

PLUS Markedsverdi

FONSDATA PR. 31.12.11		PLUS Markedsverdi	
Oppstart:	jan.95	Årlig forvaltningshonorar:	0,90 %
Minsteinskudd (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.	1,49 %	0,70 %
Siden 31.12.10	-17,17 %	-18,75 %
Siste 12 mnd.	-17,17 %	-18,75 %
Siste 24 mnd.	2,48 %	-0,66 %
Siste 36 mnd.	83,19 %	69,00 %
Siste 48 mnd.	-8,38 %	-28,04 %
Siden jan .98	153,65 %	86,23 %
Gj.snitt (geometrisk) siste 4 kalenderår avkastning (p.a.)	-2,17 %	-7,90 %
2007	8,36 %	10,21 %
2008	-49,99 %	-57,42 %
2009	78,76 %	70,12 %
2010	23,71 %	22,27 %
2011	-17,17 %	-18,75 %

Standardavvik	Fond	Ref. indeks
Siste 12 mnd.	17,72 %	19,00 %
Siste 24 mnd.	21,96 %	22,57 %
Siste 36 mnd.	22,79 %	23,55 %
Siste 48 mnd.	29,96 %	32,17 %
Gj.snitt (geometrisk) siste 4 kalenderår standardavvik	25,96 %	27,70 %
2007	12,71 %	13,51 %
2008	41,60 %	45,62 %
2009	20,99 %	22,79 %
2010	24,82 %	24,98 %
2011	17,72 %	19,00 %

Sharpe-indeks	Fond	Ref. indeks
Siste 12 mnd.	-0,32	-0,32
Siste 24 mnd.	0,02	0,00
Siste 36 mnd.	0,26	0,22
Siste 48 mnd.	0,00	-0,05

Nøkkeltall	Siste 48 mnd.
Differanseavkastning (p.a.)	5,73 %
Indeksavvik (p.a.)	3,81 %
Beta	0,91
Informasjonsindeks	1,50

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

PLUS Markedsverdi har en lavere risikoprofil enn PLUS Aksje. Fondets målsetting er å oppnå en noe høyere avkastning enn fondindeksen, 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, 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 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.

HVA HAR VI OPPNÅDD:

PLUS Markedsverdi har en betydelig meravkastning i forhold til referanseindeksen siden oppstart. Fondets avkastning er blant de aller beste på Oslo Børs.

Fondets standardavvik er lavere og Sharpe-indeksen er høyere enn referanseindeksen.

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.