

Prospektendringer

Prospektendring faktorfond

Styret i KLP Kapitalforvaltning har besluttet å utvide normalintervallet for forventet relativ volatilitet (tracking error) for faktorfondene. Bakgrunnen er noe høyere forventet volatilitet og lavere forventet samvariasjon mellom faktorene for fondets investeringer, enn lagt til grunn ved etablering av fondene. Endringen gjelder fondene KLP AksjeGlobal Flerfaktor I, KLP AksjeGlobal Flerfaktor II, KLP AksjeGlobal SmallCap Flerfaktor og KLP FremvoksendeMarkeder Flerfaktor.

Faktorfondene er i dag bygd opp rundt en kvantitativ metodikk der det er en god del likheter mellom oppbygningen for hvert fond. Metodikken som benyttes er satt opp ut fra et ønske om en portefølje med bestemte egenskaper, og den er naturlig nok satt opp på det som er ansett å være en best mulig konstruksjon. Det er derfor ønskelig å beholde porteføljekonstruksjonen selv om den relative risikoen for fondet er høyere enn det den var forventet å være over tid ved oppstart av fondet.

Økningen av den øvre grensen for relativ volatilitet i prospektet fra 6 til 8 prosent årlig, vil sikre at fondene kan forvaltes på best mulig måte, selv om det er høyere volatilitet i markedet og lavere eller negativ korrelasjon mellom ulike faktorer.

Endringene gjøres gjeldende fra 30. september 2021.

Prospektendring KLP AksjeNorden Indeks

Styret i KLP Kapitalforvaltning har besluttet å utvide normalintervallet for forventet relativ volatilitet (tracking error) for KLP AksjeNorden Indeks. Bakgrunnen er noe høyere forventet relativ volatilitet enn lagt til grunn ved fastsettelsen av fondets gjeldende investeringsstrategi. Økningen er i hovedsak en konsekvens av KLP-fondenes retningslinjer for ansvarlige investeringer, hvor enkelte selskaper ekskluderes fra fondets investeringsunivers. KLP Kapitalforvaltning arbeider kontinuerlig med å minimere avkastningsavvikene mot fondets referanseindeks. Det er imidlertid ikke mulig å fjerne alle effektene, blant annet som følge av få selskaper i fondets indeks.

Økningen av den øvre grensen for relativ volatilitet i prospektet fra 0,75 til 1,0 % prosent årlig, vil sikre at fondene kan forvaltes på best mulig måte uten at fondet blir liggende over normalnivået angitt i prospektet.

Endringen gjøres gjeldende fra 30. september 2021.