Optimix EuroRente Fonds

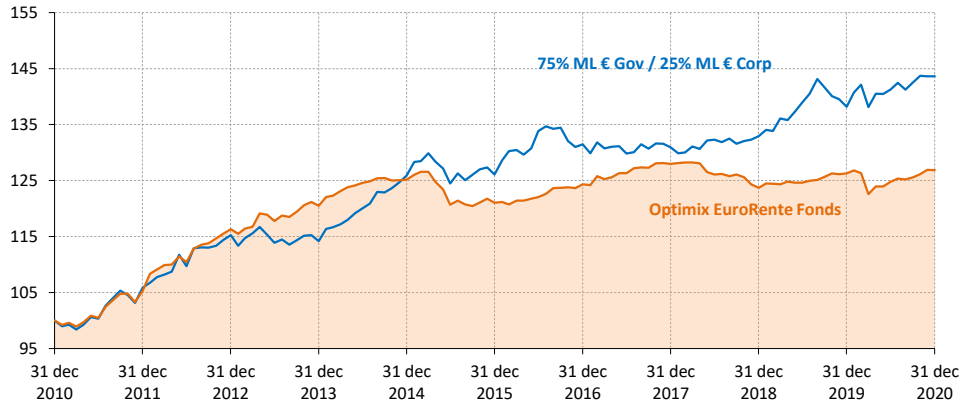
Obligatiefonds

Maandelijkse factsheet

31 december 2020

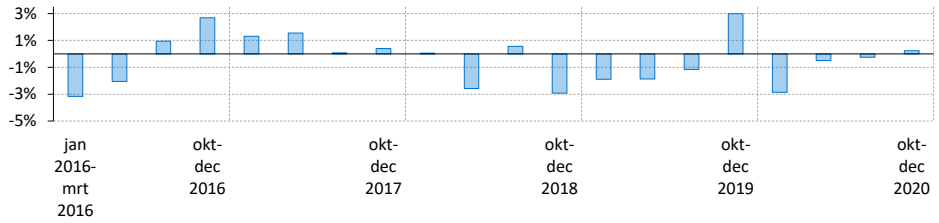
Performance (netto)*

Geïndexeerde performance op basis van intrinsieke waarde in euro (10 jaar)



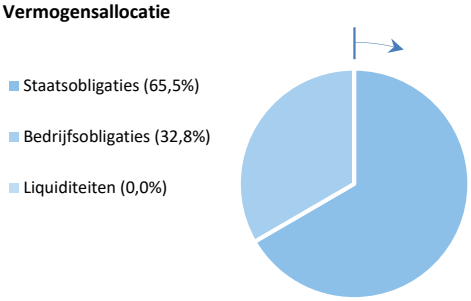
	1 mnd	3 mnd	1 jr	3 jr	5 jr	2020	2019	2018
Optimix EuroRente Fonds	0,0%	1,0%	0,5%	-0,3%	0,9%	0,5%	2,1%	-3,4%
75% ML € Gov / 25% ML € Corp	0,0%	0,8%	3,9%	3,1%	2,6%	3,9%	4,0%	1,5%

Relatieve performance (per elke opeenvolgende 3 maandsperiode)

