

PLUS Markedsverdi

FONDSDATA PR. 30.11.18		PLUS Markedsverdi	
Oppstart:	jan.95	Årlig forvaltningshonorar:	0,90 %
Minsteinnskudd (i NOK):	50.000	Tegnings- og innløsningsgebyr:	0,50 %
Referanseindeks:	Oslo Børs Fondindeks. Fondet endret referanseindeks i januar 1998.		

Verdiutvikling	Fond	Ref. indeks
Siste mnd.	-2,99 %	-2,71 %
Siden 31.12.17	9,55 %	5,55 %
Siste 12 mnd.	11,54 %	8,33 %
Siste 24 mnd.	30,88 %	28,20 %
Siste 36 mnd.	39,26 %	34,29 %
Siste 48 mnd.	56,68 %	50,18 %
Siden jan .98	496,27 %	333,42 %
Gj.snitt (geometrisk) siste 4 kalenderår avkastning (p.a.)	10,44 %	10,14 %
2012	20,84 %	20,65 %
2013	19,38 %	24,17 %
2014	7,69 %	5,70 %
2015	6,47 %	6,70 %
2016	12,98 %	11,50 %
2017	14,83 %	17,05 %

Standardavvik	Fond	Ref. indeks
Siste 12 mnd.	12,37 %	10,97 %
Siste 24 mnd.	10,14 %	9,44 %
Siste 36 mnd.	10,49 %	10,43 %
Siste 48 mnd.	10,20 %	10,55 %
Gj.snitt (geometrisk) siste 4 kalenderår standardavvik	9,00 %	10,03 %
2012	16,43 %	15,38 %
2013	9,94 %	10,48 %
2014	7,48 %	8,35 %
2015	9,72 %	11,79 %
2016	11,60 %	12,45 %
2017	7,27 %	7,62 %

Sharpe-indeks	Fond	Ref. indeks
Siste 12 mnd.	0,26	0,21
Siste 24 mnd.	0,38	0,38
Siste 36 mnd.	0,31	0,27
Siste 48 mnd.	0,32	0,28

Nøkkeltall	Siste 48 mnd.
Differanseavkastning (p.a.)	1,18 %
Indeksavvik (p.a.)	2,60 %
Beta	0,92
Informasjonsindeks	0,45

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

Fondets målsetting er å oppnå en noe høyere avkastning enn fondsindeksen, og med lavere verdisvingninger.

90 prosent av fondet består av aksjer som er notert på hovedlisten på Oslo Børs, inntil 10 prosent kan være aksjer notert på SMB-listen (eller tilsvarende), og maksimalt 5 prosent kan være unoterte aksjer eller aksjer som er i ferd med å noteres på Oslo Børs.

Porteføljen består av 30 - 60 selskaper, og porteføljen deles inn i åtte til ti bransjer. Bransjevekten kan ikke avvike mer enn 5 prosentpoeng, og aldri mer enn 50 prosent av bransjens indeksevkt.

Fondet har som målsetting å identifisere de beste aksjene innenfor hver bransje. Av de selskaper som er med i fondets grunnlag kan et enkelt selskaps porteføljevkt ikke avvike mer enn 3 prosentpoeng fra indeksevkten. Gjennom dette fremstår fondet som meget velstrukturert.

Fondet vil tilstrebe å overholde de ovennevnte plasseringsbegrensningene, men det presiseres at det kan forekomme avvik i forhold til det ovennevnte, for å til enhver tid kunne tilfredsstille plasseringsbegrensningene for UCITS-fond. 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.

HVA HAR VI OPPNÅDD:

PLUS Markedsverdi har en betydelig meravkastning i forhold til referanseindeksen siden oppstart (januar 1998). Fondet har også en meravkastning i forhold til referanseindeksen hittil i år og de siste 12, 24, 36 og 48 måneder. Fondets avkastning er blant de bedre på Oslo Børs.

Fondets standardavvik er lavere enn referanseindeksen og Sharpe-indeksen er høyere enn referanseindeksen de siste 48 mnd.

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.