

PLUSS Indeks

FONDSDATA PR. 31.12.11		PLUSS Indeks	
Oppstart:	sep.93	Årlig forvaltningshonorar:	0,70 %
Minsteinskudd (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.	1,24 %	1,01 %
Siden 31.12.10	-10,93 %	-10,69 %
Siste 12 mnd.	-10,93 %	-10,69 %
Siste 24 mnd.	4,90 %	5,39 %
Siste 36 mnd.	76,49 %	79,58 %
Siste 48 mnd.	-15,49 %	-15,28 %
Siden oppstart	413,04 %	317,95 %
Gj.snitt (geometrisk) siste 4 kalenderår avkastning (p.a.)	-4,12 %	-4,06 %
2007	12,93 %	13,65 %
2008	-52,12 %	-52,82 %
2009	68,24 %	70,40 %
2010	17,77 %	18,00 %
2011	-10,93 %	-10,69 %

Standardavvik	Fond	Ref. indeks
Siste 12 mnd.	17,27 %	17,70 %
Siste 24 mnd.	20,21 %	20,77 %
Siste 36 mnd.	21,53 %	21,92 %
Siste 48 mnd.	30,43 %	30,87 %
Gj.snitt (geometrisk) siste 4 kalenderår standardavvik	26,18 %	26,58 %
2007	13,45 %	13,35 %
2008	44,89 %	45,35 %
2009	21,55 %	21,55 %
2010	22,75 %	23,46 %
2011	17,27 %	17,70 %

Sharpe-indeks	Fond	Ref. indeks
Siste 12 mnd.	-0,21	-0,20
Siste 24 mnd.	0,03	0,03
Siste 36 mnd.	0,26	0,26
Siste 48 mnd.	-0,02	-0,02

Nøkkeltall	Siste 48 mnd.
Differanseavkastning (p.a.)	-0,06 %
Indeksavvik (p.a.)	1,13 %
Beta	0,96
Informasjonsindeks	-0,05

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

Fondet tilbyr en konservativ plasseringsstrategi i aksjemarkedet. PLUSS Indeks investerer kun i de aksjene som inngår i Oslo Børs' OBX-indeks, som er en kapitalvektet indeks bestående av de 25 mest omsatte aksjene på børsen. Dette utvalget utgjør ca. 60 prosent av børsens totale kapitalisering. Gjennom dette oppnår investor en klar risikostyring.

Fondets risiko reflekterer den generelle risikoen i aksjemarkedet, og den selskapsesifikke risikoen blir dermed eliminert.

Porteføljen er sammensatt i henhold til Oslo Børs' OBX-indeks, med maksimalt 2 prosentpoeng over eller under den til enhver tid gjeldende vekt.

PLUSS Indeks sin klart definerte profil, gjør fondet spesielt egnet som byggekloss, og forenkler risikostyringen i en totalportefølje.

HVA HAR VI OPPNÅDD

PLUSS Indeks er det beste OBX-fondet i markedet de siste 5 årene. PLUSS Indeks har en meravkastning i forhold til referanseindeksen siden oppstart.

Lavt indeksavvik gjør at risikoen i fondet er begrenset og svært predikerbart i forhold til referanseindeksen.

HVORFOR HAR VI OPPNÅDD DETTE RESULTATET

- Fått god avkastning for de begrensede posisjoner som er tatt relativt til referanseindeksen.

- Liten omløpshastighet.

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.