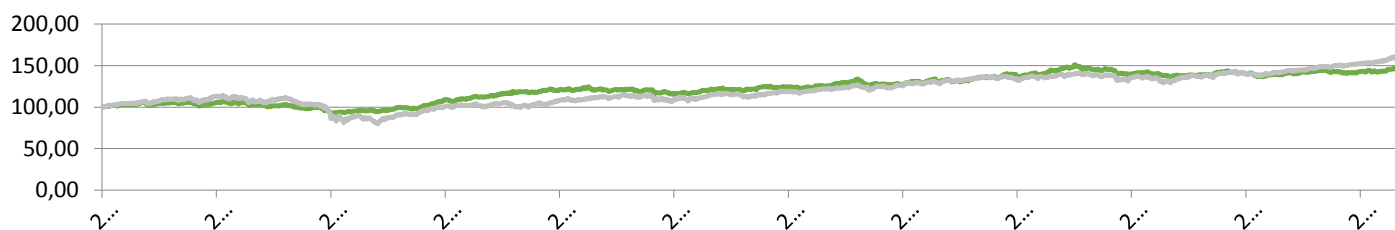


## BNP Paribas Flexible Fund Stars SEK Index (ENHAFST Index)



**Benchmark** - Likaviktat Barclays Obligationsindex (LBSTRUU Index) och MSCI World (MXWO Index)

## Om Indexet

Indexet är sammansatt av fyra och aktivt förvaltade absolutavkastande fonder. Egenskaper för indexet 1.) Likaviktat: varje enskild fond har en konstant vikt på 25% av index (daglig ombalansering). 2.) Excess Return: Utvecklingen av index beräknas som avkastningen för fondportföljen med avdrag för den riskfria räntan. 3.) Valuta: Indexutvecklingen beräknas i Euro. 4.) Riskkontroll: Index innehåller en funktion som syftar till att hålla risken (volatiliteten) vid målnivån om 5%. Fonder: 1.) Carmignac Patrimoine, allokering om minst 50% av tillgångarna i ränte- och penningmarknadsinstrument, övrig allokering i aktiemarknader. 2.) Standard Life Global Absolute Return Strategies Fund, en portfölj bestående av traditionella tillgångar (aktier och obligationer) och investeringsstrategier baserade på derivathandel. 3.) ETHNA-AKTIVE fördelning mellan aktier och obligationer. 4.) BNY Mellon Global Real Return Fund, Aktiv förvaltning av en så kallad "multi asset-strategi"

## Senaste Värde

# 130,32

2019-01-14

För. En dag

-0,03%

i år

0,50%

Avkastning 0,38% i extra under 2019

All Time High: 13 apr 2015 (151,1)

## Nyckeltal om indexet

Indexstart	2006-10-10	Dagsförändring	-0,03%
Högsta nivå sedan start	151,10	Avkastning denna månad	0,50% Januari
Volatilitet (senaste 30 dagar)	4,2%		
Sharpekvot sedan live*	0,91		
Årlig Eff. Exponering	0,38%		

Månadsavkastning	2015	2016	2017	2018	2019
Januari	17,9%	-1,7%	0,1%	1,6%	
Februari	1,5%	0,5%	1,7%	-3,2%	
Mars	1,0%	-0,8%	0,1%	-1,0%	
April	-0,8%	0,5%	0,4%	0,7%	
Maj	0,1%	0,7%	1,1%	-1,2%	
Juni	-1,7%	1,0%	-1,1%	-0,5%	
Juli	0,5%	1,2%	0,1%	0,5%	
Augusti	-3,0%	-0,2%	-0,7%	-0,6%	
September	-0,9%	-0,6%	0,2%	-0,4%	
Oktober	1,1%	-0,8%	1,3%	-4,4%	
November	0,8%	-2,4%	-0,8%	-0,4%	
December	-1,2%	1,6%	0,7%	-1,0%	
Avkastning per år	14,8%	-1,0%	3,1%	-9,5%	0,50%

Produkter med detta index	Start/ Indexnivå	Fonderna 2019-01-14	avk. YTD
Fondobligation 1, Kup. Obl. 2	2013-07-19	1,7% Carmignac Patrimoine	-0,11%
Fondobligation 2, Kup. Obl. 3	2013-10-21	0,6% Standard Life (SLI GARS Fund)	0,14%
Fondobligation 3, Kup. Obl. 4	2013-12-03	-0,1% ETHNA-AKTIV E	0,70%
Fondobligation 4, Kup. Obl. 5	2014-01-27	-0,5% BNY Mellon Global Real Return	-0,27%
Fondobligation 5, Kup. Obl. 6	2014-03-04	-1,9% <b>Viktad portfölj</b>	<b>0,11%</b>
Fondobligation 6	2014-04-16	-0,57%	
Fondobligation 7	2014-05-22	-2,76%	
Fondobligation 8	2014-07-09	-3,80%	
Fondobligation 9	2014-09-01	-6,27%	
Fondobligation 10	2014-10-14	-4,74%	

\*Årsavkastningarna, år 2006 startade 10 oktober

\*\*Exponeringsgraden beror på volatiliteten och kan skifta mellan 0-150%. Strategin har 5% i målvolatilitet. Vid 5% volatilitet är exponeringen 100% Vid lägre (högre) volatilitet ökar (minskar) exponeringsgraden.