

Företagsobligationskonsortiet

Företagsobligationskonsortiet investerar huvudsakligen i nordiska företagsobligationer med både fast ränta och rörlig ränta, så kallade FRN-obligationer. Obligationerna har en rating som är BBB- eller högre (investment grade). En mindre del kan vara investerad med rating BB+/BB. Obligationerna är emitterade av större industri- och fastighetsbolag, banker och investmentbolag.

Konsortiets jämförelseindex är Solactive SEK NCR Fix Short IG Corporate Index, vilket representerar marknaden för investment grade-obligationer i svenska kronor med fast ränta.

Durationen får inte överstiga fyra år i konsortiet och ligger vanligtvis mellan två och tre år. Konsortiet förvaltas aktivt med en strategi som syftar till att överträffa sitt jämförelseindex. Målet är att uppnå en riskjusterad avkastning mätt som informationskvot som överstiger 0,2 mätt över en rullande 5-årsperiod.

Företagsobligationskonsortiet startade år 2013 och följer Kammarkollegiets policy för ansvarsfulla investeringar.

Riskmätt (SEK)



Förmögenhet

	Total
Förmögenhet (tkr) 2025 12 31	4 744 053
Förmögenhet föregående månad (tkr)	4 675 096
Förmögenhet (tkr) 2024 12 31	4 021 570
Andelar Klass A (antal) 2025 12 31	2 555 341
Andelsvärde, klass A inkl. utdelning	1 026
Andelsvärde, klass A exkl. utdelning	1 021
Andelar klass B (Antal) 2025 12 31	2 059 912
Andelsvärde, klass B inkl. utdelning	1 030
Andelsvärde, klass B exkl. utdelning	1 025

Avkastning (jämförelseindex)

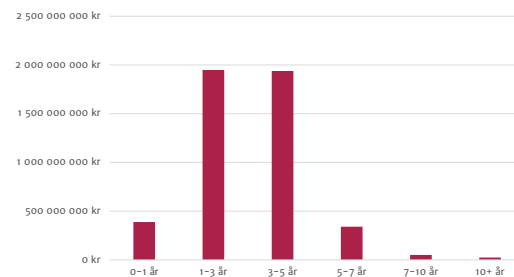
Sedan årets början (%) 4,57	(3,58)
1 år (%) 4,57	(3,58)
3 år (%) 20,38	(15,67)
5 år (%) 12,30	(8,56)

Nyckeltal (jämförelseindex)

Standardavvikelse (%)* 2,75	(2,57)
Sharpekvot* 0,95	(0,75)
Informationskvot*	0,92
Informationskvot 12-månaderstal	2,26
Tracking error (%)*	0,75
Tracking error 12-månaderstal (%)	0,44
Duration	2,92

*Nyckeltalen är beräknade utifrån månadsavkastningar som rullande 5-årstal.

Förfallostruktur

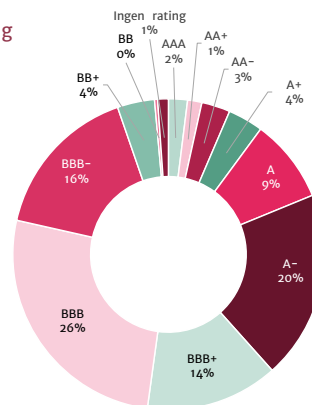


Största enskilda innehav	Andel (%)	Marknadsvärde (kr)
Deutsche Pfandbriefbank 0.728% 260112	2,0	94 598 571
Vonovia SE 3.308% 280613	1,8	85 578 855
L E Lundbergforetagen 2.948% 301022	1,8	85 219 798
Swedavia 4.815% PERP	1,6	75 630 278
Bonnier Fastigheter Finans Publ 3.92% 270412	1,6	74 753 520
Svensk Fastighetsfinansiering FRN 280911	1,5	70 676 618
Fastighets Stenvalvet FRN 290927	1,4	64 338 697
Sveriges Sakerställda Obligationer 0.75% 320609 #1	1,3	61 027 657
Sormlands Sparbank FRN 280908	1,2	57 947 478
Nibe Industrier 3.865% 300605	1,2	57 758 167

Avkastning



Kreditrating



Kapitalförvaltningens tjänster

Tillgångsförvaltning, allokering, ekonomitjänster, värdepappersadministration, finansiell rådgivning. Läs mer om detta och om övriga tjänster på www.kammarkollegiet.se/Kapitalforvaltning Eller skicka e-post till marknad_kap@kammarkollegiet.se