



G R E A T
D A N E

GLOBAL INDEX+

September 2021



INDEX+

Tunet INDEX produkt, som følger verdens mest benyttede benchmark

MSCI World

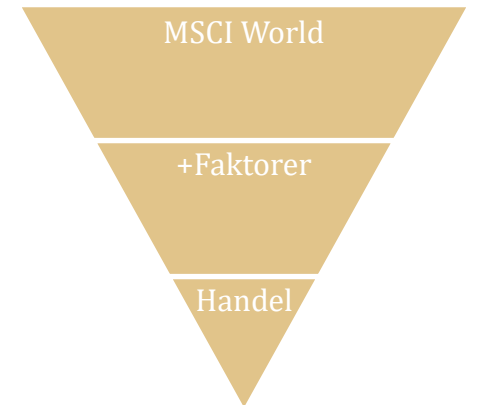
Men produktet skal være billigere og give højere afkast end almindelige ETF og indeksprodukter

ET UNIKT PASSIVT PRODUKT

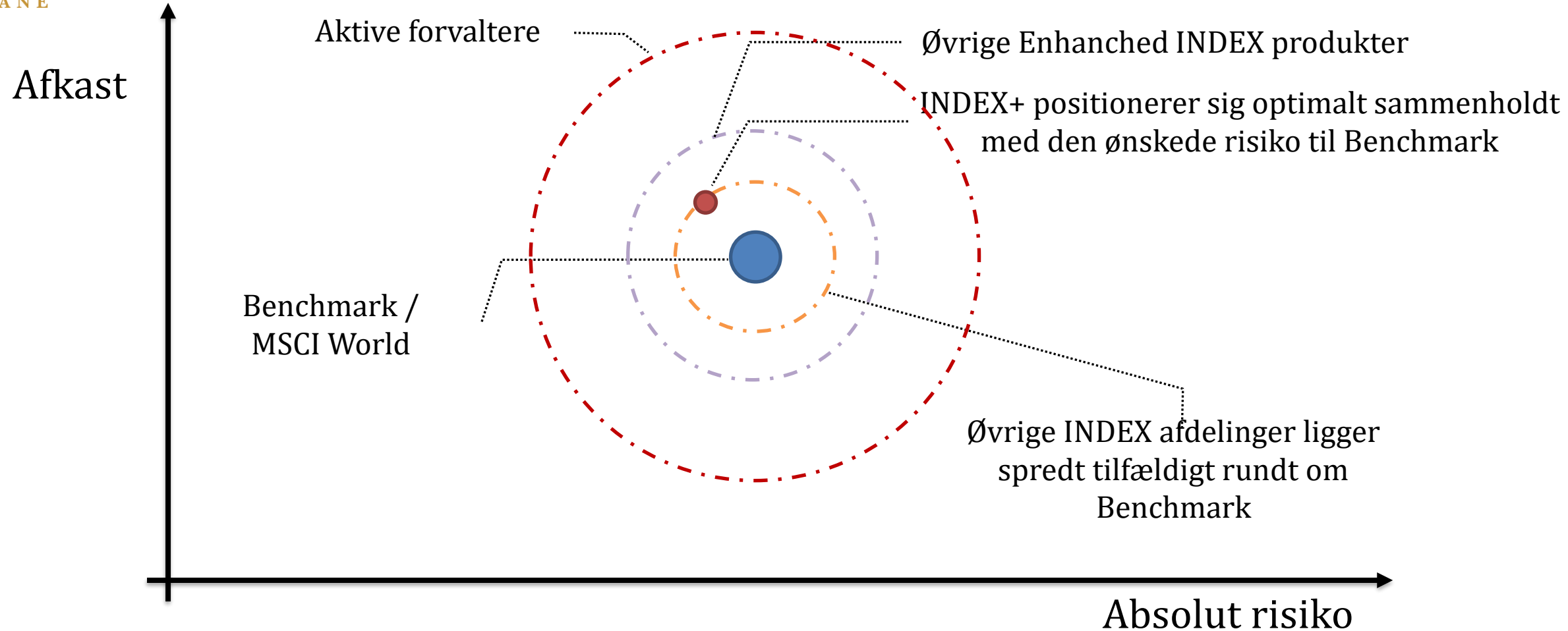
Gennemsyret af passiv talbaseret tilgang – ikke følelser

Vi forholder os passivt...

