

Spiltan Räntefond Sverige

Månadsrapport februari 2020

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 februari ökade fonden med 2 baspunkter vilket var sämre än jämförelseindex som steg med 12 baspunkter. Kreditlöptiden är 1,1 år och den löpande avkastningen är dryga 0,9% efter avgift. Räntedurationen i portföljen är cirka 2 månader.

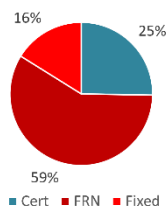
STÖRSTA EMITTENT

SBB	3,4%
Balder	3,3%
Klövern	3,2%
Intrum Justitia	3,1%
SBAB	3,1%
Klarna	2,8%
Castellum	2,8%
Kungsleden	2,5%
Nordea	2,4%
Heimstaden	2,4%

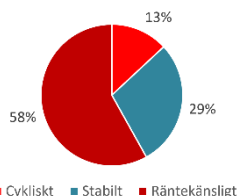
FÖRFALLOSTRUKTUR

2020	52,0%
2021	23,1%
2022	17,9%
2023	7,0%

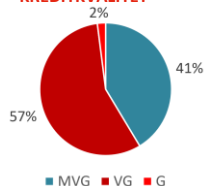
ANDEL FAST/RÖRLIG RÄNTA



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	29 955 Mkr SEK
Antal emittenter	Ca 110
Förväntad avkastning (1 år, efter avgift)	0,9%
STIBOR 3mån	0,14%
Ränteduration	0,2år
Kreditduration	1,1år
Sharpe (3 år)	5,7
Standardavvikelse (3 år)	0,3

AVKASTNING

	Fond	Index
Hittills i år	0,23%	0,34%
1 år	1,79%	0,60%
3 år	3,78%	0,45%
5 år	7,25%	1,57%
Sedan start	34,4%	N/A
Snitt per år (3 år)	1,24%	0,15%
Snitt per år (5 år)	1,41%	0,31%

MÅNADSAVKASTNING

	Jan	Feb	Mar	Apr	Maj	Jun	Jul	Aug	Sep	Okt	Nov	Dec	Helår
2020	0,20%	0,02%											0,23%
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%

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:

