

Spiltan Räntefond Sverige

Månadsrapport juni 2019

Ansvarig förvaltare: Lars Lönnquist

SPILTAN
F O N D E R

Enkelt är effektivt

FONDENS INRIKTNING

Spiltan Räntefond Sverige är en korträntefond som huvudsakligen investerar i svenska företagscertifikat och företagsobligationer utgivna i svenska kronor. Fonden tar därmed ingen valutarisk. Räntedurationen får inte överstiga 1 år och kreditlöptiden får maximalt vara 2 år. En modern korträntefond!

MÅNADSKOMMENTAR

Under juni ökade fonden med 17 baspunkter vilket var sämre än jämförelseindex som ökade med 22 baspunkter. Kreditlöptiden är 1,3 år och den löpande avkastningen är dryga 1,1 procent efter avgift. Räntedurationen i portföljen är cirka 5 månader.

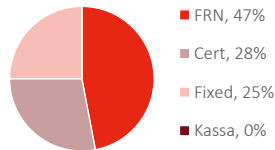
STÖRSTA EMITTENT

Klövern	3,4%
Castellum	3,1%
SFF	3,1%
Intrum Justitia	2,9%
Scania	2,4%
Balder	2,3%
SBB	2,3%
Nordea	2,2%
Vasakronan	2,2%
Wallenstam	2,2%

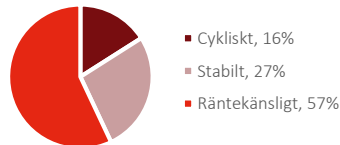
FÖRFALLOSTRUKTUR

2019	35,3%
2020	30,8%
2021	17,1%
2022	13,1%
2023	3,6%

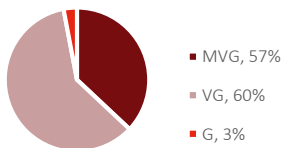
ANDEL FAST/RÖRLIG RÄNTA



KONJUNKTURKÄNSLIGHET



KREDITKVALITET



FONDFAKTA

Startdatum:	2014-04-02
Jämförelseindex:	50% SSVX + 50% NOMX Credit SEK
Riskklass:	1 av 7
Minsta investering:	100 SEK
ISIN:	SE0005798329
Avgift:	0,10 %
Fondhandel:	Daglig
Bloomberg ticker:	SPRANSV SS
Fondtyp:	UCITS

NYCKELTAL

Fondstorlek	29 565 Mkr SEK
Antal emittenter	Ca 100
Förväntad avkastning (1 år, efter avgift)	1,1%
STIBOR 3 mån	-0,03%
Ränteduration	0,4 år
Kreditduration	1,3 år
Sharpe (3 år)	11,92
Standardavvikelse (3 år)	0,26

AVKASTNING

	Fond	Index
Hittills i år	1,09%	0,80%
1 år	0,82%	0,24%
3 år	4,61%	0,62%
5 år	7,41%	3,67%
Sedan start	33,0%	N/A
Snitt per år (3 år)	1,51%	0,21%
Snitt per år (5 år)	1,44%	N/A

MÅNADSAVKASTNING

	Jan	Feb	Mar	Apr	Maj	Jun	Jul	Aug	Sep	Okt	Nov	Dec	Helår
2019	0,13%	0,19%	0,17%	0,29%	0,13%	0,17%							1,09%
2018	0,15%	0,07%	0,07%	0,12%	0,10%	0,04%	0,05%	0,10%	0,04%	0,02%	-0,13%	-0,17%	0,47%
2017	0,23%	0,21%	0,18%	0,13%	0,19%	0,12%	0,11%	0,13%	0,13%	0,11%	-0,13%	-0,17%	1,60%
2016	-0,10%	0,04%	0,19%	0,51%	0,21%	0,16%	0,26%	0,40%	0,26%	0,19%	0,15%	0,11%	2,40%
2015	0,36%	0,32%	0,29%	0,37%	0,09%	0,07%	0,03%	0,07%	-0,37%	0,21%	-0,07%	-0,20%	1,17%

Spiltan Fonder AB

Riddargatan 17, 114 57 Stockholm
Tel: 08-545 813 40
e-post: fonder@spiltanfonder.se
www.spiltanfonder.se

Riskinformation Historisk avkastning är ingen garanti för framtida avkastning. Pengar som placeras i fonder kan både öka och minska i värde och det är inte säkert att du får tillbaka hela det investerade kapitalet. Faktblad och informationsbroschyr finns att laddas ner på www.spiltanfonder.se eller beställs via tel: 08-545 813 40

Signatory of:



SWESIF
SVERIGES FORUM FÖR
HÅLLBARA INVESTERINGAR