

SELIGSON & CO EURO-OBLIGAATIO PUOLIVUOSIKATSAUS 30.6.2021

OSUUSSARJA A, OSUUSLAJIT A ja B | ISIN KOODIT FI0008801816 (A / kasvu) ja FI0008801824 (B / tuotto)

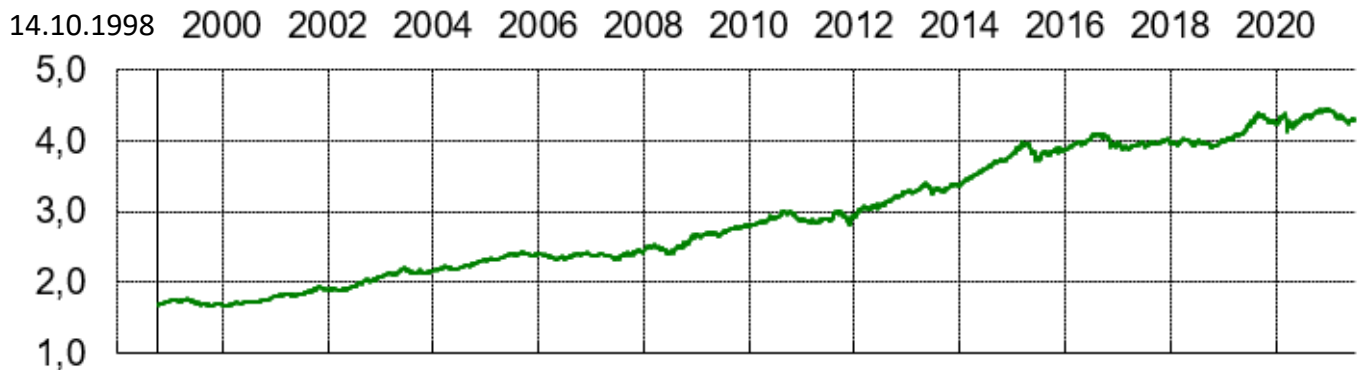
OSUUSSARJA V, OSUUSLAJI A | ISIN KOODIT FI4000414875 (A / kasvu)

Rahastoa hallinnoi Seligson & Co Rahastoyhtiö Oyj, joka kuuluu LähiTapiola-ryhmään.

SIJOITUSPOLITIIKKA

Rahasto sijoittaa eurovaltioiden liikkeelle laskemiin joukkolainoihin. Rahasto ei muodosta näkemystä yksittäisten joukkolainojen tai markkinoiden kehityksestä vaan rahasto pyrkii mallintamaan valitun vertailuindeksin muutoksia. Rahaston tarkoituksena ei ole hankkia kaikkia valitun indeksin arvopapereita, vaan edustava otos kyseisistä arvopapereista. Tavoitteena on pitää mm. korkoriski ja maa- ja maturiteettijakauma lähellä indeksin vastaavia ominaisuuksia. Tällä hetkellä käytettävä indeksi on iBoxx Euro Eurozone Sovereign Overall Total Return –indeksi. Indeksi on tuottoindeksi. Katsauskauden aikana sijoituskohteissa ei tapahtunut muita kuin rahaston normaalin sijoituspolitiikan mukaisia muutoksia. Tietoja rahaston sijoituksista jakson aikana löytyy Rahastoyhtiön julkaisemasta neljännesvuosikatsauksesta.

ARVONKEHITYS (aloituspäivästä)



RAHASTON TIEDOT 30.6.2021

| | |
|---|--|
| NETTOVARALLISUUS € | 68 709 808 |
| Varat € | 69 000 021 |
| Velat € | 290 212 |
| OSUUDENOMISTAJIA | 3 186 |
| PALKKIOT | |
| Rahastoyhtiölle maksettava merkintä- / lunastuspalkkio | ei |
| Rahastoon maksettava kaupankäyntipalkkio lunastettaessa | 0,2 % lunastettaessa, jos sijoitusaika < 90 pv 0,0 % lunastettaessa, jos sijoitusaika ≥ 90 pv |
| Rahastoyhtiölle maksettava hallinnointipalkkio | A-osuudet 0,27 % p.a. V-osuudet 0,00 % p.a. |
| Rahastoyhtiölle maksettava tuottosidonnainen palkkio | Ei |
| Rahastoyhtiölle maksetut hallinnointipalkkiot 1-6/2021, eur | 92 417 |
| Säilytysyhteisölle maksetut palkkiot 1-6/2021, eur | 3 820 |

