

Globale Aktier SRI

2022-08-31

Investeringsbeskrivelse

Afdelingen investerer globalt i aktier. Investeringsstilen er baseret på en kombination af kvantitativ og fundamental analyse med primær eksponering mod faktorerne value, momentum og kvalitet. Afdelingen administreres endvidere efter klassiske principper for social ansvarlig investering, og der investeres ikke i selskaber med aktiviteter inden for våben, alkohol, tobak, pornografi og hasardspil. Afdelingen henvender sig primært til den risikovillige investor med en lang investeringshorisont.

Produktinformation

Strategi	Equity / Quant
ISIN	DK0016286230
Porteføljevaluta	DKK
Indre værdi (Pr. 31-08-2022)	134,51
Morningstar rating (31-08-2022)	★★★★
Morningstar kategori (MS)	Aktier - Globale Large Cap Blend
AuM (DKK mill.)	209
Benchmark (BM)	BM Globale Aktier SRI (NI)
Portfølje manager	Nykredit
Forening	Investeringsforeningen Nykredit Invest
Administrationsgebyr	0,86 %
Startdato	31-08-2004
Risikoprofil	1 2 3 4 5 6 7
Positioner	134
Indirekte handelsomkostninger	0,05 %
Forventet adm. omk.	1,41 %
SFDR artikel	Artikel 8

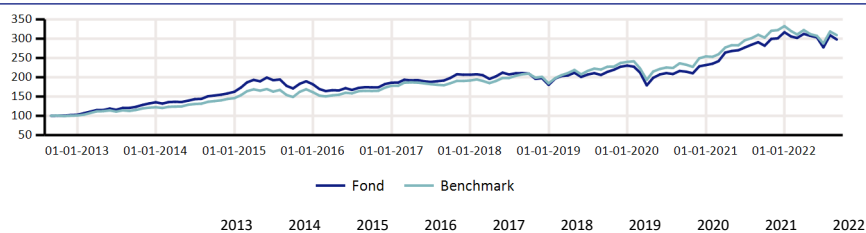
Afkast

	Fond	BM
ÅTD	-5,95%	-7,02%
1 måned	-3,60%	-2,94%
3 måneder	-1,79%	0,61%
1 år	2,41%	-0,29%
3 år p.a.	13,11%	12,03%
5 år p.a.	9,24%	11,53%
10 år p.a.	11,53%	11,95%
Siden start p.a.	9,71%	9,86%

Nøgletal - 3 år

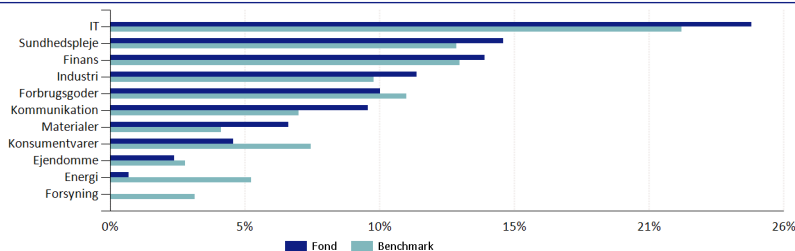
	Fond	BM
Volatilitet	18,08%	16,88%
Sharpe ratio	0,70	0,69
Tracking error		4,30%
Beta		1,04
Inf. ratio		0,22
MktUp ratio		101,53
MktDwn ratio		96,90

Akkumulerede afkast

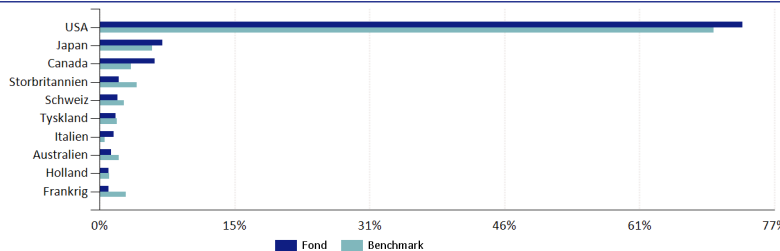


	2013	2014	2015	2016	2017	2018	2019	2020	2021	2022
Fond	31,53%	20,01%	12,09%	2,30%	11,03%	-12,70%	27,70%	0,62%	36,78%	-5,95%
Benchmark	21,19%	19,27%	10,66%	10,32%	7,66%	-3,89%	30,19%	5,92%	30,96%	-7,02%

Sektorfordeling



Landefordeling



Top 10 positioner

Selskab/Udsteder	Sektor	Land	Vægt
Microsoft Corp	IT	USA	5,39%
Alphabet Inc	Kommunikation	USA	4,13%
Apple Inc	IT	USA	3,67%
Abbvie Inc	Sundhedspleje	USA	2,46%
Bristol-Myers Squibb Co	Sundhedspleje	USA	2,36%
Ubs Group Ag	Finans	Schweiz	2,10%
Tyson Foods Inc	Konsumentvarer	USA	2,01%
Expeditors International Of Washington Inc	Industri	USA	1,86%
Cbre Group Inc	Ejendomme	USA	1,81%
Qualcomm Inc	IT	USA	1,81%