

Spiltan Högräntefond

Månadsrapport februari 2020

Ansvarig förvaltare: Lars Lönnquist

SPILTAN
FONDER

Enkelt är effektivt

FONDENS INRIKTNING

Spiltan Högräntefond är en aktivt förvaltd räntefond som investerar i företagsobligationer med tonvikt på Norden. Maximalt 10% av fonden kan utgöras av preferensaktier och konvertibler. Räntedurationen får vara mellan 0–10 år. Investeringar i utländska värdepapper valutasäkras till svenska kronor. En flexibel räntefond!

MÅNADSKOMMENTAR

Under februari minskade fonden med 18 baspunkter vilket var sämre än jämförelse-index som steg med 25 baspunkter. Kreditlöptiden är 2,3 år och den löpande avkastningen är dryga 1,9% efter avgift. Räntedurationen i portföljen är cirka 6 månader.

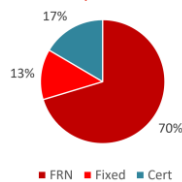
STÖRSTA EMITTENT

Klövern	3,0%
Telia	3,0%
Klarna	2,9%
Heimstaden	2,9%
Intrum Justitia	2,9%
SBB	2,9%
Vattenfall	2,6%
SBAB	2,2%
SSAB	2,2%
Fastpartner	1,9%

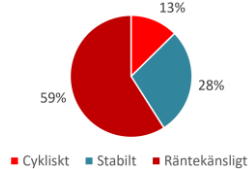
FÖRFALLOSTRUKTUR

2020	24,0%
2021	12,3%
2022	25,8%
2023	22,0%
2024	13,1%
2025	2,7%

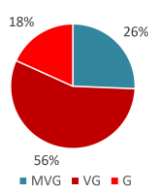
ANDEL FAST/RÖRLIG RÄNTA



KONJUNKTURKÄNSLIGHET



KREDITKVALITET



FONDFAKTA

Startdatum:	2014-04-02
Jämförelseindex:	2X (50% SSVX + 50% NOMX Credit SEK)
Riskklass:	2 av 7
Minsta investering:	100 SEK
ISIN:	SE0005798329
Avgift:	0,75 %
Fondhandel:	Daglig
Bloomberg ticker:	SPIHOGT SS
Fondtyp:	UCITS

NYCKELTAL

Fondstorlek	18 375 Mkr SEK
Antal emittenter	Ca 135
Förväntad avkastning (1 år, efter avgift)	1,9%
STIBOR 3mån	0,14%
Ränteduration	2,3år
Kreditduration	2,3år
Sharpe (3 år)	4,3
Standardavvikelse (3 år)	0,9

AVKASTNING

	Fond	Index
Hittills i år	0,36%	0,69%
1 år	4,05%	1,21%
3 år	10,79%	0,90%
5 år	22,40%	3,15%
Sedan start	17,93%	9,15%
Snitt per år (3 år)	3,48%	0,30%
Snitt per år (5 år)	4,12%	0,62%

MÅNADSAVKASTNING

	Jan	Feb	Mar	Apr	Maj	Jun	Jul	Aug	Sep	Okt	Nov	Dec	Helår
2020	0,53%	-0,18%											0,36%
2019	0,41%	0,58%	0,42%	0,71%	0,20%	0,39%	0,50%	0,24%	0,26%	0,29%	0,28%	0,32%	4,71%
2018	0,50%	0,17%	0,32%	0,53%	0,33%	-0,10%	0,29%	0,23%	0,28%	0,06%	-0,36%	-0,34%	1,92%
2017	0,77%	0,70%	0,63%	0,37%	0,65%	0,39%	0,32%	0,47%	0,37%	0,17%	0,00%	0,03%	4,99%
2016	-0,10%	-0,71%	0,66%	1,60%	0,82%	0,38%	0,85%	0,83%	0,98%	0,58%	0,50%	0,32%	6,89%
2015	0,74%	0,51%	0,88%	0,90%	0,45%	0,25%	0,18%	0,22%	-0,78%	0,30%	-0,20%	-0,37%	3,12%

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 samt i USA.

Signatory of:

