

Investeringsmandat**Investeringsmål**

Formålet med forvaltningen av dette alternative investeringsfondet er å oppnå positive avkastning under alle markedsforhold (absoluttavkastning). Andelsklassen er akkumulierende.

Investeringsstrategi

Fondet søker eksponering til volatilitetsrisikopremier i aksjer, obligasjoner, kreditt, valuta, samt pengemarkedsinstrumenter fra hele verden med fokus på fremvoksende markeder. De volatilitetsbaserte strategiene implementeres gjennom å bruke finansielle instrumenter slik som opsjoner, futures og swaper. Fondet kan også i en kort periode investere direkte eller via UCITS eller UCI i underliggende verdipapirer. Fondet investerer resterende midler i UCITS (herunder UCITS ETF), UCI, gjeldsinstrumenter med høy kredittkvalitet utstedt av regjeringer og kredittinstitusjoner, pengemarkedsinstrumenter og / eller innskudd.

Fondet kan bruke derivater for hedging og til effektiv porteføljestyring, samt til rene investeringsformål. Forventet giringsnivå er vanligvis 800% til 1 000% og maksimal giring er 4 000%.

Dette fondet er kategorisert under SFDR artikkel 6. Fondet følger Danske Investes retningslinjer for ansvarlige investeringer.

Hovedparten av andelsklassens indre verdi vil være hedget mot fondets basisvaluta. Andelsklassen forblir likevel eksponert mot valutaene til investeringene i fondet.

Anbefaling: Dette fondet egner seg muligens ikke for investorer med kortere investeringshorisont enn 3 år.

Nyeste kommentar

The return in February for Global Cross Asset Volatility Class W-nok h p was -1.57%.

February was characterised by attention to economic data with its importance for central banks when setting monetary policy.

Strong growth and inflation data lead to increasing rates with relatively small moves in equities not suiting the portfolio well.

The S&P Global US Service PMI came out strong on February 21, S&P500 index ending 2% lower than previous trading day and US 2-year government rates 11bp higher.

During the month, S&P500 fell 2.6%, while the VIX fell a bit more than 1 unit to 20.7.

The German 10 year rate rose 37bp to 2.65%.

The average risk consumption during February was 45% of maximum Value-at-Risk.

Contribution from asset classes:

Equities: Negative
Rates: Negative
Currencies: Negative

Historical returns are no reliable indicator of future returns. It should be noted that monthly returns (in percent) are non-additive.

Forvaltere**Navn:**

Jacob Øland Jensen
Danske Bank Asset Management

Tittel:

Chief Portfolio Manager

Bakgrunn:

M.Sc. in Economics

Antall års erfaring:

16

Basisinformasjon

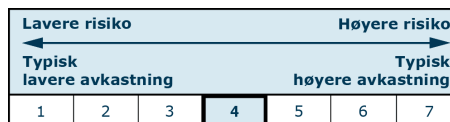
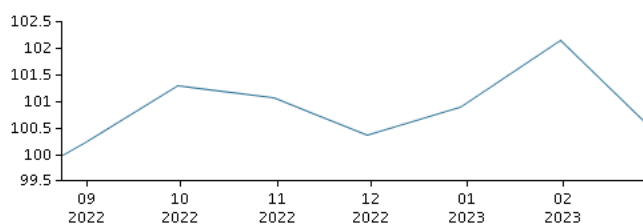
ISIN	LU1807293482
Valuta	NOK
Forvaltet kapital (mill.) NOK, 17.03.2023	2.908,0
Netto andelsverdi, 22.03.2023	1.010,32
Minstetegning	1,000 EUR
Forvaltningshonorar	0,75%
Fondsklasse	Danske Invest SICAV - SIF
Fondens registreringsland	Luxemburg
Administrasjonsselskap	Danske Invest Management A/S

Kostnader

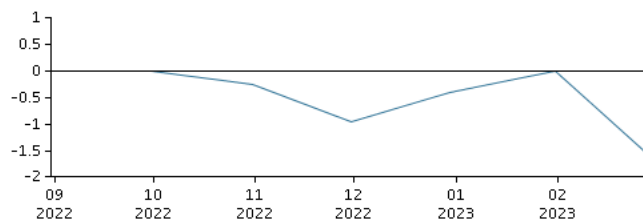
Løpende kostnader	0,96%
Maksimalt gebyr ved tegning	5,00%
Maksimalt gebyr ved innløsning	1,00%
Resultatavhengig godtgjørelse: 20% av meravkastningen som definert i prospektet i avsnittet 'Charges and Expenses'.	

Risikoindikator (SRI)

Risikoindikatoren viser sammenhengen mellom risikoen og dine avkastningsmuligheter av investeringen.

**Avkastning for perioden: 24.08.2022 - 28.02.2023**

Grafen viser utviklingen i avkastningen siste 5 år frem til utgangen av forrige måned. Dersom fondet ikke har 5 års historikk, viser grafen avkastning siden oppstart. Tidligere avkastning er ingen garanti for fremtidig avkastning. Fremtidig avkastning kan være negativ. Avkastningen kan stige og falle som følge av valutasvingninger dersom fondet utstedes i en annen valuta enn valutaen i landet der du er hjemmehørende.



Månedlig avkastning

	Jan	Feb	Mar	Apr	May	Jun	Jul	Aug	Sep	Oct	Nov	Dec	i år
2023	1,26	-1,57											-0,33
2022								0,22	1,09	-0,24	-0,70	0,54	0,90