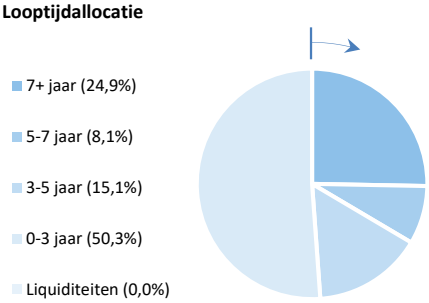


Portefeuille eigenschappen

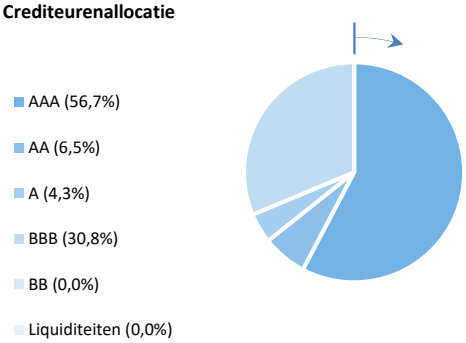
Vermogensallocatie



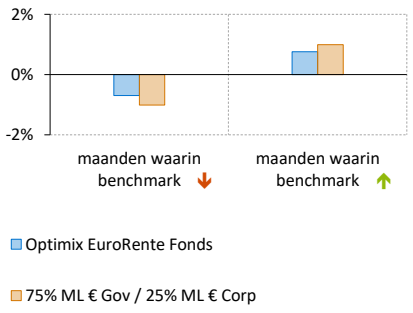
Looptijdallocatie



Crediteurenallocatie



Gemiddeld maandelijks rendement (5 jaar)[1]



Commentaar van uw fondsbeheerder

De oorzaak voor de mindere prestatie over het afgelopen jaar is de relatief korte looptijd van de obligaties in portefeuille. Zo daalde het aanvangsrendement van een 10-jarige Nederlandse staatsobligatie bijvoorbeeld van -0,1% aan het begin van het verslagjaar naar -0,5% per ultimo 2020. Het renteverschil van kwalitatief goede bedrijfsobligaties ten opzichte van staatsobligaties was ultimo 2020 nagenoeg onveranderd ten opzichte van de start van het jaar waardoor ook deze sector, die 25% van de samengestelde referentie-index vormt, ook een goede prestatie kon neerzetten. Door de relatief korte looptijd van de portefeuille is het fonds nog steeds significant minder gevoelig voor de ontwikkelingen in de rentestand dan haar referentie-index. Vooralsnog zetten politici en de ECB alle zeilen bij om het meest recente prijsindexcijfer om te buigen naar een stijging van 2,0% per jaar.

Algemene gegevens

Fondsbeheerders	Herbert Vroon, Diemer de Vries
Fondsvermogen	EUR 0
Datum oprichting	3 januari 2000
Benchmark	75% ML € Gov / 25% ML € Corp
Valuta	euro
In-/Uitstapkosten	0,10%
Lopende kosten	0,63%
Beheervergoeding	0,48%
Laatste dividend	EUR 0,28 op 19 juni 2020
ISIN Code	NL0010558805

Grootste posities

#N/A	#N/A
#N/A	#N/A
#N/A	#N/A
#N/A	#N/A
#N/A	#N/A
#N/A	#N/A
#N/A	#N/A
#N/A	#N/A
#N/A	#N/A
#N/A	#N/A
Gewicht top 10 posities	#N/A
Totaal aantal posities	2
Modified duration	2.2

Risico statistieken*

	3 jr	5 jr
Beta	0,26	0,20
Relatief rendement	-3,4%	-1,7%
Standaarddeviatie	2,3%	2,0%
Informatie ratio	-1,0	-0,5
Sharpe ratio	0,0	0,6

1	2	**3**	4	5	6	7

Lager risico — Hoger risico

Potentieel lagere opbrengst — Potentieel hogere opbrengst

* Rendementen langer dan 1 jaar zijn geannualiseerd.

[1] Over de geselecteerde maanden waarin de benchmark een daling/stijging laat zien (uit de 5 jaar periode) wordt het gemiddelde rendement berekend.

De waarde van uw belegging kan fluctueren. In het verleden behaalde resultaten bieden geen garantie voor de toekomst. Op www.optimix.nl kunt u meer informatie vinden over het product, de kosten en de risico's in het prospectus en de Essentiële Beleggersinformatie. Lees ze goed door voordat u het product koopt. Dit fonds is ook geschikt voor niet-professionele beleggers.

Optimix Vermogensbeheer NV | Johannes Vermeerstraat 14 | Postbus 15543 | 1001 NA Amsterdam | Tel. +31 (0) 20 570 30 30 | Fax +31 (0) 20 570 30 40 | info@optimix.nl | www.optimix.nl