

INVESTERINGSFORENINGEN GREAT DANE INDEX+

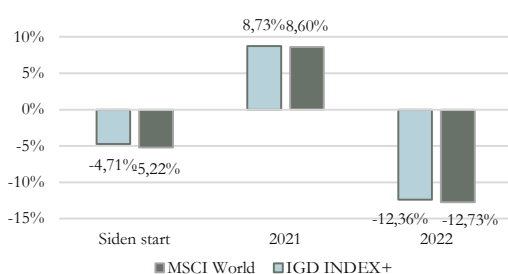
Introduktion

Great Dane INDEX+ er en global aktiefond, som giver danske investorer en unik mulighed for at få adgang til et professionelt forvaltet produkt til en omkostning, som er blandt de laveste i verden. Afdelingen er udbyttebetalende og børsnoteret i Danmark i danske kroner.

Produktet

Afdelingen følger det velkendte MSCI World indeks, som er det mest benyttede globale aktiebenchmark i verden. Men afdelingen benævnes med et ”+”, fordi hensigten er at levere et lidt højere afkast end indekset. Dette sker gennem faktoreksponeringer, og strategien er det man kalder Enhanced Indexing. I praksis bliver der foretaget en masse små over- og undervægte i alle de aktier, som indgår i MSCI World. De 5 faktorer, der arbejdes med, er Value, Momentum, Størrelse, Minimum Volatilitet og ESG. Porteføljen tilpasses løbende til faktorerne, samtidig med at kortsigtede mønstre i markedet udnyttes.

PERFORMANCE – GREAT DANE INDEX+



Målsætninger

Produktet forventes at levere små afkastudsving relativt til benchmark, men samtidig slå benchmark.

- Merafkast til MSCI World: 0,5%-1,0
- Tracking Error til MSCI World: 0,5%-1,0%

Erfaring og empiri

Teamet bag afdelingen hører til de mest erfarne i Danmark til forvaltning af både faktorstrategier og almindelige indeksstrategier. De to tilgange kobles her sammen i INDEX+.

INDEX+ er blevet til på baggrund af årtiers erfaringer, empirisk evidens og optimering af processer. Produktet er således baseret på gennemtestede strategier og er stærkt forankret omkring faste processer og metoder, som systematisk skal sørge for, at målsætningerne bliver opfyldt.

Omkostninger

Afdelingen har faste omkostninger på kun 0,05%. De samlede omkostninger vil stige lidt som følge af handel og merafkast. Den variable aflønning medfører, at såfremt målsætningen om merafkast opfyldes, beholder investorerne 65% af merafkastet, og foreningens rådgiver modtager 35%. Afdelingen overholder ESMA's retningslinjer for performance-aflønning, og investorerne er dermed sikret en fair struktur. Ind- og udtræden af afdelingen koster 0,22% hhv. 0,20%. Sparede omkostninger til køb og salg af aktier, som følge af emission og indløsning, tilfalder investorerne.

Investering

Afdelingen kan købes på helt almindelig vis gennem netbanker. Afdelingen er udbyttebetalende og børsnoteret i danske kroner. Afkastet bliver derfor beskattet, som var det en dansk aktie.

Om Great Dane

Investeringsforeningen Great Danes vision er at skabe og drive en investeringsforening, som den oprindeligt var tænkt. Et vigtigt fundament i den tankegang er, at omkostningerne skal være fair. Med INDEX+ har vi taget skridtet videre, og derfor er omkostningerne allerede fra start uhørt lave.

Stamdata

ISIN	DK0061671872	Tracking Error (forventet)	0,5%-1,0%
Benchmark	MSCI World inkl. nettoudbytter i DKK	Merafkast til MSCI World (forventet)	0,5%-1,0%
Type	Børsnoteret på Københavns Fondsbørs, udbyttebetalende	Fast fee	0,05% p.a.
Rådgiver/forvalter	Great Dane Fund Advisors A/S (Jacob Loiborg)	Performance fee (HWM)	35% af merafkast
Investeringsstrategi	Enhanced Indexing (multifaktor)	Emissionstillæg	0,22%
Antal aktier i porteføljen	500-1.100 (afhængig af formue)	Indløsningsfradrag	0,20%