

Information om aktivitetsgrad i fondförvaltning

Bolag	Lysa Fonder AB
Fastställd av	VD
Dokumenttyp	Intern
Datum	2024-03-11
Dokumentansvarig	VD
Version	2024:1

Bakgrund och syfte

Ett fondbolag ska enligt 4 kap 25-27 §§ lagen (2004:46) om värdepappersfonder tillgängliggöra information om varje värdepappersfond aktivitetsgrad i förhållande till relevant jämförelseindex samt om fonden funnits i mer än två år även volatiliteten i skillnaden mellan fondens och det relevanta jämförelseindexets avkastning. Om en fonds förvaltning inte kan jämföras med något relevant jämförelseindex ska information lämnas om varför en sådan jämförelse inte är möjlig.

Aktivitetsgrad

Respektive fonds aktivitetsgrad mäts med måttet aktiv risk, som fokuserar på avkastning. Aktiv risk visar hur mycket fondens avkastning skiljer sig från avkastningen hos dess jämförelseindex. Det beräknas genom att mäta volatiliteten i skillnaden mellan fondens avkastning och avkastningen hos dess jämförelseindex baserat på månadsdata från de två senaste åren.

Jämförelseindex

Lysa Räntor Kort

Målet för Lysa Räntor Kort är att ge exponering mot svenska och till viss del även utländska räntemarknader. Detta görs genom investeringar i underliggande fonder som är exponerade mot statsobligationer, bostadsobligationer och även företagsobligationer. Därtill har fonden viss valutaexponering efter bedömning att kostnaderna förknippade med att valutasäkra globala innehav skulle undergräva fondens avkastningspotential. Därmed anses fonden ha en unik investeringsprofil och sammansättningen gör att det inte finns något relevant jämförelseindex för fonden.

Lysa Aktier

Målet för Lysa Aktier är att erbjuda en billig evidensbaserad avkastning mot de globala aktiemarknaderna, alla regioner och små och stora bolag. Fondens målportfölj kan komma att justeras över tid vilket innebär att det inte finns något relevant jämförelseindex för fonden. Enligt fondens fondbestämmelser har Lysa Aktier möjlighet att investera upp till 50% av fondförmögenheten på den svenska marknaden. Därmed anses fonden ha en unik investeringsprofil och sammansättningen gör att det inte finns något relevant jämförelseindex för fonden.

Lysa Räntor

Målet för Lysa Räntor är att ge exponering mot svenska och utländska räntemarknader. Därtill har fonden viss valutaexponering efter bedömning att kostnaderna förknippade med att valutasäkra globala innehav skulle undergräva fondens avkastningspotential. Därmed anses fonden ha en unik investeringsprofil och sammansättningen gör att det inte finns något relevant jämförelseindex för fonden.

Lysa Sweden Equity Focus

Lysa Sweden Equity Focus är en indexfond vars mål är att följa utvecklingen av Solactive ISS ESG Filtered Sweden PAB SEK Index TR, vilket även utgör fondens jämförelseindex.

Lysa Global Equity Focus

Lysa Global Equity Focus är en indexfond vars mål är att följa utvecklingen av Solactive ISS ESG Filtered Developed Markets PAB SEK Index NTR, vilket även utgör fondens jämförelseindex.

Lysa SEK Fixed Income Focus

Fonden är en matarfond och har inget jämförelseindex. Mottagarfonden som fonden investerar i följer jämförelseindex OMRX T-Bill +1%. Mottagarfondens målsättning är erbjuda god riskjusterad avkastning och, före förvaltningsavgift, överträffa sitt jämförelseindex. Mer information om mottagarfondens jämförelseindex och aktivitetsgrad finns på mottagarfondens informationsbroschyr.

Lysa Global Fixed Income

Målet för Lysa Global Fixed Income är att ge exponering mot europeiska och globala räntemarknader. Därtill har fonden viss valutaexponering efter bedömning att kostnaderna förknippade med att valutasäkra globala innehav skulle undergräva fondens avkastningspotential. Därmed anses fonden ha en unik investeringsprofil och sammansättningen gör att det inte finns något relevant jämförelseindex för fonden.

Lysa Sweden Equity Broad

Målet för Lysa Sweden Equity Broad är att erbjuda en billig evidensbaserad avkastning mot den svenska aktiemarknaden, där alla regioner och små och stora bolag inkluderas. Fondens jämförelseindex är Solactive GBS Sweden All Cap UCITS C2 Index TR.