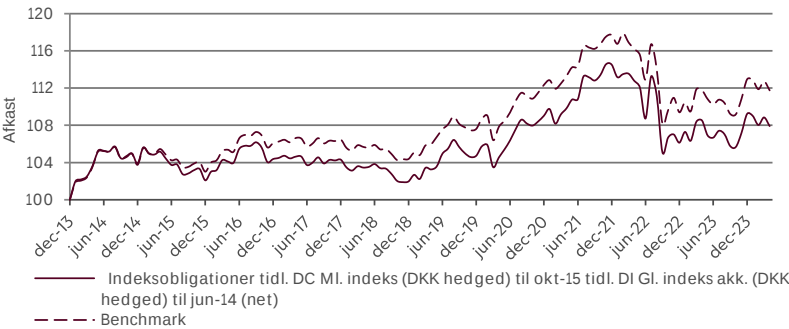


30. april 2024

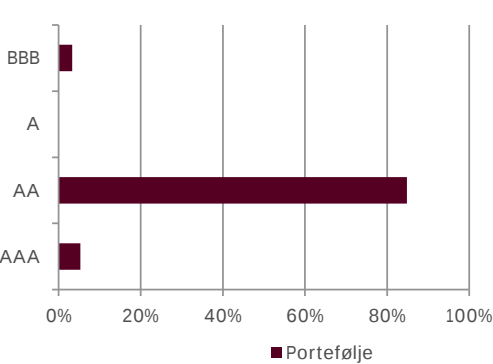
ABSOLUT AFKAST (EFTER OMK.)



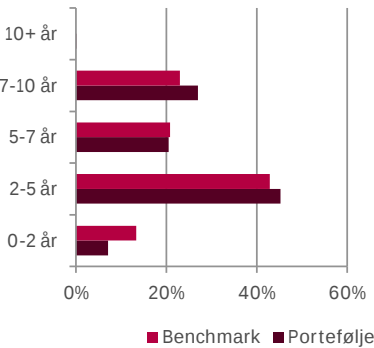
SECURE SPECTRUMS FORTOLKNING AF DANSKE BANK

Strategien fra Danske Bank er en af de få strategier i universet, der med udgangspunkt i dansk inflation formår at afdække maksimalt. Alfa skabes gennem få men grundigt analyserede aktive positioner, hvilket betyder, at man ikke går på kompromis med korrelationen til dansk inflation. Den meget stringente tilgang til benchmarket viser sig tydeligt i merafkastet, som har været stabilt over en lang periode.

KREDITKVALITET**



VARIGHED**



PRODUKTINFORMATION

Forvalter	Christian Østerbye Vejen
Hovedkvarter	Lyngby, Danmark
Aktivklasse	Globale indeksobligationer
Valutadenominering	DKK
Valutaafdækning	Ja
Merafkastmålsætning	0,5% p.a.
ISIN-kode	DK0060645075
Lancering	26. oktober 2018
Samlede omkostninger (TER)**	0,52%
Emission/indløsningsomkostninger	0,1% / 0,1%

PORTEFØLJEKARAKTERISTIKA**	PRODUKT	BM
Real yield	1,3	1,2
Real duration	4,8	4,5
Breakeven inflation	2,3	2,3
Antal udstedelser	123	106

STØRSTE BEHOLDNINGER**

TSY INFL IX N/B 0.125% 15.01.2032	3,7%
TSY INFL IX N/B 1.125% 15.01.2033	3,7%
TSY INFL IX N/B 0.625% 15.07.2032	3,4%
TSY INFL IX N/B 0.125% 15.04.2025	3,0%
TSY INFL IX N/B 0.5% 15.01.2028	2,7%
TSY INFL IX N/B 0.125% 15.04.2027	2,7%
TSY INFL IX N/B 0.125% 15.07.2026	2,6%
TSY INFL IX N/B 0.125% 15.10.2025	2,6%
TSY INFL IX N/B 0.125% 15.04.2026	2,6%
Total	26,9%

RISIKOEN ANSES SOM MIDDEL PÅ EN SKALA FRA 1-7.

