

September 2021

Afkastoppgørelse	September	År-til-dato	Siden start <sup>2</sup>	Siden ny rådgiver <sup>3</sup>	Afkast p.a.	Std. afv. p.a.
Fund	-0,05%	2,24%	132,22%	50,51%	3,90%	9,56%
Benchmark <sup>1</sup>	-0,06%	2,76%	208,54%	53,94%	5,25%	10,92%
<b>Performance</b>	<b>0,01%</b>	<b>-0,53%</b>	<b>-76,32%</b>	<b>-3,42%</b>	<b>-1,35%</b>	<b>-</b>

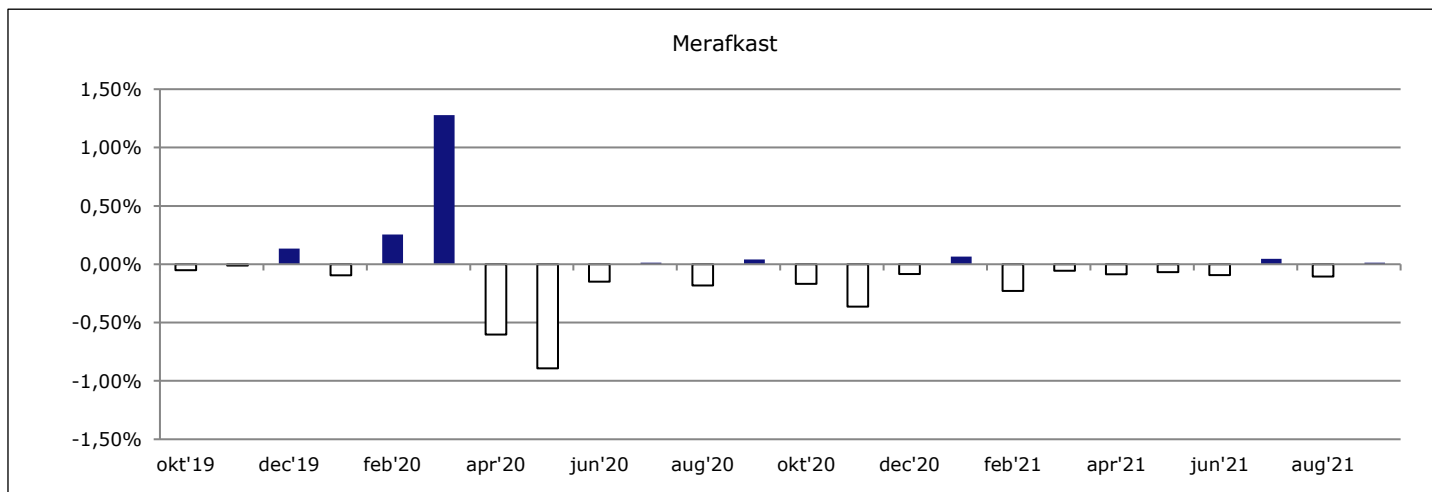
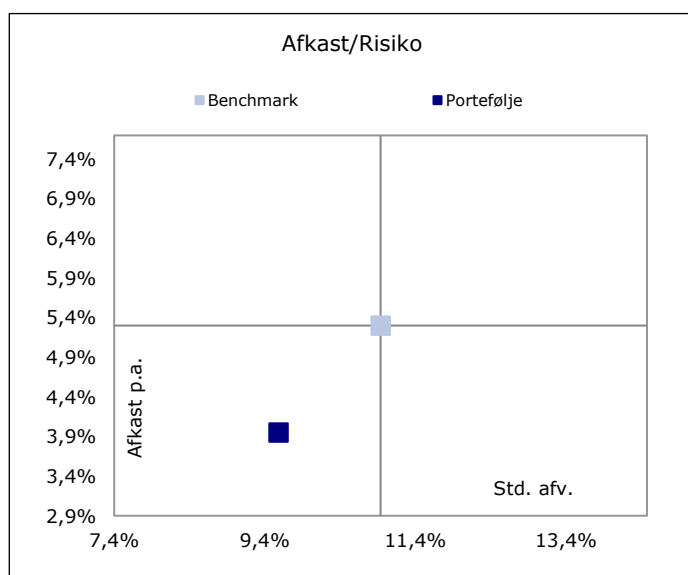
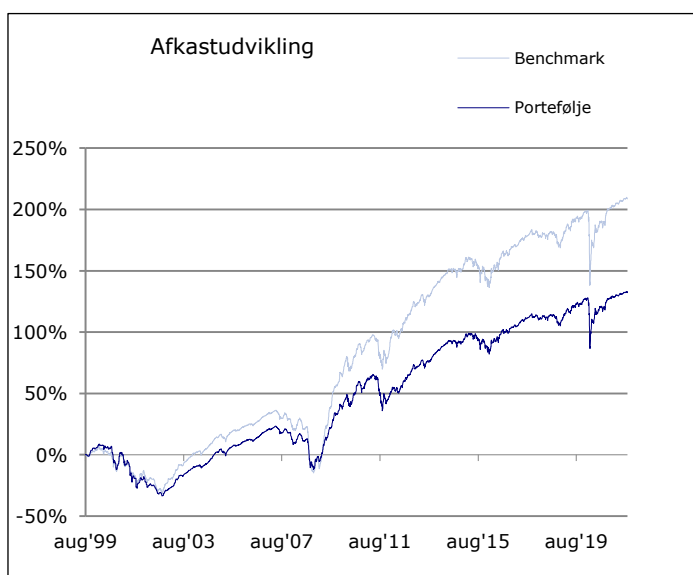
1) iBoxx EUR Liquid High Yield ex-Financials 75

