

Spiltan Räntefond Sverige

Månadsrapport januari 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 januari ökade fonden med 20 baspunkter vilket var sämre än jämförelseindex som steg med 22 baspunkter. Kreditlöptiden är 1,1 år och den löpande avkastningen är dryga 1,0 procent efter avgift. Räntedurationen i portföljen är cirka 3 månader.

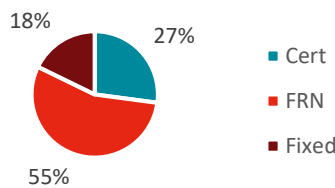
STÖRSTA EMITTENT

| | |
|-----------------|------|
| SBB | 3,4% |
| SBAB | 3,1% |
| Klövern | 3,1% |
| Balder | 2,9% |
| Klarna | 2,9% |
| Intrum Justitia | 2,8% |
| SFF | 2,7% |
| Castellum | 2,7% |
| Nordea | 2,4% |
| Volvo Treasury | 2,4% |

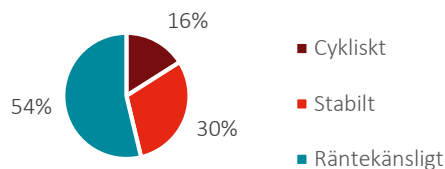
FÖRFALLOSTRUKTUR

| | |
|------|-------|
| 2020 | 56,1% |
| 2021 | 22,1% |
| 2022 | 16,7% |
| 2023 | 5,1% |

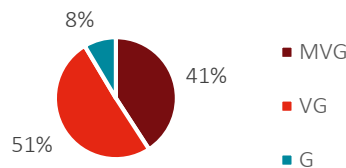
ANDEL FAST/RÖRLIG RÄNTA



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 | 29 806 Mkr SEK |
| Antal emittenter | Ca 110 |
| Förväntad avkastning (1 år, efter avgift) | 1,0% |
| STIBOR 3mån | 0,19% |
| Ränteduration | 0,2år |
| Kreditduration | 1,1år |
| Sharpe (3 år) | 9,9 |
| Standardavvikelse (3 år) | 0,3 |

AVKASTNING

| | Fond | Index |
|---------------------|--------|-------|
| Hittills i år | 0,20% | 0,22% |
| 1 år | 1,96% | 0,54% |
| 3 år | 3,97% | 0,65% |
| 5 år | 7,57% | 1,49% |
| Sedan start | 34,32% | N/A |
| Snitt per år (3 år) | 1,31% | 0,22% |
| Snitt per år (5 år) | 1,47% | 0,30% |

MÅNADSAVKASTNING

| | Jan | Feb | Mar | Apr | Maj | Jun | Jul | Aug | Sep | Okt | Nov | Dec | Helår |
|------|--------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|--------|--------|-------|
| 2020 | 0,20% | | | | | | | | | | | | 0,20% |
| 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. 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:

