

Bæredygtige kreditobligationer

2022-11-30

Investeringsbeskrivelse

Afdelingen investerer i investment grade-kreditobligationer primært udstedt i euro. Hovedparten af afdelingens formue placeres i en veldiversificeret portefølje af kreditobligationer med en kreditrating på A-BBB. Afdelingen investerer kun i begrænset omfang i obligationer med en kreditvurdering under BBB-. Afdelingen tilstræber en investeringsstrategi med fokus på afkastoptimering med middel risiko.

Produktinformation

Strategi	Bonds / Fixed income
ISIN	DK0060709814
Porteføljevaluta	DKK
Indre værdi (Pr. 30-11-2022)	893,32
Morningstar rating (30-11-2022)	★★★★
Morningstar kategori (MS)	Obligationer - EUR Virksomheder
AuM (DKK mill.)	609
Benchmark (BM)	ICE BofAML A - BBB Euro Corporate Index
Portfølje manager	Rasmus Gutknecht
Forening	Investeringsforeningen Nykredit Invest Engros
Startdato	27-04-2016
Risikoprofil	1 2 3 4 5 6 7
Positioner	203
Indirekte handelsomkostninger	0,20 %
Forventet adm. omk.	0,32 %
SFDR artikel	Artikel 8

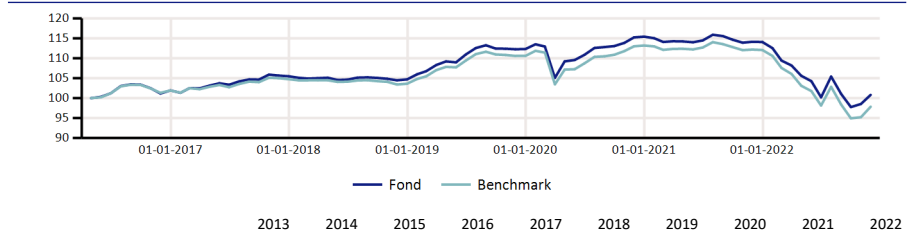
Afkast

	Fond	BM
ÅTD	-11,62%	-12,68%
1 måned	2,32%	2,76%
3 måneder	-0,21%	-0,55%
1 år	-11,66%	-12,76%
3 år p.a.	-3,52%	-3,99%
5 år p.a.	-0,93%	-1,40%
Siden start p.a.	0,12%	-0,33%

Nøgletal - 3 år

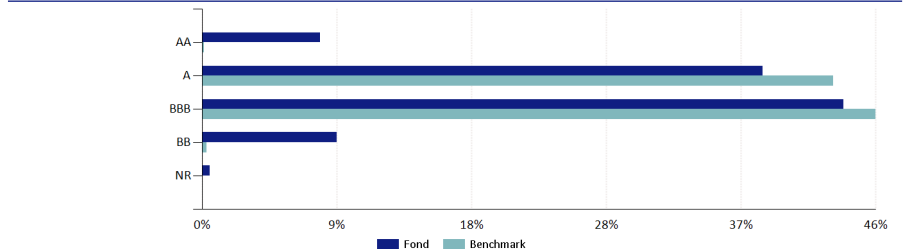
	Fond	BM
Volatilitet	7,51%	7,53%
Sharpe ratio	-0,46	-0,52
Tracking error		0,67%
Beta		1,00
Inf. ratio		0,73
MktUp ratio		104,09
MktDwn ratio		97,94
Varighed	4,56	
Effektiv rente	3,63%	

Akkumulerede afkast

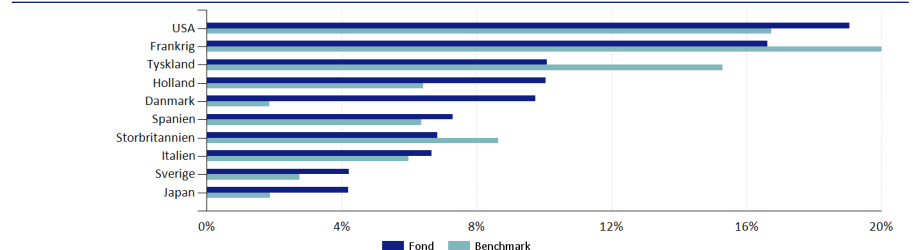


Fond	1,94%	3,49%	-0,74%	7,26%	2,77%	-1,17%	-11,62%
Benchmark	1,87%	2,78%	-1,09%	6,73%	2,36%	-1,00%	-12,68%

Ratingfordeling



Landefordeling



Top 10 udstedere

Selskab/Udsteder	Sektor	Land	Vægt
Intesa Sanpaolo Spa	3	Italien	3,46%
Kingdom Of The Netherlands Min	5	Holland	3,38%
Groupe Bpce	4	Frankrig	3,11%
Deutsche Bank Ag	5	Tyskland	2,46%
Telefonica Sa	3	Spanien	2,11%
Kingdom Of Denmark	4	Danmark	2,02%
Koninklijke Philips Nv	3	Holland	2,01%
Caixabank Sa	4	Spanien	1,97%
Danske Bank A/S	3	Danmark	1,79%
Orange Sa	2	Frankrig	1,78%