

PLUS Indeks

FONDSDATA PR. 31.08.20

PLUS Indeks

Oppstart:	sep.93	Årlig forvaltningshonorar:	0,70 %
Minsteinnskudd (i NOK):	50.000	Tegnings- og innløsningsgebyr:	0,50 %

Referanseindeks: Oslo Børs OBX-indeks. Dette er en kapitalvektet indeks av de 25 mest likvide aksjene på Oslo Børs. Indeksen er fra og med 1.4.2006 utbyttejustert.

Verdiutvikling	Fond	Ref. indeks
Siste mnd.	3,51 %	3,57 %
Siden 31.12.19	-10,86 %	-10,49 %
Siste 12 mnd.	-4,99 %	-4,32 %
Siste 24 mnd.	-11,62 %	-10,16 %
Siste 36 mnd.	10,00 %	12,69 %
Siste 48 mnd.	32,90 %	37,25 %
Siden oppstart (sept.93)	875,82 %	751,91 %
Gj.snitt (geometrisk) siste 4 kalenderår avkastning (p.a.)	10,85 %	11,84 %
2014	2,62 %	3,99 %
2015	2,34 %	2,92 %
2016	13,43 %	14,61 %
2017	19,25 %	20,24 %
2018	-1,24 %	-0,46 %
2019	13,01 %	14,06 %

UTREGNINGSMETODER

Alle utregninger er ifølge NFF standard for porteføljeevaluering

MÅLINGER

Alle målinger er basert på de 48 siste månedlige observasjonene. Der hvor det ikke eksisterer 48 mnd. historikk, er det blitt brukt 36, 24 eller 12 mnd. historikk. Målingene er ikke blitt gjennomført hvis fondet har mindre en 12 mnd. historikk.

SHARPE-INDEKS

Ved beregning av Sharp-indeksen er OBI statsobligasjonsindeks med 3 måneders durasjon benyttet som estimat på den risikofrie renten. Beregningen er gjort ved å ta gjennomsnittlig mnd. avkastning på porteføljen minus gjennomsnittlig mnd. avkastning på risikofri rente, dividert på porteføljens standardavvik for gjeldende periode.

PORTEFØLJEEVALUERING

PLUS Indeks er et passivt forvaltet fond som investerer i alle aksjene som inngår i Oslo Børs OBX-Indeks. Fondets mål er å følge Oslo Børs OBX-Indeks avkastning så nært som mulig.

PLUS Indeks skal følge verdiutviklingen på Oslo Børs, representert ved OBX - Indeksen. Denne indeksen reflekterer utviklingen til de 25 mest omsatte verdipapirene på Oslo Børs. Sammensetningen revideres to ganger i året, basert på de 25 mest omsatte verdipapirene de siste 6 månedene. PLUS Indeks er således et indeksfond og verdisingningen i avkastningen er derfor relativt lik referanseindeksen. Fondet er et UCITS-fond og kan ikke investere i derivater.

Vi gjør dessuten oppmerksom på at forvaltningshonoraret er fratrukket ved opplysning om fondenes avkastning.

Historisk avkastning er ingen garanti for fremtidig avkastning. Fremtidig avkastning vil bl.a. avhenge av markedsutviklingen, forvalters dyktighet, fondets risiko, samt kostnader ved tegning, forvaltning og innløsning. Avkastningen kan bli negativ som følge av kurstap.

Standardavvik	Fond	Ref. indeks
Siste 12 mnd.	20,30 %	20,47 %
Siste 24 mnd.	16,64 %	16,75 %
Siste 36 mnd.	15,10 %	15,19 %
Siste 48 mnd.	13,68 %	13,76 %
Gj.snitt (geometrisk) siste 4 kalenderår standardavvik	10,55 %	10,60 %
2014	9,69 %	9,96 %
2015	12,99 %	13,06 %
2016	11,54 %	11,65 %
2017	8,96 %	9,04 %
2018	13,98 %	13,96 %
2019	7,82 %	7,86 %

Sharpe-indeks	Fond	Ref. indeks
Siste 12 mnd.	-0,06	-0,05
Siste 24 mnd.	-0,10	-0,09
Siste 36 mnd.	0,07	0,08
Siste 48 mnd.	0,15	0,17

Nøkkeltall	Siste 48 mnd.
Differanseavkastning (p.a.)	-0,87 %
Indeksavvik (p.a.)	0,12 %
Beta	0,97
Informasjonsindeks	-7,08