

# Pensionsformuepleje høj/mellem

## 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

31-12-2017

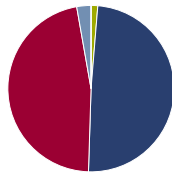
Navn	Morningstar Kategori™	Risiko mærke	Morningstar Rating™	Style Box™	Aktie	Obl	ÅTD%	1år%	3år%	5år%	5år% annual.	5år Std afv	ÅOP	Formidl. prov.	Formue %	Dato
BankInvest Lange Danske Obligationer W	Obligationer - DKK Indenlandske	Gul	★★★★				3.2	3.2	7.8	18.4	3.4	3.1	0.41	-	40.00	12-31
BankInvest Virksomhedsobligationer HY W	Obligationer - Globale Højrente EU...	Gul	★★				3.3	3.3	9.4	(18.2)	(3.4)	(4.6)	1.35	-	10.00	12-31
BankInvest Basis Globale Aktier Akk W	Aktier - Globale Large Cap Blend	Gul	★★★★				2.9	2.9	23.2	71.8	11.4	10.4	1.57	-	30.00	12-31
BankInvest Danske Aktier Akk W	Aktier - Danmark	Gul	(3)				14.2	14.2	(57.6)	(156.9)	(20.8)	(11.8)	1.44	-	10.00	12-31
BankInvest Europa Small Cap Aktier W	Aktier - Europa Small Cap	Gul	★★				15.1	15.1	38.9	(109.4)	(15.9)	(12.3)	1.58	-	10.00	12-31
<b>Valgt portefølje - alle fonde</b>			<b>3.5</b>				<b>5.4</b>	<b>5.4</b>	<b>20.7</b>	<b>57.3</b>	<b>9.5</b>	<b>7.1</b>	<b>*1.07</b>	<b>0.00</b>	<b>100.00</b>	
Porteføljens risikomål (inkl. korrelation)												<b>5.6</b>				
Wægtet kategorigennemsnit			(3.0)				7.1	7.1	21.8	53.2	8.9	7.0	-	-		
- % analyseret på fondenes egne tal			90%				100%	100%	90%	70%	70%	70%	100%	100%		
- % analyseret på kategoriens gennemsnit (* Se note Porteføljeberegninger)			10%				0%	0%	10%	30%	30%	30%	-	-		

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

## Aktivfordeling

30-11-2017

Aktivfordeling	% Formue
Kontant o.lign.	1.3
Aktier	49.2
Obligationer	46.7
Øvrige	2.8



## Valutafordeling

Valutafordeling	% Obligationer
DKK	46.3
USD	45.6
Øvrige	8.1

## Løbetidsfordeling

Løbetidsfordeling	% Obligationer
1 til 3 år	2.5
3 til 5 år	17.4
5 til 7 år	10.5
7 til 10 år	21.0
Over 10 år	48.6

## Regioner og sektorer

30-11-2017

### Regionalfordeling

Regionalfordeling	% Aktier
Nordamerika	31.8
Central- og Sydamerika	0.2
England	11.6
Vesteuropa - Eurolande	18.6
Vesteuropa - Ikke-Eurolande	31.8
Østeuropa - Nye markeder	0.0
Mellemøsten & Afrika	0.0
Japan	0.2
Australasien	0.0
Asien - de 4 Tigre	2.7
Emerging Asien (ex 4 Tigre)	3.1

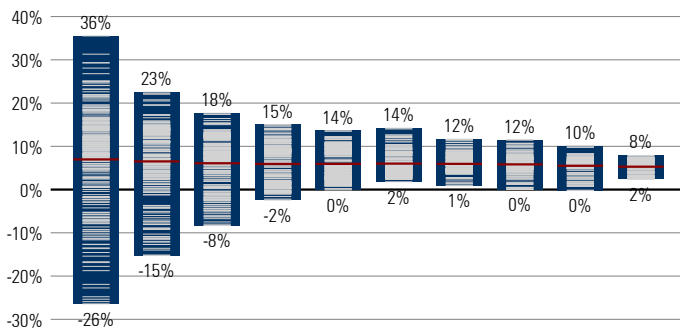


### Sektorfordeling

Sektorfordeling	% Aktier
<b>Cykliske</b>	<b>37.7</b>
Materialer	6.7
Cyklisk forbrug	12.8
Finans	17.1
Ejendomme	1.1
<b>Følsomme</b>	<b>37.3</b>
Kommunikationsservice	0.3
Olie og gas	3.6
Industri	19.0
Teknologi	14.4
<b>Defensive</b>	<b>25.0</b>
Forbrugsvarer	10.2
Sundhed	13.4
Forsyning	1.4

## Afkastudsving for aktuell sammensætning

31-12-2017



Periode 1 år 2 år 3 år 4 år 5 år 6 år 7 år 8 år 9 år 10 år  
 Antal obs. 229 217 205 193 181 169 157 145 133 121  
 Historik: 20 år og 0 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

31-12-2017

### Porteføljeudvikling

Porteføljeudvikling	%
ÅTD	5.4
1år	5.4
3år	20.7
5år	57.3
Annualiseret 3år	6.5
Annualiseret 5år	9.5

### Porteføljens risikomål (inkl. korrelation)

Porteføljens risikomål (inkl. korrelation)	%
Std. afv. 5 år	5.6%
Wægtet kategorigennemsnit	5.3%

### 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 gennemsnitlig fond, 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 månedsluttime.

### Generelt

Antal investeringer(fonde) i porteføljen	5
Gennemsnitlig Morningstar Rating™	3.5