

Spiltan Räntefond Sverige

Månadsrapport december 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 december ökade fonden med 11 baspunkter vilket var bättre än jämförelseindex som sjönk med 6 baspunkter. Kreditlöptiden är 1,1 år och den löpande avkastningen är dryga 1,0 procent efter avgift. Räntedurationen i portföljen är cirka 3 månader.

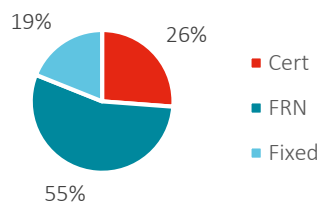
STÖRSTA EMITTENT

SBB	3,4%
Klövern	3,2%
SBAB	3,1%
Intrum Justitia	3,0%
Klarna	2,8%
Balder	2,8%
Nordea	2,4%
SFF	2,4%
Volvo Treasury	2,4%
Castellum	2,3%

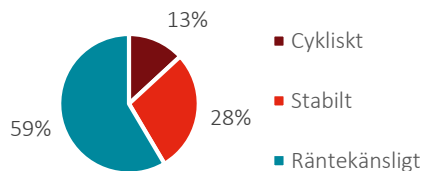
FÖRFALLOSTRUKTUR

2020	56,1%
2021	21,9%
2022	16,6%
2023	5,2%
2024	0,2%

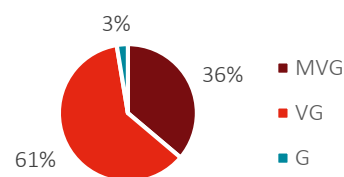
ANDEL FAST/RÖRLIG RÄNTA



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	29 932 Mkr SEK
Antal emittenter	Ca 110
Förväntad avkastning (1 år, efter avgift)	1,00%
STIBOR 3mån	0,18%
Ränteduration	0,3år
Kreditduration	1,1år
Sharpe (3 år)	9,9
Standardavvikelse (3 år)	0,3

AVKASTNING

	Fond	Index
Hittills i år	1,88%	0,44%
1 år	1,88%	0,44%
3 år	4,00%	0,29%
5 år	7,74%	1,63%
Sedan start	34,05%	N/A
Snitt per år (3 år)	1,32%	0,10%
Snitt per år (5 år)	1,50%	0,32%

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%	0,11%	1,88%
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. Faktablad 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:



SWESIF
SVERIGES FÖRUM FÖR
HÅLLBARA INVESTERINGAR