



**CAPTOR**

# Captor Iris Räkna

Förvaltarekommentar - Oktober 2018

# Förvaltarkommentar

Oktober 2018

Måttliga ränterörelser under perioden, tioåringen ner ca 2.5 punkter sammanlagt och stängde på 1.25 % sista oktober. Femårig bospread upp ca 5 punkter över alla emittenter, med lite större rörelser för de mindre, Danske hypotek och Länsförsäkringar.

## Värdeutveckling



## RELATIV AVKASTNING



## NYCKELTAL - 2018-10-31

Värde	2 151 371 084	Beta	1,05
Årsavkastning, portfölj	1,40%	Korrelation mot benchmark	0,99
Årsavkastning, benchmark	1,01%	Tracking error	0,5%
Diff	0,39%	Informationskvot	0,84
Volatilitet, portfölj	3,7%	Sharpekvot	0,58
Volatilitet, benchmark	3,5%	Andel positiva månader	61%

## AVKASTNING (%)

	1M	3M	6M	1Y	3Y	5Y
Captor Iris Ranta	0,1%	-0,0%	0,9%	2,1%		
SEK Swap Basket TR	0,3%	0,2%	0,9%	1,4%		
DIFF	-0,2%	-0,2%	0,0%	0,7%		
	2018	2017				
Captor Iris Ranta	2,3%	-0,2%				
SEK Swap Basket TR	1,7%	-0,2%				
DIFF	0,6%	-0,0%				

## AVKASTNING PER MÅNAD (%)

	jan feb	mar apr	maj jun	jul aug	sep okt	nov dec
2018	-1,2% 1,3%	1,3% 0,1%	1,2% 0,5%	-0,8% 1,1%	-1,2% 0,1%	
2017			0,3% -1,9%	-0,2% 1,4%	-0,8% 1,2%	0,7% -1,0%

## Genomlysning

Kreditdurationen är för närvarande 4,25 och den genomsnittliga kreditspreaden mot statsobligationer är 70 bp.

Ränteduration är 10,91 år

Daniel Karlgren

Förvaltare

+ 46 76 117 33 50

[Daniel.karlgren@captor.se](mailto:Daniel.karlgren@captor.se)



### Ansvarsbegränsning

Detta material är producerat av Captor Investment Management AB. De som tagit fram innehållet är inte analytiker och materialet är inte oberoende investeringsanalys.

Innehållet är uteslutande avsett för kunder i Norden. Syftet är att ge en allmän information om Captor Investment Management AB och utgör inte ett personligt investeringsråd eller en personlig rekommendation. Informationen ska inte ensamt utgöra underlag för investeringsbeslut. Kunder bör inhämta råd från sina rådgivare och basera sina investeringsbeslut utifrån egen erfarenhet.

Ett finansiellt instruments historiska avkastning är inte en garanti för framtida avkastning. Värdet på finansiella instrument kan båda öka och minska och det är inte säkert att hela det investerade kapitalet återfås.



**CAPTOR**