2) 31-08-1999

3) 27-03-2012

Basisinfo		Performancenøgletal		Obligationsnøgletal		Beholdning	
Indre værdi	114,97	Information ratio	-0,39	Varighed	3,24	Kontantandel	1,00%
Formue (i mio.DKK)	1.232	Tracking error	3,39%	YTM	2,48%	Antal obligationer	85
Cirkl.mængde (stk.)	10.719.344	Sharpe ratio	0,20				

Afdelingens 5 største positioner	Udløb	Branche	Land	Valuta	Andel
NETFLIX INC NFLX 3.625 05/15/27	15-05-2027	Communications	USA	EUR	2,68%
THYSSENKRUPP TKAGR 2.875 02/22/24	22-02-2024	Basic Materials	Tyskland	EUR	2,64%
TELECOM ITALIA TITIM 4 04/11/24	11-04-2024	Communications	Italien	EUR	2,43%
FORD MOTOR CRED F 3.021 03/06/24	06-03-2024	Consumer, Cyclical	USA	EUR	2,37%
ALTICE FRANCE SFRFP 8 05/15/27	15-05-2027	Communications	Luxembourg	EUR	2,32%

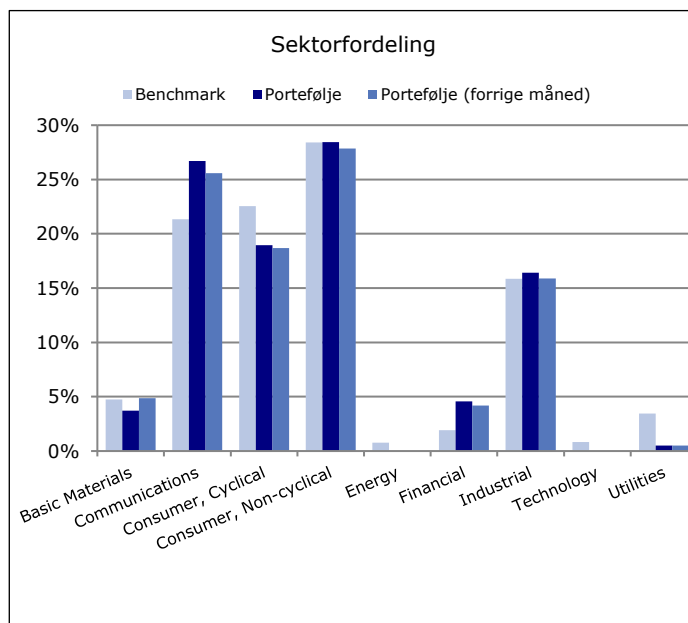
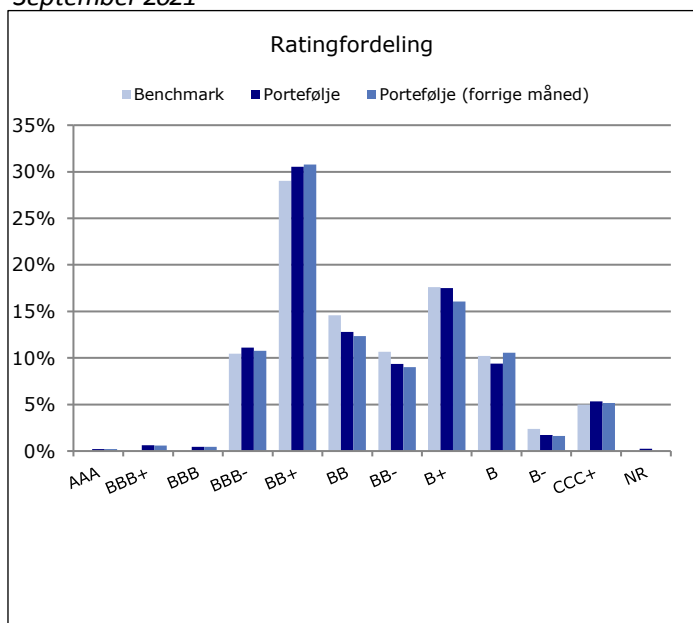