Tässä puolivuotiskatsauksessa julkaistut luvut perustuvat rahaston arvonlaskentahetkeen. Tämän katsauksen lisäksi rahastosta julkaistaan vuosikertomus, avaintietoesite sekä rahastoesite, joka sisältää myös rahaston säännöt. Näiden virallisten esitteiden lisäksi Seligson & Co Rahastoyhtiö julkaisee rahastojen neljännesvuosikatsauksen, joka sisältää mm. uusimmat tunnusluvut sekä rahastosijoittamiseen liittyviä artikkeleita. Esitteet ja katsaukset on saatavissa joko tilaamalla Seligson & Co Rahastoyhtiöstä tai ladattavissa internet-sivuiltamme. Suosittelemme tutustumista esitteisiin ennen sijoituspäätöstä.

ARVOPAPERISIJOITUSTEN JA JOHDANNAISSOPIMUSTEN RYHMITTELY 30.6.2021

| Arvopaperit, joilla käydään kauppaa muulla säännellyllä markkinapaikalla kuin arvopaperipörssin pörssilistalla | | | | | |
|--|-----------|---------|-----------------|--------------------------------------|--------------------|
| Arvopaperi | Kpl | Kurssi | Siirtyvä kor-ko | Markkina-arvo (sis. siirtyvä kor-ko) | Rahaston arvosta % |
| Ranskan valtion obligaatio 5,75% 25.10.2032 | 2 900 000 | 163,139 | 114 212,33 | 4 845 243,33 | 7,1 |
| Ranskan valtion obligaatio 5,50% 25.04.2029 | 2 300 000 | 144,513 | 23 567,12 | 3 347 366,12 | 4,9 |
| Belgian valtion obligaatio 5,00% 28.03.2035 | 2 000 000 | 163,632 | 26 301,37 | 3 298 941,37 | 4,8 |
| Saksan valtion obligaatio 4,75% 04.07.2034 | 1 800 000 | 164,484 | 85 031,51 | 3 045 743,51 | 4,4 |
| Italian valtion obligaatio 4,0% 01.02.2037 | 2 100 000 | 137,672 | 35 038,71 | 2 926 150,71 | 4,3 |
| Espanjan valtion obligaatio 5,750% 30.07.2032 | 1 800 000 | 156,599 | 95 560,27 | 2 914 342,27 | 4,2 |
| Saksan valtion obligaatio 5,625% 04.01.2028 | 2 000 000 | 140,995 | 55 171,23 | 2 875 071,23 | 4,2 |
| Espanjan valtion obligaatio 4,2% 31.01.2037 | 1 900 000 | 149,160 | 33 231,78 | 2 867 271,78 | 4,2 |
| Saksan valtion obligaatio 6,25% 04.01.2024 | 2 300 000 | 117,607 | 70 496,58 | 2 775 457,58 | 4,0 |
| Ranskan valtion obligaatio 3,50% 25.04.2026 | 2 200 000 | 119,242 | 14 345,21 | 2 637 669,21 | 3,8 |
