



Investeringsprofil

Afdelingen investerer globalt i obligationer, obligationsbaserede UCITS og/eller investeringsinstitutter med stor eksponering til dansk realkredit, udenlandske statsobligationer samt globale virksomhedsobligationer med både høj og lav kreditkvalitet. Der kan anvendes afledte finansielle instrumenter. Afdelingen henvender sig til investorer med en investeringshorisont på over 3 år.

[To-siders flyer om Optima.](#)  
[Brochure om Optima.](#)

Forvalter

Michael Hauch, Obligationschef  
Anders Isager, Chefporteføljeforvalter  
Christian Meyersahm, Seniorporteføljeforvalter

Stamdata & nøgletal

|                                                                                                                                                                                                                                                               |                                            |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------------------|
| ISIN                                                                                                                                                                                                                                                          | DK0061272747                               |
| Forening                                                                                                                                                                                                                                                      | Værdipapirfonden BankInvest                |
| Startdato                                                                                                                                                                                                                                                     | 20.04.2020                                 |
| Investeringsunivers                                                                                                                                                                                                                                           | Blandede                                   |
| Børsstatus                                                                                                                                                                                                                                                    | Noteret                                    |
| Porteføljeforvalter                                                                                                                                                                                                                                           | BI Asset Management Fondsmæglerselskab A/S |
| Samlet formue (mio. kr.)                                                                                                                                                                                                                                      | 1.196                                      |
| Løbende omkostninger (%)                                                                                                                                                                                                                                      | 0,60                                       |
| Transaktionsomkostninger (%)                                                                                                                                                                                                                                  | 0,05                                       |
| Max. emissionstillæg (%)                                                                                                                                                                                                                                      | 0,28                                       |
| Max. indløsningsfradrag (%)                                                                                                                                                                                                                                   | 0,28                                       |
| Korrigeret varighed                                                                                                                                                                                                                                           | 3,40                                       |
| Effektiv rente                                                                                                                                                                                                                                                | 4,70                                       |
| Type                                                                                                                                                                                                                                                          | Udbyttebetalende                           |
| Valuta                                                                                                                                                                                                                                                        | DKK                                        |
| Beskatningsform                                                                                                                                                                                                                                               | Realisation                                |
| Benchmark                                                                                                                                                                                                                                                     |                                            |
| 50 % (50 % Nordea DK Bond CM 2Y Gov og 50 % Nykredit Danish Mortgage Bond Index. Denne del revægtes månedligt). 15 % Bloomberg Barclays EuroAgg Corporate afdækket til DKK. 25 % CIBOR 3M tillagt 1 procentpoint. 5 % JP Morgan GBI-EM Global Diversified.... |                                            |

Risiko



| Risiko                | Horisont | 3 år  | 3 år  | 3 år  | 3 år  |
|-----------------------|----------|-------|-------|-------|-------|
| Standardafvigelse (%) |          | 5,32  | 5,32  | 5,32  | 5,32  |
| Sharpe Ratio          |          | -0,70 | -0,70 | -0,70 | -0,70 |
| Information Ratio     |          | -0,70 | -0,70 | -0,70 | -0,70 |
| Tracking Error (%)    |          | 1,75  | 1,75  | 1,75  | 1,75  |

Afkast

●

Produkt

●

Benchmark

Årligt afkast og udbytte

|             | 2023 | 2022   | 2021  | 2020 | 2019 |
|-------------|------|--------|-------|------|------|
| ● Produkt   | 6,31 | -11,50 | -1,81 | N/A  | N/A  |
| ● Benchmark | 5,44 | -7,35  | -1,64 | 1,11 | 2,96 |
| Udbytte     | 0,00 | 0,00   | 1,60  | 0,10 | N/A  |

År til dato (ÅTD) og løbende afkast

|             | 1 md. | år til dato | 1 år | 3 år  | 5 år  |
|-------------|-------|-------------|------|-------|-------|
| ● Produkt   | 0,79  | 0,95        | 5,54 | -1,69 | N/A   |
| ● Benchmark | 0,57  | 0,73        | 4,52 | -0,56 | -0,24 |

Obligationstyper

Landefordeling obligationer

De største beholdninger i porteføljen

| Navn                           | Vægt   |
|--------------------------------|--------|
| 1.00% Jyske Realkredit 4/2028  | 7,00 % |
| 4.21% Dlr Kredit A/S 1/2028    | 5,23 % |
| 3.98% Dlr Kredit A/S 7/2026    | 4,08 % |
| 1.00% Realkredit Dnmrk 10/2050 | 3,91 % |
| 5.00% Nykredit 10/2053         | 3,40 % |