

Balanceret fond med dynamisk aktivallokering

Fondens investeringsstrategi

PP Capital BASIS er en balanceret portefølje, hvor der via billige ETF'er indgår flere aktivklasser, heriblandt aktier, obligationer og alternativer. Strategien har som målsætning at beskytte og øge formuen over tid.

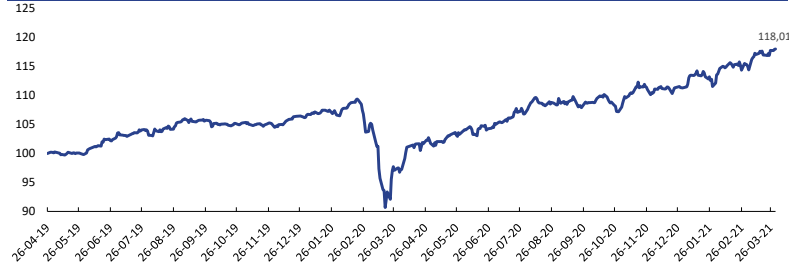
Porteføljesammensætningen i PP Capital BASIS tager udgangspunkt i en diversificeret portefølje bestående af aktier, obligationer og alternativer. Investeringerne foretages i billige og effektive indeksfonde, ETF'er. Valget af de optimale aktivklasser og ETF'er samt den løbende vægtning heraf foretages ud fra en analyse af den økonomiske situation og udvikling. I gode økonomiske tider, øges andelen af aktier, mens der i dårlige perioder investeres mere i obligationer. Målet er at levere et stabilt afkast over tid ved hjælp af den rette balance mellem de forskellige aktivklasser.

BASIS anvender ikke benchmark, da målsætningen er at skabe positive afkast, der er uafhængigt af markedsafkastet.

PP Capital Asset Management

PP Capital Asset Management blev stiftet i november 2013 med et ønske om at tilbyde fleksibel og personlig kapitalforvaltning til konkurrencedygtige og fuldt gennemsigtige priser. Visionen er at skabe en forretning drevet efter de gamle dyder, nemlig seriositet, flid, gensidig tillid og respekt for den enkelte kundes ønsker. I dag er denne vision fast forankret i PP Capital og gør, at vi forvalter mere end 5 mia. kr. for en bred vifte af kunder enten i form af et diskretionært eller rådgivningsmandat.

Fondens indre værdi



Risiko og løbende afkast

| | | |
|-------------------------------|-------|--------|
| Løbende afkast | BASIS | 6,02% |
| År-til-dato pr. d. 31/03-2021 | | 6,02% |
| 3 måneder | | 6,02% |
| 6 måneder | | 8,58% |
| 1 år | | 21,01% |
| Gnms. årligt afkast | | 9,45% |
| Siden start* | | 18,12% |
| *Siden 26. april 2019 | | |
| Risiko | | |
| Sharpe ratio | | 1,15 |
| Std. afv. Annualiseret | | 8,21% |
| 3 år risiko | | - |
| 5 år risiko | | - |

Månedsafkast

| | 2020 | 2021 |
|---------------|--------------|--------------|
| Januar | 0,43% | 0,20% |
| Februar | -2,77% | 2,54% |
| Marts | -5,94% | 3,19% |
| April | 4,88% | |
| Maj | 0,98% | |
| Juni | 1,25% | |
| Juli | 2,13% | |
| August | 1,44% | |
| September | 0,31% | |
| Oktober | -1,38% | |
| November | 2,76% | |
| December | 1,06% | |
| Totalt | 4,84% | 6,02% |

Fondens underliggende analyse

Illustrerede konjunkturfaser

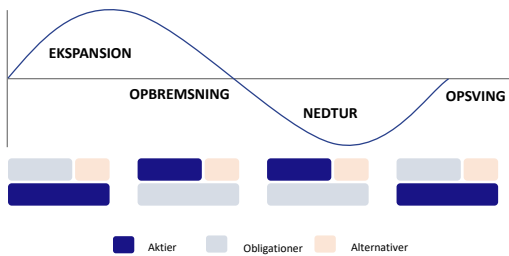
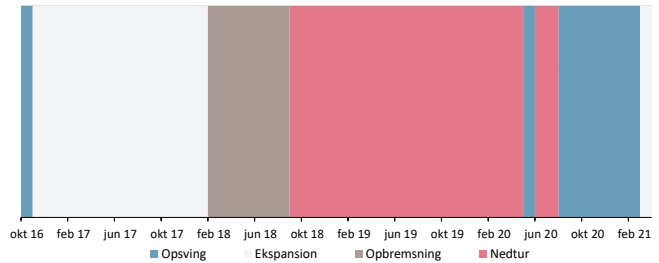


Illustration af de mulige konjunkturfaser.