| Italian valtion obligaatio 4,75% 01.08.2023 | 2 200 000 | 110,641 | 43 589,70 | 2 477 691,70 | 3,6 |
| Italian valtion obligaatio 2,0% 01.12.2025 | 2 200 000 | 108,651 | 3 726,80 | 2 394 048,80 | 3,5 |
| Espanjan valtion obligaatio 4,65% 30.7.2025 | 1 900 000 | 120,567 | 81 572,47 | 2 372 345,47 | 3,5 |
| Saksan valtion obligaatio 4,75% 04.07.2040 | 1 200 000 | 189,090 | 56 687,67 | 2 325 767,67 | 3,4 |
| Ranskan valtion obligaatio 4,5% 25.04.2041 | 1 300 000 | 173,082 | 10 898,63 | 2 260 964,63 | 3,3 |
| Italian valtion obligaatio 6,0% 01.05.2031 | 1 500 000 | 149,517 | 15 163,05 | 2 257 918,05 | 3,3 |
| Ranskan valtion obligaatio 4,25% 25.10.2023 | 1 900 000 | 111,446 | 55 308,22 | 2 172 782,22 | 3,2 |
| Italian valtion obligaatio 6,50% 01.11.2027 | 1 500 000 | 138,454 | 16 426,65 | 2 093 236,65 | 3,0 |
| Italian valtion obligaatio 4,75% 01.09.2044 | 1 100 000 | 159,421 | 17 464,04 | 1 771 095,04 | 2,6 |
| Hollannin valtion obligaatio 4,00% 15.01.2037 | 900 000 | 160,156 | 16 569,86 | 1 457 973,86 | 2,1 |
| Hollannin valtion obligaatio 5,50% 15.01.2028 | 900 000 | 138,974 | 22 783,56 | 1 273 549,56 | 1,9 |
| Itävallan valtion obligaatio 4,15% 15.03.2037 | 700 000 | 159,737 | 8 675,21 | 1 126 834,21 | 1,6 |
| Saksan valtion obligaatio 2,5% 15.08.2046 | 700 000 | 156,114 | 15 390,41 | 1 108 188,41 | 1,6 |
| Espanjan valtion obligaatio 1,450% 31.10.2027 | 1 000 000 | 109,373 | 9 693,15 | 1 103 423,15 | 1,6 |
| Ranskan valtion obligaatio 1,50% 25.05.2050 | 900 000 | 115,866 | 1 405,48 | 1 044 199,48 | 1,5 |
| Portugalin valtion obligaatio 4,100% 15.04.2037 | 600 000 | 149,679 | 5 256,99 | 903 330,99 | 1,3 |
| Suomen valtion obligaatio 2,75% 4.7.2028 | 700 000 | 121,732 | 19 144,52 | 871 268,52 | 1,3 |
| Portugalin valtion obligaatio 2,20% 17.10.2022 | 700 000 | 103,720 | 10 885,48 | 736 925,48 | 1,1 |
| Itävallan valtion obligaatio 0,50% 20.04.2027 | 700 000 | 105,151 | 700,00 | 736 757,00 | 1,1 |
| Italian valtion obligaatio 0,9% 01.08.2022 | 700 000 | 101,440 | 2 627,87 | 712 707,87 | 1,0 |

