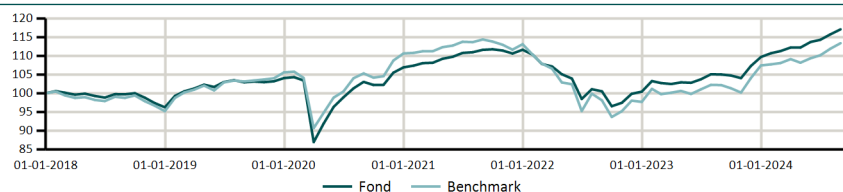
Afkast

	Fond	BM
ÅTD	6,74%	5,54%
1 måned	1,16%	1,31%
3 måneder	2,97%	3,69%
1 år	11,48%	10,95%
3 år p.a.	1,61%	-0,29%
5 år p.a.	2,61%	1,91%
Siden start p.a.	2,37%	1,89%

Nøgletal - 3 år

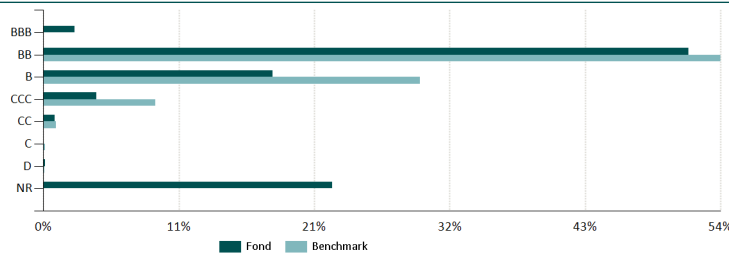
	Fond	BM
Volatilitet	5,91%	7,96%
Sharpe ratio	-0,07	-0,29
Tracking error		2,62%
MktUp ratio		78,24
MktDwn ratio		60,75
Varighed	2,86	
Effektiv rente	7,80%	6,70%
OAS	448	350

Akkumulerede afkast

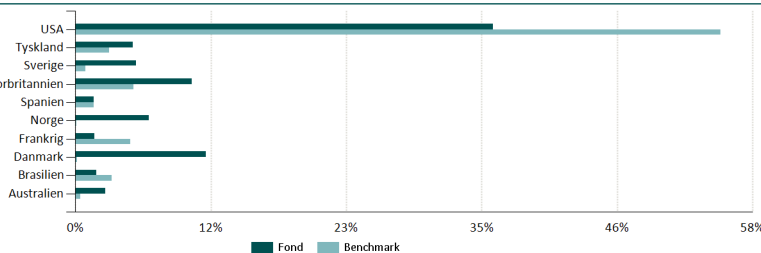


	2015	2016	2017	2018	2019	2020	2021	2022	2023	2024	
Fond				-0,03%	-3,75%	8,09%	2,75%	4,40%	-10,03%	9,22%	6,74%
Benchmark				0,02%	-4,80%	10,88%	4,79%	2,24%	-13,62%	9,96%	5,54%

Ratingfordeling



Landefordeling



Top 10 udstedere

Selskab/Udsteder	Udsteder	Land	Vægt
4.13% Nykredit Realkredit As	Nykredit Realkredit AS	Danmark	1,58%
8.44% Sgl Group Aps 2030	SGL Group ApS	Danmark	1,56%
10.08% Kruk Sa 2028	KRUK SA	Polen	1,39%
6.75% Topsoe A/S 3024	Topsoe A/S	Danmark	1,30%
6.75% Eurofins Scientific Se	Eurofins Scientific SE	Luxembourg	1,16%
11.13% Esmaeilzadeh Holding Ab 2025	Esmaeilzadeh Holding AB	Sverige	1,14%
7.00% Jyske Bank A/S	Jyske Bank A/S	Danmark	1,14%
5.63% Iron Mountain Inc 2032	Iron Mountain Inc	USA	1,13%
5.63% Lancashire Holdings Ltd 2041	Lancashire Holdings Ltd	Bermuda	1,11%
8.13% B&M European Value Retail Sa 2030	B&M European Value Retail SA	Luxembourg	1,09%