

Mål og investeringspolitik**Mål**

Målet denne alternative investeringsfond er at opnå værdiforøgelse under alle markedsforhold (absolut afkast). Klassen er akkumulerende.

Investeringspolitik

Fonden tilsigter eksponering mod ændringer i volatilitet for aktier, obligationer, kreditter, valutaer samt pengemarkedsinstrumenter fra hele verden med fokus på udviklede markeder. De volatilitetsbaserede strategier implementeres ved anvendelse af afledte finansielle instrumenter såsom optioner, futures og swaps. Fonden kan også i kortere perioder investere direkte eller via UCITS eller UCI'er i sådanne underliggende værdipapirer. Fonden investerer resterende midler i UCITS (herunder UCITS ETF'er), UCI'er, gældsinstrumenter med høj kreditkvalitet såsom obligationer udstedt af regeringer og kreditinstitutter, pengemarkedsinstrumenter og/eller kortfristede indskud. Fonden kan anvende afledte finansielle instrumenter til afdækning og effektiv porteføljevaltning samt som investeringsformål. Normalt er det forventede gearingsniveau 800% - 1.000% med en forventet maksimal gearing på 4.000%. Afdelingen er kategoriseret under artikel 8 i EU's SFDR forordning om bæredygtighedsrelaterede oplysninger og fremmer miljømæssige og/eller sociale forhold samt sikrer god ledelsespraksis igennem screening, eksklusioner, investeringsanalyser og investeringsbeslutninger samt aktivt ejerskab. Afdelingen følger Danske Investes politik for ansvarlige investeringer. Anbefaling: Denne fond er muligvis ikke egnet for investorer, som planlægger at trække deres penge ud inden for 3 år.

Seneste rapportering

The return in March for Global Cross Asset Volatility Class C p was +0.72%.

Equities continued to rally with the S&P500 index increasing 3.1% over the month.

Meanwhile, equity volatility as measured by the VIX index fell 0.4 points to 13.0.

Interest rates had no lasting trend with the 10-year German government rate ending the month down 11bp.

The average risk consumption during March was 69% of maximum Value-at-Risk.

Contribution from asset classes:

Equities: Slightly Negative

Rates: Positive

Currencies: Slightly Negative

Historical returns are no reliable indicator of future returns. It should be noted that monthly returns (in percent) are non-additive.

Awards**Porteføljeforvalter****Navn:**

Jacob Øland Jensen
Danske Bank Asset Management

Titel:

Chief Portfolio Manager

Baggrund:

M.Sc. in Economics

Antal års erfaring:

17

Stamdata

Fondskode	LU1807292328
Bloombergkode	DISGCP LX
Beviserne udstedt i	EUR
Formue (mio.) EUR, 17.04.2024	431,3
Indre værdi, 17.04.2024	127,98
Minimuminvestering	1,000 EUR
Management honorar	0,90%
Afdeling under	Danske Invest SICAV - SIF
Fondens domicil	Luxembourg
Administrationselskab	Danske Invest Management A/S

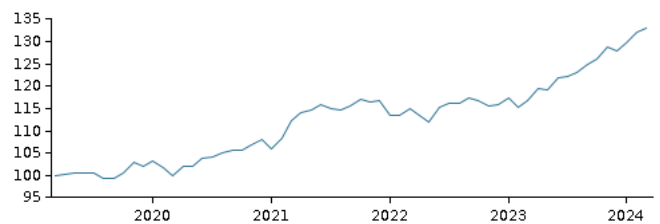
Omkostninger

Løbende administrationsomkostninger	1,11%
Max. indtrædelsesomkostninger	5,00%
Max. udtrædelsesomkostning	1,00%
Resultatbetinget honorar (performance fee): 20% af merafkastet som defineret i prospektet i afsnittet 'Charges and Expenses'.	

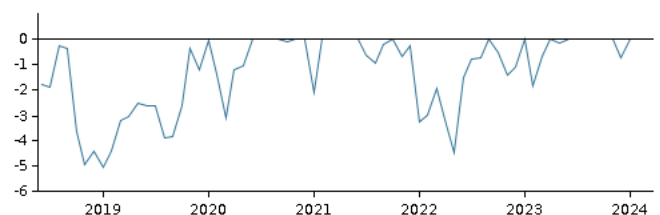
Risikoindikator

Den summariske risikoindikator angiver dette produkts risikoniveau i forhold til andre produkter.

Lavere risiko			Højere risiko			
← Typisk lavere afkast			Typisk højere afkast →			
1	2	3	4	5	6	7

Afkast i perioden: 29.03.2019 - 27.03.2024

Grafen viser som udgangspunkt afkastet seneste 5 år pr. ultimo forrige måned (eller siden start, hvis afdelingen er under 5 år). Tidligere afkast er ingen garanti for fremtidige afkast. Fremtidige afkast kan blive negative. Afkastet kan stige og falde som følge af valutaudsving, hvis fonden er udstedt i en anden valuta end den valuta, som anvendes i det land, hvor du er hjemmehørende.

Drawdown

Månedligt afkast

	Jan	Feb	Mar	Apr	May	Jun	Jul	Aug	Sep	Oct	Nov	Dec	ÅTD
2024	1,27	1,99	0,72										4,03
2023	1,23	-1,83	1,19	2,40	-0,11	2,11	0,41	0,63	1,40	1,09	2,13	-0,70	10,33
2022	-2,97	0,22	1,09	-1,21	-1,32	2,94	0,74	0,03	0,98	-0,48	-0,92	0,33	-0,71
2021	-2,09	2,28	3,64	1,60	0,68	0,85	-0,62	-0,29	0,74	1,34	-0,64	0,40	8,05
2020	1,16	-1,32	-1,77	1,92	0,16	1,63	0,51	0,87	0,54	-0,07	1,19	1,13	6,05
2019	-0,60	0,60	1,23	0,18	0,51	-0,09	0,01	-1,27	0,02	1,24	2,25	-0,82	3,24
2018						-1,74	-0,11	1,64	-0,13	-3,24	-1,32	0,48	-4,41

