

# Pensionsformuepleje høj/lang

## Snapshot – Seneste portefølje og dennes historiske fiktive afkast\*

\*Snapshot - oplysningerne viser sammensætningen af den seneste portefølje, og de angivne afkasttal er beregnet som om man havde haft denne sammensætning hver måned bagud i tid - altså uden historiske ud/indsøftninger i porteføljen. Det vægtede Morningstar Kategori™ gennemsnit er beregnet på samme grundlag og er således direkte sammenligneligt med porteføljen.

## Porteføljeudvikling (DKK) - Viser alle beholdninger for aktuelle sammensætning

31-10-2017

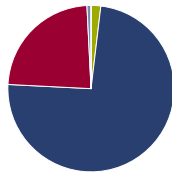
Navn	Morningstar Kategori™	Risiko mærke	Morningstar Rating™	Aktie	Style Box™	Obl	ÅTD%	1år%	3år%	5år%	5år% annual.	5år Std afv	ÅOP	Formidl. prov.	Formue %	Dato
BankInvest Lange Danske Obligationer W	Obligationer - DKK Indenlandske	Gul	★★★★★				2.8	3.0	9.0	19.5	3.6	3.1	0.41	-	10.00	10-31
BankInvest Virksomhedsobligationer HY W	Obligationer - Globale Højrente EU...	Gul	★★				3.9	4.7	7.4	(21.8)	(4.0)	(4.7)	1.35	-	15.00	10-31
BankInvest Basis Globale Aktier Akk W	Aktier - Globale Large Cap Blend	Gul	★★★★				3.2	11.7	28.1	74.9	11.8	10.4	1.57	-	45.00	10-31
BankInvest Danske Aktier W	Aktier - Danmark	Gul	★★★				19.8	20.4	61.5	158.3	20.9	10.4	1.32	-	15.00	10-31
BankInvest Europa Small Cap Aktier W	Aktier - Europa Small Cap	Gul	(3)				15.5	22.4	42.9	(118.0)	(16.9)	(12.3)	1.58	-	15.00	10-31
<b>Valgt portefølje - alle fonde</b>			<b>3.5</b>				<b>7.6</b>	<b>12.7</b>	<b>30.3</b>	<b>80.3</b>	<b>12.5</b>	<b>9.0</b>	<b>*1.39</b>	<b>0.00</b>	<b>100.00</b>	
Porteføljens risikomål (inkl. korrelation)												<b>7.7</b>				
Vægtet kategorigennemsnit			(3.0)				10.6	14.9	34.7	80.2	12.5	9.3	-	-		
- % analyseret på fondenes egne tal			85%				100%	100%	100%	70%	70%	70%	100%	100%		
- % analyseret på kategoriens gennemsnit (* Se note Porteføljeberegninger)			15%				0%	0%	0%	30%	30%	30%	-	-		

\* ÅOP er beregnet på basis af den aktuelle porteføljesammensætning og tager således ikke højde for historiske omlægninger i porteføljen

## Aktivfordeling

30-09-2017

Aktivfordeling	% Formue
Kontant o.lign.	1.9
Aktier	73.9
Obligationer	23.4
Øvrige	0.8
Ikke klassificeret	0.0



## Valutafordeling

Valutafordeling	% Obligationer
USD	83.1
DKK	13.6
Øvrige	3.3

## Løbetidsfordeling

Løbetidsfordeling	% Obligationer
1 til 3 år	2.4
3 til 5 år	21.2
5 til 7 år	22.3
7 til 10 år	26.9
Over 10 år	27.2

## Regioner og sektorer

30-09-2017

### Regionalfordeling

Regionalfordeling	% Aktier
Nordamerika	35.3
Central- og Sydamerika	0.2
England	11.2
Vesteuropa - Eurolande	17.8
Vesteuropa - Ikke-Eurolande	29.1
Østeuropa - Nye markeder	0.0
Mellemøsten & Afrika	0.0
Japan	0.1
Australasien	0.0
Asien - de 4 Tigre	1.5
Emerging Asien (ex 4 Tigre)	3.2

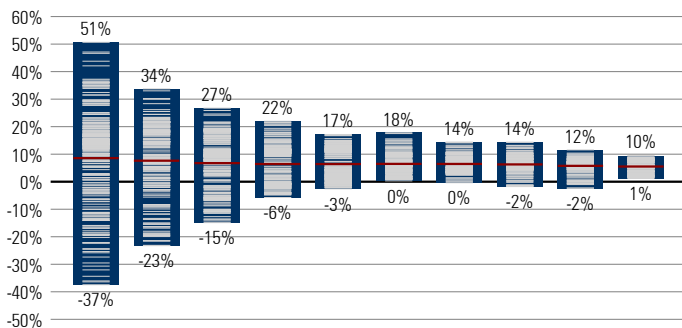


### Sektorfordeling

Sektorfordeling	% Aktier
<b>Cykliske</b>	<b>40.3</b>
Materialer	7.7
Cyklisk forbrug	12.5
Finans	18.9
Ejendomme	1.2
<b>Følsomme</b>	<b>35.8</b>
Kommunikationsservice	0.3
Olje og gas	3.7
Industri	17.0
Teknologi	14.8
<b>Defensive</b>	<b>23.9</b>
Forbrugsvare	9.8
Sundhed	12.8
Forsyning	1.3

## Afkastudsving for aktuel sammensætning

31-10-2017



Periode 1 år 2 år 3 år 4 år 5 år 6 år 7 år 8 år 9 år 10 år  
 Antal obs. 227 215 203 191 179 167 155 143 131 119  
 Historik: 19 år og 10 måneder

Porteføljens afkastudsving vist på forskellige investeringsperioder. Søjlerne yderpunkter viser max/min afkastet for investeringsperioden, de lyse streger angiver de enkelte periode afkast, og den røde strek angiver gennemsnittet af alle periodeafkast for den pågældende investeringsperiode.

Afkastene forudsætter månedlig rebalancering.

## Porteføljeoverblik for aktuelle sammensætning

31-10-2017

### Porteføljeudvikling

Porteføljeudvikling	%
ÅTD	7.6
1år	12.7
3år	30.3
5år	80.3
Annualiseret 3år	9.2
Annualiseret 5år	12.5

### Porteføljeberegninger (historisk)

\*Porteføljens udviklingsnøgletal, er kalkuleret på fondenes egne historiske data, hvor det er muligt. Har en fond ikke data i den valgte periode, er der i kalkulationerne benyttet kategoriens nøgletal (benchmark) for en gennemsnitsfond, som erstatning. Markeret med parentes () om tallet. Porteføljens samlede årlige risiko, beregnet på standardafvigelse over 5 års horisont, er inkl. korrelation. Porteføljeudvikling beregnet på seneste månedslutning.

### Porteføljens risikomål (inkl. korrelation)

Porteføljens risikomål (inkl. korrelation)	%
Std. afv. 5 år	7.7%
<div style="display: flex; justify-content: space-around;"> <span>▼</span> <span>▲</span> </div>	
<div style="display: flex; justify-content: space-around;"> <span>▼</span> <span>▲</span> </div>	
Vægtet kategorigennemsnit	7.5%

### Generelt

Antal investeringer(fonde) i porteføljen	5
Gennemsnitlig Morningstar Rating™	3.50