



Kundrapport för
Ethos Räntefond

2022-08-31

SEB Large Corporates & Financial Institutions, K-G3, S-106 40 Stockholm
Växel: +46 8 676 90 00, Besöksadress: Kungsträdgårdsgatan 8, STOCKHOLM

Innehåll

Portföljvarkastning
Sammanfattning portfölj
Portföljkaraktäristika räntor

Portföljansvarig

Håkan Brodin
+46-8 676 91 93
hakan.brodin@seb.se

Ansvarig rapport

Middle Office
+46 70 739 25 28
clientreporting@seb.se

Portföljavkastning

Avkastning (%)	Augusti 2022 (2022-08-31)	Helåret 2022	Sedan start 2006-05-10	Sedan 2006-09-19	Aktiv risk	Sharpekvot	Standard avvikelse (36 Mån)	Informations kvot (36 Mån)
Totalportfölj	-1,95	-7,80	42,63	41,71	0,34	-1,05	2,70	0,06
Jämförelseindex *	-2,07	-7,65		41,95		-1,05	2,71	
Avkastning mot jämförelseindex	0,12	-0,14		-0,24				

* Jämförelseindex
100% OMRX Bond All

Sammanfattning portfölj

	Värde		Andel (%)	
	2022-08-31	2022-07-29	2022-08-31	2022-07-29
Räntor Sverige	1 986 292 570	1 898 683 140	97,2	97,3
Upplupen kupongränta	9 992 994	9 639 483	0,5	0,5
Likvida medel	72 305 167	42 176 173	3,5	2,2
Ej likviderade affärer/transaktioner	-25 000 000	0	-1,2	0,0
Total portfölj	2 043 590 731	1 950 498 796	100,0	100,0

NAV per 2022-08-31:

BNYM_EOMNAV 7,772941460 SEK

FUND NAV 7,764386000 SEK

Portföljkaraktäristika räntor