ARVOPAPERISIJOITUSTEN JA JOHDANNAISSOPIMUSTEN RYHMITTELY 30.6.2021

| Arvopaperit, joilla käydään kauppaa muulla säännellyllä markkinapaikalla kuin arvopaperipörssin pörssilistalla | | | | | |
|--|---------|---------|----------------|-------------------------------------|--------------------|
| Arvopaperi | Kpl | Kurssi | Siirtyvä korko | Markkina-arvo (sis. siirtyvä korko) | Rahaston arvosta % |
| Belgian valtion obligaatio 5,50% 28.03.2028 | 500 000 | 139,940 | 7 232,88 | 706 932,88 | 1,0 |
| Irlannin valtion obligaatio 2,4% 15.05.2030 | 500 000 | 121,250 | 1 578,08 | 607 828,08 | 0,9 |
| Italian valtion obligaatio 3,00% 01.08.2029 | 500 000 | 119,048 | 6 256,90 | 601 496,90 | 0,9 |
| Espanjan valtion obligaatio 2,90% 31.10.2046 | 400 000 | 134,787 | 7 754,52 | 546 902,52 | 0,8 |
| Hollannin valtion obligaatio 3,75% 15.01.2023 | 500 000 | 106,938 | 8 630,14 | 543 320,14 | 0,8 |
| Itävallan valtion obligaatio 3,15% 20.06.2044 | 300 000 | 158,464 | 310,68 | 475 702,68 | 0,7 |
| Irlannin valtion obligaatio 3,4% 18.03.2024 | 400 000 | 110,804 | 3 949,59 | 447 165,59 | 0,7 |
| Italian valtion obligaatio 3,45% 01.03.2048 | 300 000 | 135,593 | 3 459,39 | 410 238,39 | 0,6 |
| Slovakian valtion obligaatio 1,375% 21.01.2027 | 300 000 | 109,864 | 1 830,82 | 331 422,82 | 0,5 |
| Irlannin valtion obligaatio 2,0% 18.02.2045 | 200 000 | 128,007 | 1 468,49 | 257 482,49 | 0,4 |
| Slovenian valtion obligaatio 1,000% 06.03.2028 | 200 000 | 108,170 | 646,58 | 216 986,58 | 0,3 |
| Saksan valtion obligaatio 1,50% 15.05.2023 | 200 000 | 104,148 | 394,52 | 208 690,52 | 0,3 |
| Suomen valtion obligaatio 0,00% 15.9.2023 | 100 000 | 101,434 | 0,00 | 101 434,00 | 0,1 |
| Arvopaperit yhteensä | | | | 68 189 869,46 | 99,2 |
| Salkku yhteensä | | | | 68 189 869,46 | 99,2 |
| Kassa ja muut varat, netto | | | | 519 939,00 | 0,8 |
| RAHASTON ARVO YHTEENSÄ | | | | 68 709 808,46 | 100,0 |
| Liikkeessä olevien osuuksien lukumäärä, kasvuosuus (A) | | | | 14 469 579,7234 | |
| Liikkeessä olevien osuuksien lukumäärä, tuotto-osuus (B) | | | | 742 177,5697 | |
| Liikkeessä olevien osuuksien lukumäärä, kasvuosuus (V) | | | | 1 161 780,9093 | |
| Rahasto-osuuden arvo, kasvuosuus (A) | | | | 4,3041 | |
| Rahasto-osuuden arvo, tuotto-osuus (B) | | | | 1,9015 | |
| Rahasto-osuuden arvo, kasvuosuus (V) | | | | 4,3206 | |

TUNNUSLUVUT JA SIOITUSTEN JAKAUMA 30.6.2021

| KULUT JA MUUT TUNNUSLUVUT | 1.7.2020–30.6.2021 |
|---|---|
| Juoksevat kulut | 0,28 % |
| Tuottosidonnainen palkkio (vuoden alusta) | - |
| Kokonaiskulut | 0,28 % |
| Salkun kiertonopeus | -11,80 % |
| Lainaluokitukset (rating) | AAA 22,8%, AA 34,6%, A 17,1%, BBB 25,5% |
| Salkun korkoriski (duraatio) | 8,54 |
| Välityspalkkiot lähipiirille | 0,00 % |
| Indeksipoikkeama (tracking error) | 1,10 % |
| Sharpen mittari | 0,03 |

Mallinnettava indeksi:

Rahasto mallintaa euromääräisten valtioiden joukkolainojen kehitystä kuvaavan indeksin ominaisuuksia. Tällä hetkellä käytettävä indeksi on iBoxx EUR Eurozone TRI. Indeksi on tuottoindeksi

| SIOITUSTEN MAAJAKAUMA | Osuus % |
|-----------------------|---------|
| Ranska | 23,92 |
| Italia | 22,94 |
| Saksa | 18,09 |
| Espanja | 14,38 |
| Belgia | 5,87 |
| Alankomaat | 4,8 |
| Itävalta | 3,43 |
| Portugali | 2,41 |
| Irlanti | 1,92 |
| Suomi | 1,43 |
| Slovakia | 0,49 |
| Slovenia | 0,32 |