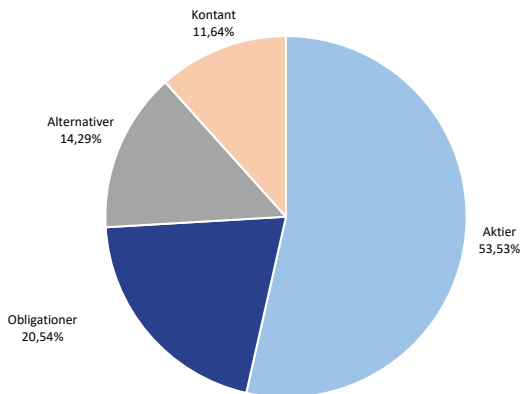
Faktiske konjunkturfaser



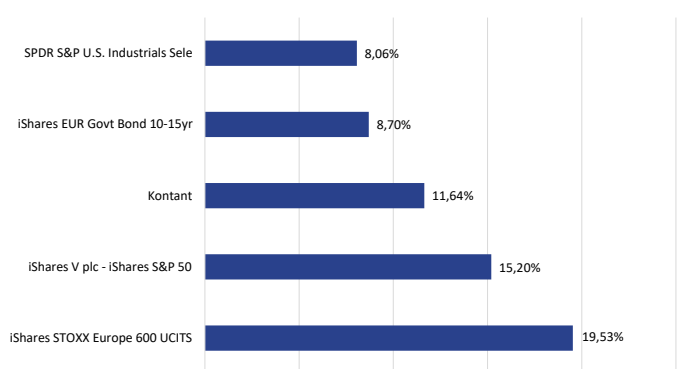
De faktiske konjunkturfaser udledt af økonomiske nøgletal.

Fondens overordnet allokering

Aktivallokering



Top 5 beholdning



Fondens underliggende karakteristika

| Fond karakteristika | |
|--|---------------|
| Antallet af positioner | 12 |
| Underliggende ETF-størrelse (EUR mio.) | 3.237,95 |
| Vægtet underliggende omkostninger | 0,21% |
| Geografisk allokering | |
| Nordamerika % | 28,23 |
| Syd & Mellemamerika % | 0,02 |
| Vesteuropa % | 56,15 |
| Asien og Stillehavsområdet % | 15,51 |
| Østeuropa % | 0,28 |
| Afrika & Mellemøsten % | 0,03 |
| Andet % | -0,22 |
| Totalt % | 100,00 |

Kontanter indgår under Vesteuropa.

| Sektorallokering | |
|--------------------------------|---------------|
| Materialer % | 2,92 |
| Kommunikation % | 4,38 |
| Forbrugsgoder (Cykliske) % | 5,50 |
| Konsumtvarer (Ikke-cykliske) % | 13,88 |
| Diversificeret % | 0,03 |
| Energi % | 3,01 |
| Finans % | 19,06 |
| Industri % | 19,83 |
| Teknologi % | 6,06 |
| Forsyning % | 4,38 |
| Statsobligationer % | 25,78 |
| Andet % | -4,84 |
| Totalt % | 100,00 |

Opdelingen er lavet efter BICS klassificeringssystem.

| Obligationskvalitet | |
|--|--------------|
| Investment Grade % | 16,81 |
| Speculative Grade/High Yield % | 0,03 |
| Andet % | 3,69 |
| Totalt % | 20,54 |
| Baseret på beholdningsanalyse. Andet inkluderer kontanter og ikke-ratede instrumenter. | |
| Obligationstype | |
| Lange (>10 år) % | 9,61 |
| Mellemlange (3-10 år) % | 8,86 |
| Korte (1-3 år) % | 1,83 |
| Andet % | 0,24 |
| Totalt % | 20,54 |
| Baseret på beholdningsanalyse. | |

Management og omkostninger

| | | | | | |
|-------------------------------|---------------------------|---------------|---------------|------------------------|-------|
| Investeringsforening | PP Capital BASIS KL n EUR | Domicil | Danmark | Emissionslilæg | 0,20% |
| Telefon | +45 88330430 | Valuta | EUR | Indlæsningsfradrag | 0,20% |
| Hjemmeside | www.pp-capital.dk | UCITS (I/N) | J | Løbende omkostninger | 1,03% |
| Startdato | 26. april 2019 | Udb eller Akk | Akkumulerende | ÅOP | 1,09% |
| Indre værdi (EUR) | 118,01 | Fondskode | DK0061137452 | Indirekte omkostninger | 0,09% |
| Markedsværdi i alt (mio. EUR) | 33,32 | | | Risikomærkning | Gul |

Disclaimer

Dette materiale er udarbejdet af PP Capital Asset Management til orientering for de investorer, som PP Capital Asset Management har udlånt materialet til. Publikationen er ikke et tilbud om eller en opfordring til at købe eller sælge aktier, værdipapirer, valuta eller andre finansielle instrumenter. Investorerne opfordres til at udvæge eget skøn over, hvorledes der skal investeres, og publikationens informationer, beregninger, vurderinger og skøn træder ikke i stedet for kundens egen vurdering. PP Capital Asset Management benytter og bearbejder data fra originale kilder såsom Jyske Bank A/S og Bloomberg LP og alt data er angivet som det er. PP Capital Asset Management påtager sig derfor ikke noget ansvar eller juridisk ansvar for nøjagtigheden, pålideligheden, fuldstændigheden, aktualitet eller anvendeligheden af det anvendte data.