

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.

Bemærk, at afdelingen for nærværende kan have negative forventede afkast efter samfundsforudsætningerne og/eller horisontafkast og derfor muligvis ikke er egnet til visse investorer. Eksempelvis vil afdelingen alt andet lige ikke være egnet til investorer, der har mulighed for at placere indlån i pengeinstituttet til en bedre rente.

Forvalter

Michael Hauch, Obligationschef

Stamdata & nøgletal

ISIN	DK0061272903
Forening	Værdipapirfonden BankInvest
Startdato	20.04.2020
Investeringsunivers	Blandede
Børsstatus	Noteret
Porteføljeforvalter	BI Asset Management Fondsmæglerselskab A/S
Samlet formue (mio. kr.)	264
ÅOP (%)	0,64
Ind. handelsomk. (%)	0,02
Løbende omkostninger (%)	0,56
Korrigeret varighed	4,30
Effektiv rente	3,70
Type	Akkumulerende
Valuta	DKK
Beskatningsform	Lager
Benchmark	50 % (50 % Nordea DK Bond CM 2Y Gov og 50 % Nordea DK Mortgage Callable CM 5Y. 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. 5...

Risiko

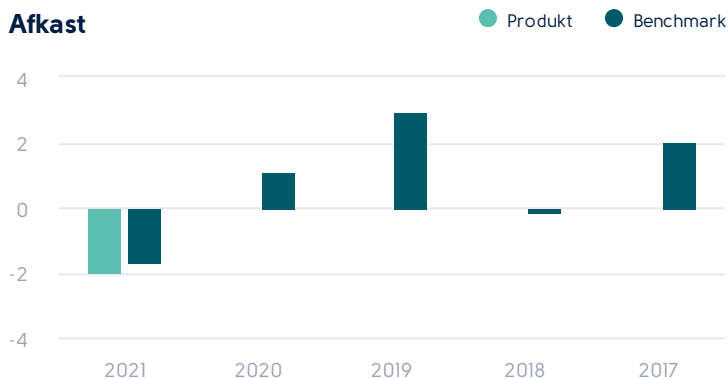


Lav risiko
Typisk lavt afkast

Høj risiko
Typisk højt afkast

Risiko	Afdelingen har endnu ikke 3 års historik
Standardafvigelse (%)	N/A
Sharpe Ratio	N/A
Information Ratio	N/A
Tracking Error (%)	N/A

Afkast



Årligt afkast og udbytte

	2021	2020	2019	2018	2017
Produkt	-1,95	N/A	N/A	N/A	N/A
Benchmark	-1,64	1,11	2,96	-0,10	2,04
Udbytte	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A

Annualiseret afkast i perioden

	1 md.	år til dato	1 år	3 år	5 år
Produkt	-2,81	-10,39	-10,64	N/A	N/A
Benchmark	-1,43	-6,47	-6,73	-2,34	-0,73

Obligationstyper

Realkreditinstitut	40.13%
Kreditobligation	37.82%
Stat eller sta...	17.17%
Andre	0.09%
Future	

Landefordeling obligationer

Danmark	47.75%
USA	8.95%
Tyskland	2.71%
Holland	2.37%
Mexico	1.83%
Storbritannien	1.79%
Brasilien	1.78%
Sydafrika	1.49%
Frankrig	1.49%
Indien	1.46%
Luxembourg	1.32%
Forenede Ar...	1.27%

De største beholdninger i porteføljen

Navn	Vægt
1% Brfkredit A/S 04/2026	9,41 %
1% Realkredit Danmark A/S 10/2050	7,84 %
1% Nykredit Realkredit A/S 10/2053	5,71 %
0.25% Denmark (kingdom Of) 11/2022	4,69 %
-0.23% Dlr Kredit A/S 07/2026	4,05 %