1	2	3	4	5	6	7
---	---	---	---	---	---	---

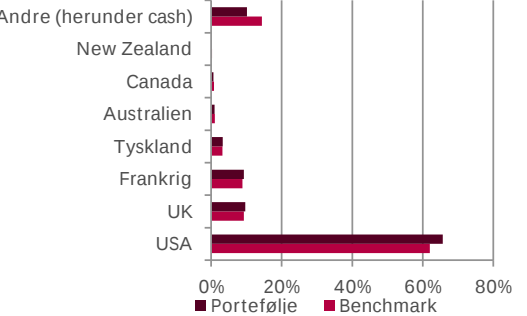
MÅNEDLIG AFKAST (EFTER OMK.)*

		Jan	Feb	Mar	Apr	Maj	Jun	Jul	Aug	Sep	Okt	Nov	Dec	År
2024	Forvalter	-0,2%	-0,9%	0,8%	-0,9%									-1,2%
	Benchmark	-0,1%	-0,9%	0,8%	-0,9%									-1,1%
	Merafkast	-0,1%	0,0%	0,0%	0,0%									-0,1%
2023	Forvalter	1,1%	-0,9%	1,9%	0,1%	-1,5%	-0,2%	0,7%	-0,3%	-1,2%	-0,1%	1,4%	1,9%	2,9%
	Benchmark	1,0%	-0,9%	2,2%	-0,1%	-0,8%	-0,5%	0,5%	-0,3%	-1,1%	0,0%	1,5%	1,9%	3,2%
	Merafkast	0,1%	0,0%	-0,2%	0,2%	-0,6%	0,3%	0,2%	0,0%	-0,1%	-0,1%	-0,1%	0,0%	-0,3%
2022	Forvalter	-1,2%	0,3%	0,0%	-0,7%	-0,6%	-3,0%	4,2%	-1,9%	-5,4%	1,5%	0,3%	-0,8%	-7,3%
	Benchmark	-0,8%	1,0%	-0,8%	-0,6%	-0,5%	-2,3%	3,4%	-2,4%	-5,0%	1,3%	1,2%	-1,4%	-7,1%
	Merafkast	-0,4%	-0,7%	0,9%	-0,1%	-0,1%	-0,7%	0,8%	0,5%	-0,4%	0,2%	-0,9%	0,6%	-0,3%

AFKAST OG NØGLETAL FOR SENESTE MÅNED, ÅTD OG RULLENDE ÅR (EFTER OMK.)*

		MTD	ÅTD	1 år	3 år	5 år
Afkast	Danske Bank	-0,9%	-1,2%	-0,6%	-0,6%	0,9%
	Benchmark	-0,9%	-1,1%	0,0%	-0,5%	1,1%
	Merafkast	0,0%	-0,1%	-0,5%	-0,1%	-0,2%
Risiko	Danske Bank			3,5%	5,5%	4,6%
	Benchmark			3,2%	5,1%	4,3%
Sharpe Ratio				-0,00	-0,00	-0,00
Beta				1,05	1,04	1,04
Tracking Error				0,8%	1,3%	1,1%
Information Ratio				-0,00	-0,00	-0,00

LANDE**



DISCLAIMER

Secure Spectrum har udarbejdet dette materiale til orientering, og ingen oplysninger på denne side skal betragtes som investeringsrådgivning. Før du investerer, bør du læse det seneste prospekt samt dokument med central investorinformation, som er tilgængeligt på hjemmesiden. Tidligere afkast er ingen garanti for fremtidige afkast.

*Afkast vist for Danske AM Mellemlange Indeks til og med okt-15 og Indeksobligationer fra nov-15

*** TER er beregnet med udgangspunkt i eksisterende AUM og kan derfor ændre sig

**Data til og med dec-23

Nærmere forklaring af risiko kan læses i KIID.