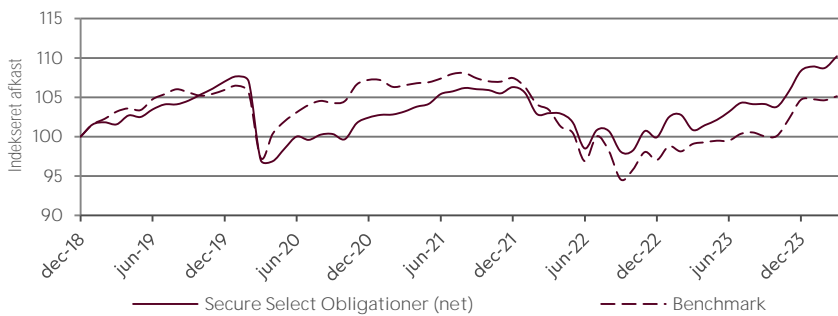


# Secure Select Obligationer

31. marts 2024



## ABSOLUT AFKAST (EFTER OMK.)



## SECURE SPECTRUMS FORTOLKNING AF SSO

Secure Select Obligationer er en strategisk sammensat obligationsportefølje med høj likviditet, lave omkostninger og gode afkast/risiko-forhold. Secure Spectrum er forvalter af strategien. Porteføljen bliver sammensat af udvalgte fonde forvaltet af eksterne forvaltere valgt af Secure Spectrum. Hjørnестenen af strategien er den strategiske sammensætning. I de tilfælde, at markedet er særligt ude af ligevægt vil Secure Spectrum foretage få men betydelige afvigelse fra den langsigtede strategi med henblik på at sænke risikoen og forbedre afkastet.

## MÅNEDSKOMMENTAR

### Afkast

Secure Select Obligationer har leveret 1,4% i marts 2024, hvilket giver et samlet afkast på 1,7% set over hele året.

Det højeste afkast for måneden kom fra Øvrige, der gav et afkast på 3,3%. Modsat kom det laveste afkast fra Wellington EMD Obl, som leverede et afkast på 0,7% i måneden.

### Ændringer i porteføljen

Der har ikke været væsentlige ændringer i porteføljen i den seneste måned.

## MÅNEDLIG AFKAST (EFTER OMK.)\*

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

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

		MTD	ÅTD	1 år	3 år	5 år
Afkast	SSO	1,4%	1,7%	9,3%	2,2%	1,6%
	Benchmark	0,5%	0,4%	6,1%	-0,4%	0,4%
	Merafkast	0,9%	1,3%	3,2%	2,7%	1,3%
Risiko	SSO			2,9%	4,6%	5,8%
	Benchmark			2,9%	5,1%	5,7%
Sharpe Ratio				1,6	-0,0	-0,0
Beta				0,8	0,8	0,9
Jensens Alfa				3,5%	1,3%	1,1%
Tracking Error				1,5%	2,8%	3,0%

## DISCLAIMER

Secure Spectrum har udarbejdet dette materiale til orientering, og ingen oplysninger på denne side skal betragtes som investeringsrådgivning. For 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 Secure Globale Obligationer til mar-23

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

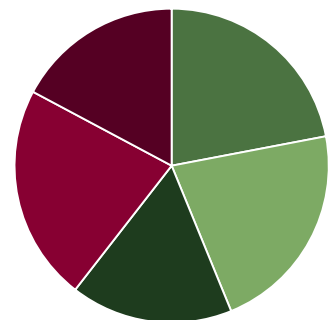
## PRODUKTINFORMATION

Forvalter	Udvalgte forvaltere
Aktivklasse	Obligationer
Valutadenominering	DKK
Valutaafdækning	Ja (til DKK/EUR)
Merafkastmålsætning	0,25%
ISIN-kode	DK0060571446
Lancering	sep-14
Samlede omkostninger (TER)***	0,79%
Emission/indløsningsomkostninger	0,25%/0,25%

## PORTEFØLJEKARAKTERISTIKA\*\*

Duration (år)	3,73
Vægtet kreditrating	n/a
Antal udstedelser	+500
Yield to maturity	6,29%

## AKTUEL ALLOKERING\*\*

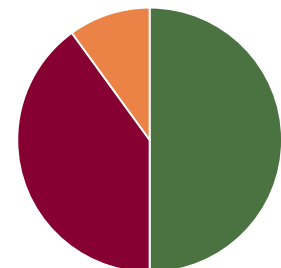


- HP Korte Obl
- HP Lange Obl
- Indeksobligationer
- Janus H High Yield Obl
- Wellington EMD Obl

## RISIKOEN ANSES SOM LAV PÅ EN SKALA FRA 1-7

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

## STRATEGISK ALLOKERING\*\*



- Stats- og realkreditobligationer
- Virksomhedsobligationer
- Emerging markets-obligationer

\*\*Data til og med mar-24

Nærmere forklaring af risiko kan læses i KIID.