

Spiltan Räntefond Sverige

Månadsrapport november 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 november ökade fonden med 13 baspunkter vilket var bättre än jämförelseindex som sjönk med 14 baspunkter. Kreditlöptiden är 1,1 år och den löpande avkastningen är dryga 0,9 procent efter avgift. Räntedurationen i portföljen är cirka 3 månader.

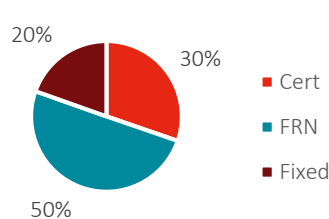
STÖRSTA EMITTENT

Klövern	3,1%
SBAB	3,0%
Intrum Justitia	2,8%
Balder	2,7%
SBB	2,6%
Klarna	2,6%
Nordea	2,3%
SFF	2,3%
Volvo Treasury	2,3%
Wallenstam	2,1%

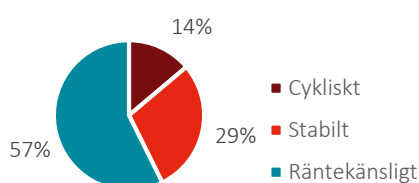
FÖRFALLOSTRUKTUR

2019	8,7%
2020	51,5%
2021	20,0%
2022	14,8%
2023	4,8%

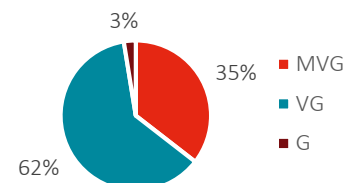
ANDEL FAST/RÖRLIG RÄNTA



KONJUNKTURKÄNSLIGHET



KREDITKVALITET



FONDFAKTA

Startdatum:	2007-09-17
Jämförelseindex:	50% SSVX + 50% NOMX Credit SEK
Riskklass:	1 av 7
Minsta investering:	100 SEK
ISIN:	SE0002152140
Avgift:	0,10 %
Fondhandel:	Daglig
Bloomberg ticker:	SPRANSV SS
Fondtyp:	UCITS

NYCKELTAL

Fondstorlek	30 816 Mkr SEK
Antal emittenter	Ca 110
Förväntad avkastning (1 år, efter avgift)	0,90%
STIBOR 3mån	0,06%
Ränteduration	0,3år
Kreditduration	1,1år
Sharpe (3 år)	10,1
Standardavvikelse (3 år)	0,3

AVKASTNING

	Fond	Index
Hittills i år	1,77%	0,50%
1 år	1,59%	0,30%
3 år	3,99%	0,25%
5 år	7,60%	1,80%
Sedan start	33,90%	N/A
Snitt per år (3 år)	1,31%	0,08%
Snitt per år (5 år)	1,47%	0,36%

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%	0,19%	0,13%	0,14%	0,09%	0,13%		1,77%
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 inte någon garanti för framtida avkastning. De pengar du investerar i fonder kan både öka och minska i värde och det är inte säkert att du får tillbaka hela det investerade beloppet. Faktblad och informationsbroschyr kan beställas från Spiltan Fonder, tel: 08-545 813 45, eller laddas ner på spiltanfonder.se. Fonden får placera mer än 35 procent av fondmedlen i obligationer och andra skuldförbindelser som givits ut eller garanterats av en stat, kommun eller myndighet inom EES, av mellanstatligt organ där någon av EES-länderna är medlem.

Signatory of:

