

Mellemlange obligationer

2022-06-30

Investeringsbeskrivelse

Afdelingen henvender sig alene til danske almene boligorganisationer og investerer i overensstemmelse med § 49, stk. 2, i bekendtgørelse om drift af almene boliger m.v. Afdelingen investerer primært i obligationer udstedt af den danske stat og af danske realkreditinstitutter. Afdelingen søger at opnå en middel renterisiko ved at holde den samlede varighed i porteføljen på mellem 3 og 6 år. Da foreningen har valgt en forsigtig strategi, kan afdelingen i korte perioder have en varighed under 3 år, hvis markedsforholdene tilsiger det.

Produktinformation

Strategi	Bonds / Fixed income
ISIN	DK0016027485
Porteføljevaluta	DKK
Indre værdi (Pr. 30-06-2022)	90,58
Morningstar rating (30-06-2022)	★★★★
AuM (DKK mill.)	1.554
Benchmark (BM)	BM Mellemlange Obligationer (NI)
Portfølje manager	Nykredit
Forening	Investeringsforeningen Nykredit Invest Almen Bolig
Administrationsgebyr	0,11 %
Startdato	30-09-1999
Risikoprofil	1 2 3 4 5 6 7
Positioner	75
Indirekte handelsomkostninger	0,04 %
Forventet adm. omk.	0,19 %
SFDR artikel	Artikel 6

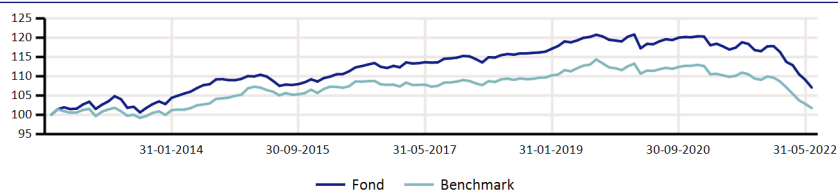
Afkast

	Fond	BM
ÅTD	-9,10%	-7,18%
1 måned	-1,80%	-1,03%
3 måneder	-5,13%	-3,48%
1 år	-8,80%	-7,59%
3 år p.a.	-3,72%	-3,37%
5 år p.a.	-1,16%	-1,05%
10 år p.a.	0,69%	0,17%
Siden start p.a.	3,37%	3,14%

Nøgletal - 3 år

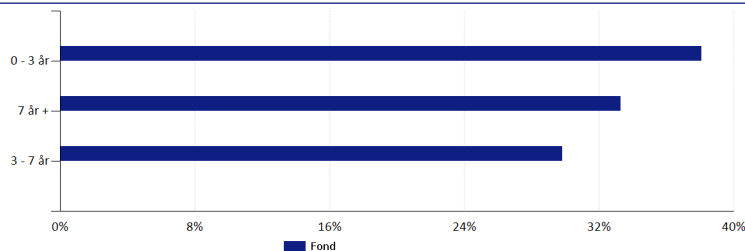
	Fond	BM
Volatilitet	3,45%	2,85%
Sharpe ratio	-1,00	-1,09
Tracking error		1,28%
Beta		1,13
Inf. ratio		-0,29
MktUp ratio		113,01
MktDwn ratio		111,62
Varighed	5,31	
Effektiv rente	2,60%	

Akkumulerede afkast

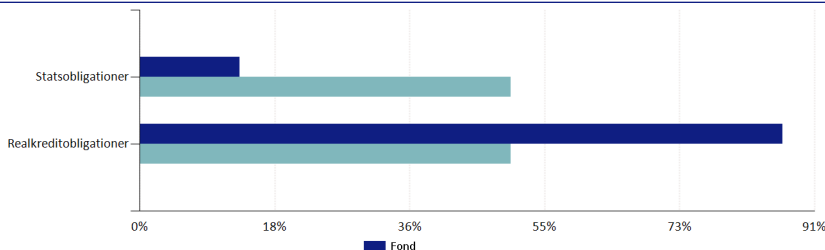


	2013	2014	2015	2016	2017	2018	2019	2020	2021	2022
Fond	-0,59%	6,35%	-0,63%	3,74%	2,20%	1,06%	2,27%	1,12%	-2,13%	-9,10%
Benchmark	-1,53%	5,23%	0,43%	2,04%	0,87%	0,84%	1,74%	1,22%	-2,94%	-7,18%

Varighedsfordeling



Obligationstypefordeling



Top 10 udstedere

Selskab/Udsteder	Positioner	Land	Vægt
Danske Bank A/S	21	Danmark	24,82%
Nykredit A/S	19	Danmark	24,28%
Dlr Kredit A/S	12	Danmark	13,47%
Kingdom Of Denmark	3	Danmark	12,94%
Nordea Bank Abp	7	Finland	9,90%
Danmarks Skibskredit A/S	3	Danmark	4,86%
Jyske Bank A/S	7	Danmark	3,80%
Nordea Kredit Ndash 1 01/01/24	1		3,18%
Dlr Kredit A/S Dlrkre 0.5 10/01/50	1		2,43%
Nykredit Realkredit As	3	Danmark	0,49%