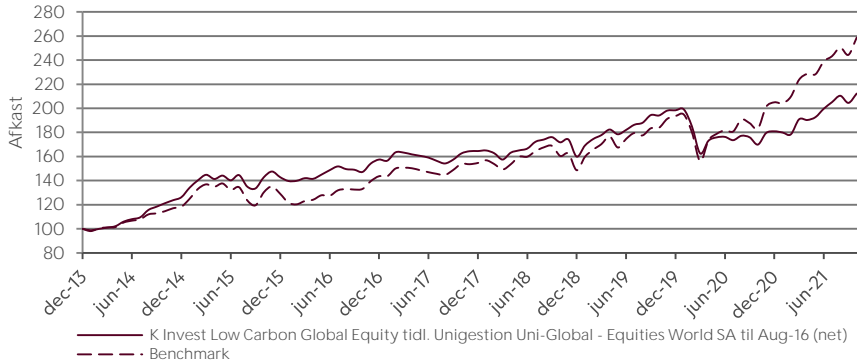


K INVEST LOW CARBON GLOBAL EQUITY (RUSSELL)

31. oktober 2021

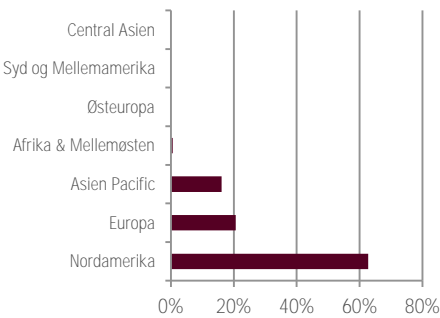
ABSOLUT AFKAST FOR RUSSELL (EFTER OMKOSTNINGER)



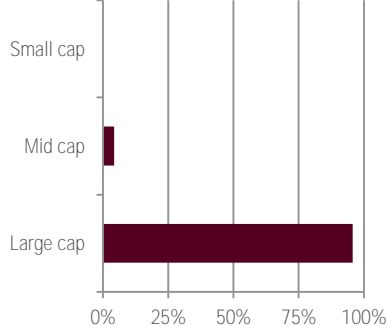
SPEKTRUMS FORTOLKNING AF RUSSELL

Russell opbygger en porteføljer, der lægger sig op ad et MSCI Min Vol indeks med en ESG-profil, hvilket reducerer karbonudledningen for porteføljen.

REGIONER



MARKET CAP



MÅNEDLIG AFKAST (EFTER OMKOSTNINGER)*

		Jan	Feb	Mar	Apr	Maj	Jun	Jul	Aug	Sep	Okt	Nov	Dec	År
2021	Forvalter	-0,6%	-0,9%	7,0%	-0,3%	1,3%	3,6%	2,7%	2,6%	-2,8%	3,8%			17,3%
	Benchmark	-0,4%	2,6%	6,7%	2,2%	-0,1%	4,6%	1,8%	2,9%	-2,4%	5,9%			26,2%
	Merafkast	-0,2%	-3,5%	0,3%	-2,5%	1,4%	-1,0%	0,9%	-0,3%	-0,4%	-2,1%			-8,9%
2020	Forvalter	0,4%	-7,1%	-12,1%	6,5%	1,6%	0,2%	-1,5%	2,1%	-0,7%	-3,4%	5,6%	0,8%	-8,8%
	Benchmark	0,7%	-7,6%	-13,3%	11,1%	3,1%	1,7%	-0,5%	5,4%	-1,5%	-2,4%	9,8%	1,9%	5,9%
	Merafkast	-0,3%	0,5%	1,2%	-4,6%	-1,5%	-1,4%	-1,0%	-3,3%	0,8%	-1,0%	-4,2%	-1,1%	-14,7%
2019	Forvalter	5,7%	3,2%	1,9%	2,6%	-2,2%	2,0%	2,4%	0,9%	3,4%	-0,2%	2,1%	0,1%	24,0%
	Benchmark	7,4%	3,7%	2,8%	3,7%	-5,2%	4,2%	2,8%	-1,1%	3,3%	0,3%	4,0%	1,2%	30,2%
	Merafkast	-1,7%	-0,5%	-0,9%	-1,2%	3,1%	-2,2%	-0,5%	2,0%	0,1%	-0,4%	-1,9%	-1,1%	-6,2%

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

		MTD	ÅTD	1 år	3 år	5 år
Afkast	Russell	3,8%	17,3%	24,9%	7,3%	7,6%
	Benchmark	5,9%	26,2%	41,2%	17,3%	14,2%
	Merafkast	-2,1%	-8,9%	-16,3%	-10,0%	-6,6%
Risiko	Russell			9,5%	13,3%	11,3%
	Benchmark			11,2%	16,4%	13,8%
Sharpe Ratio				2,66	0,57	0,70
Beta				0,73	0,77	0,77
Jensens alfa				-5,3%	-6,0%	-3,3%
Tracking Error				5,4%	5,4%	4,8%

DISCLAIMER

Spektrum Fondsmæglerelskab A/S 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.

Kilde: IFR (Afkastdata), Bloomberg (Porteføljedata), Spektrum (Forvalterinfo). Nærmere forklaring af risiko kan læses i KIID.

*Afkast vist for Unigestion Uni-global Equities World SA til og med aug-16 og K Invest Low Carbon Global Equity fra sep-16

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



PRODUKTINFORMATION

Forvalter	Russell
Hovedkvarter	USA
Aktivklasse	Globale aktier
Valuta denominering	DKK
Valutaafdækning	Nej
Merafkastmålsætning	0-1% p.a. (25% lavere risiko)
Portefølje-stil	Lav risiko
Forventet omsætning	70%
ISIN-kode	DK0060740496
Lancering	23. august 2016
Samlede omkostninger (TER)**	0,67%
Emission/indløsningsomkostninger	0,05% / 0,05%

PORTEFØLJEKARAKTERISTIKA

Price/Earnings	25,2
Price/Cash Flow	14,1
Price/Book	3,4
Dividend Yield	2,1%
WAMC i DKK (Mia.)	957
Median MC i DKK (Mia.)	287

10 STØRSTE BEHOLDNINGER

Microsoft Corp	1,7%
Accenture PLC	1,6%
Novo Nordisk A/S	1,6%
Givaudan SA	1,6%
Roche Holding AG	1,5%
PepsiCo Inc	1,5%
Gilead Sciences Inc	1,4%
Eli Lilly & Co	1,4%
Verizon Communications Inc	1,4%
NextEra Energy Inc	1,4%
Total	15,0%

RISIKOEN ANSES SOM MIDDEL PÅ EN SKALA FRA 1-7

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

SEKTOR