Nykredit Invest Engros -Højrente Europainvestorer primært i højtorrentede kreditobligationer med en kreditra under investment grade, strukturerede udstedelser og lignende værdipapirer udstedt af selskaber, der er hjemmehørende eller har hovedaktiviteten i Europa.

Kreditrating vil normalt ligge i området BB+ til CCC+ Afdelingen kan foretage valutakurssikring over i danske kroner.

Fondskode: DK001602802-0

September 2021



Nykredit Invest Engros -Højrente Europainvesteringer primært i højtforrentede kreditobligationer med en kredittra under investment grade, strukturerede udstedelser og lignende værdipapirer udstedt af selskaber, der er hjemmehørende eller har hovedaktiviteten i Europa.

Kreditrating vil normalt ligge i området BB+ til CCC+ Afdelingen kan foretage valutakurssikring over i danske kroner.  
Fondskode: DK001602802-0

## DISCLOSURE

Dette materiale er udarbejdet af Nykredit Asset Management, der er en del af Nykredit Bank A/S. Nykredit Bank A/S er en finansiel virksomhed, der er under tilsyn af Finanstilsynet. Nærværende materiale anvendes i forbindelse med vores investeringsrådgivning af de investorer, som vi har udarbejdet materialet til. Der gælder ikke et forbud mod at handle finansielle instrumenter or materialet inden udbredelsen heraf.

## DISCLAIMER

Dette materiale er udarbejdet af Nykredit Asset Management til personlig orientering for de investorer, som Nykredit Asset Management har udleveret materialet til. Materialet er baseret på offentligt tilgængelige oplysninger samt egne beregninger baseret herpå. Nykredit Asset Management påtager sig intet ansvar for rigtigheden, nøjagtigheden eller fuldstændigheden af informationerne i materialet. anbefalinger skal ikke opfattes som tilbud om køb eller salg af pågældende værdipapirer, og Nykredit Asset Management påtager sig intet ansvar for dispositioner foretaget på baggrund af oplysninger i materialet. Oplysninger i materialet om tidligere afkast, simulerede tidligere afkast eller fremtidige afkast kan ikke anvendes som en pålidelig indikator for fremtidige afkast, og afkast kan blive negativ. Oplysninger i materialet om kursudvikling kan ikke anvendes som en pålidelig indikator for fremtidig kursudvikling, og kursudvikling kan blive negativ. Gevinster kan blive forøget eller formindsket som følge af udsving i valutakurser. Såfremt materialet indeholder oplysninger om en særlig skattebehandling, skal investorer være opmærksomme på, at skattebehandlingen afhænger af den enkelte investors individuelle si og kan ændre sig fremover. Såfremt materialet indeholder oplysninger baseret på bruttoafkast, kan gebyrer, provisioner og andre omkostninger påvirke afkastet i nedadgående retning. Nykredit Bank A/S og/eller andre selskaber i Nykredit koncernen kan have positioner i værdipapirer omtalt i materialet samt foretage køb eller salg af samme, ligesom disse selskaber kan være involveret corporate finance-aktiviteter eller andre aktiviteter for virksomheder, der er omtalt i materialet. Materialet må ikke mangfoldiggøres eller distribueres uden samtykke fra Nykredit Asset Management.

**Nykredit Asset Management - Under Krystallen 1 - 1780 København V - Tlf. +45 4455 9200**