



# Sparinvest - INDEX Nye Obligationsmarkeder

2023-11-30

## Investeringsbeskrivelse

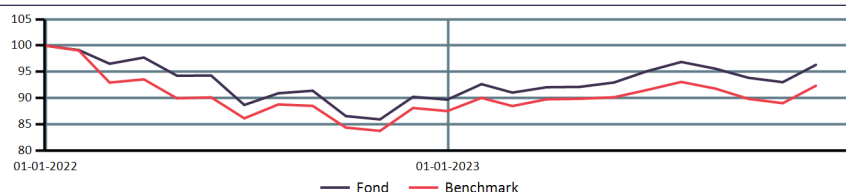
Afdelingen investerer i et bredt udsnit af stats- og virksomhedsobligationer fra udviklingslande som indgår i afdelingens benchmark. Der investeres både i lokal og hård valuta (primært USD og EUR), hvor valutaeksponeringen i USD afdækkes til EUR eller DKK. Investeringsstrategien er sammensat med det ene formål at være placeret neutralt i forhold til benchmark, dvs. det bestræbes at skabe samme afkast- og risikoprofil som på benchmark. Succeskriteriet vil således være en så lille afvigelse (positiv som negativ) fra benchmark.

## Produktinformation

Strategi	Bonds / Index
ISIN	DK0060254043
Porteføljevaluta	DKK
Andelsklassevaluta	DKK
Indre værdi (Pr. 30-11-2023)	87,67
Morningstar rating (30-11-2023)	★★★★★
Morningstar kategori (MS)	Obligationer - Nye Markeder EUR Fokus
AuM (DKK mill.)	680
Benchmark (BM)	50% JPM ESG EMBI Custom (DKK Hedged) + 50% JPM ESG GBI-EM Custom
Porteføljemanager	Morten Steen Pedersen
Forening	Værdipapirfonden Sparinvest
Startdato	04-10-2010
Strategi lancering	31-12-2021
Risikoprofil	1 2 3 4 5 6 7
Positioner	238
Handelsomkostninger	0,07 %
Forventet adm. omk.	0,53 %
Administrationsgebyr	0,32 %
SFDR artikel	Artikel 8
Velegnet til	Aldersopsparing, Børneopsparing, Frie midler, Pensionsopsparing, Selskabsmidler

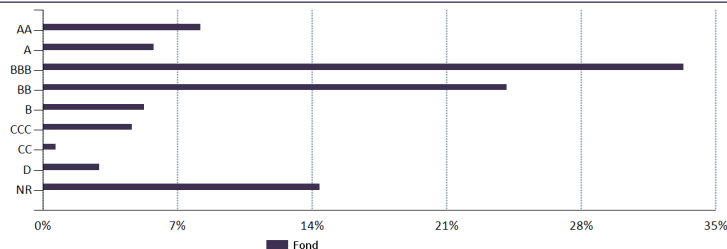
Afkast	Nøgletal - 3 år		
	Fond	BM	
ÅTD	7,39%	5,51%	
1 måned	3,55%	3,73%	
3 måneder	0,77%	0,60%	
1 år	6,75%	4,81%	
Siden start p.a.	-1,94%	-4,08%	
		OAS	
		Fond	246,34
		BM	
		Volatilitet	-
		Sharpe ratio	-
		Varighed	5,25
		Effektiv rente	8,54%

## Akkumulerede afkast

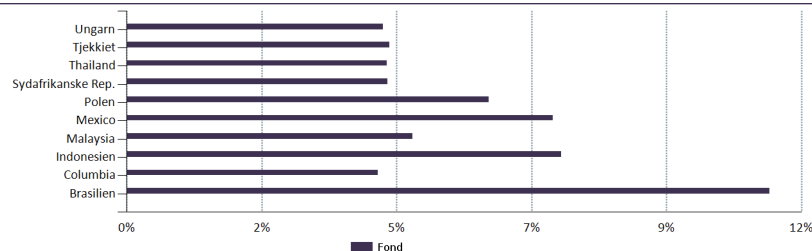


	2014	2015	2016	2017	2018	2019	2020	2021	2022	2023
Fond								0,00%	-10,31%	7,39%
Benchmark								0,00%	-12,48%	5,51%

## Ratingfordeling



## Obligationstypfordeling



## Top 10 udstedere

Selskab/Udsteder	Positioner	Land	Vægt
Federative Republic Of Brazil	9	Brasilien	10,96%
Republic Of Indonesia	12	Indonesien	7,24%
United Mexican States	9	Mexico	7,00%
Republic Of Poland	9	Polen	6,17%
Federation Of Malaysia	12	Malaysia	4,88%
Czech Republic	9	Tjekkiet	4,48%
Republic Of South Africa	8	Sydafrikanske Rep.	4,45%
Kingdom Of Thailand	5	Thailand	4,44%
Hungary	15	Ungarn	4,37%
Republic Of Colombia	11	Columbia	4,28%