1. ... til den nuværende markedssituation
 - Tager afsæt i markedsværdi vægtet benchmark
2. ... til hvad der historisk har været attraktivt
 - Allokerer efter hvad der har været attraktivt i over 50 år
3. ... når vi handler
 - Jagter ikke aktierne, men lader aktiekursen komme til os



INDEX+ - HYBRID AF INDEX OG AKTIV FORVALTNING (ENHANCED)



+FAKTORER



+Faktor	Vi overvejer	Bidrager primært med	Primær årsag	Primær forklaring
Value	Billige aktier	Merafkast	Adfærd	Kedelige og merafkastet er langt ude i horisonten
Momentum	Aktier i en god kursudvikling	Merafkast	Adfærd	For langsom indregning af gode nyheder
Small cap	Små aktier (ligevægtet)	Merafkast	Matematisk	Indeks overveger overvurderede aktier og omvendt
Minimum volatility	Aktier som beskytter hele porteføljen ved fald	Risikoreduktion	Matematisk	Diversifikation er gratis
ESG	Aktier som har forbedret deres ESG profil	Risikoreduktion	Adfærd	Reducerer "hale"-risikoen ved problemer relateret til ESG
Kortsigtet tilpasning	Aktier som er faldet den seneste uge	Merafkast	Ubalance	Ubalance i mængden af købere og sælgere, uden at aktiens sande værdi har ændret sig

FORVALTERENS KVALIFIKATIONER

- Jacob Loiborg, har de sidste 13 år arbejdet lige meget med passiv forvaltning (benchmark) og kvantitativ forvaltning (faktorer)
- Disse 2 områder, som ellers normalt er skarpt adskilt, kombineres i INDEX+ til et optimalt produkt



ÅOP

- Danmarks laveste ÅOP for børsnoterede afdelinger
- 0,05% i rådgivningsfee
 - Resten (depotbank m.m.) dækkes af Rådgiveren*
- Ind- og udtræden er på et optimalt niveau (må ikke være for lavt!)
- Handel sker for at tilpasse porteføljen til faktoreksponering
- Bidrag fra outperformance fee håber vi alle bliver så stort som muligt
 - Beregnes af merafkastet

Komponent		ÅOP bidrag
A	Rådgivning	0,050%
B	Øvrige faste omkostninger	0,000%
C	Indirekte handelsomk.	0,010%
D	Ind- og udtræden	0,060%
1	ÅOP i alt fra start	0,120%
E	Direkte handelsomk.	0,100%
2	ÅOP i alt uden merafkast	0,220%
F	Outperformance fee (35%)	0,175%
3	ÅOP i alt med 0,5% merafkast	0,395%

FORDELE & KARAKTERISTIKA

Fordele

- Billigst i Danmark
- Stordriftsfordelene er allerede implementeret
- Gratis afkast potentiale
- Dansk afdeling i DKK
 - Nem og billig at købe og opbevare
- Udbyttebetalende
 - Kan bruges under de fleste skatteformer
- Oplagt som fundamentet i en portefølje
 - Afdækker MSCI World, hvis andre oplagte muligheder mangler

Karakteristika

- Det billigste investeringsforeningsprodukt i Danmark, med ambition om at blive det største
- Omkostningstruktur – lavt fast fee og performance fee – skaber fælles interesser for investor og udbyder
- Bottom up multifaktor produkt
- Høj Information Ratio er i fokus (Merafkast/TE)
- Fokus på lav TE, gør den til et oplagt alternativ til ETF'ere baseret på MSCI World



STAMDATA

Great Dane INDEX+

ISIN	DK0061671872
Benchmark	MSCI World i DKK inkl. nettoudbytter
Type	Børsnoteret på Københavns fondsbørs, udbyttebetalende
Rådgiver	Great Dane Fund Advisors (Jacob Loiborg)
Investeringsstrategi	Enhanced Indexing (multi faktor)
Antal aktier i porteføljen	300-1.100 (afhængigt af AUM)
Tracking error	0,5%-1,0%
Merafkast til MSCI World	0,5%-1,0%
Fast fee	0,05% p.a.
Performance fee (HWM)	35% af merafkast til benchmark
Emissionstillæg	0,22%
Indløsningsfradrag	0,20%
ÅOP start	0,12%



DISCLAIMER

Investeringsforeningen Great Dane og Great Dane Fund Advisors A/S har alle rettigheder til dette produkt. Investeringsforeningen Great Dane og Great Dane Fund Advisors A/S påtager sig intet ansvar for, hvorvidt informationerne er fuldstændige, korrekte eller ajourførte. Anvendelsen sker alene på eget ansvar. Investeringsforeningen Great Dane yder ikke investeringsrådgivning. I intet tilfælde er investeringsforeningen Great Dane og/eller Great Dane Fund Advisors A/S ansvarlige for tab, der måtte opstå som følge af brugen af dette produkt. Den, der anvender informationen eller dele heraf, bør være opmærksom på, at informationen afspejles ved tidspunktet for tilblivelsen og derfor hurtigt kan blive uaktuel. Opsparing gennem afdelinger i en investeringsforening indebærer altid en risiko. Historiske afkast er ingen garanti for fremtidige afkast. De penge, der placeres i en afdeling af en investeringsforening, kan både øges og mindskes i værdi, og det er ikke sikkert, at placeret kapital tilbagevindes.