

# Pensionsformuepleje lav/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/indsiftninger 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

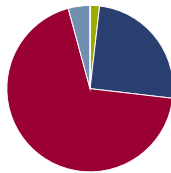
Navn	Morningstar Kategori™	Risiko mærke	Morningstar Rating™	Style Box™	Aktie	Obl	ÅTD%	1år%	3år%	5år%	5år% annual.	5år Std afv	ÅOP	Formidl. prov.	Formue %	Dato
BankInvest Korte Danske Obligationer W	Obligationer - DKK Korte Indenland...	Gul	★★				1.4	1.6	3.5	8.0	1.5	0.8	0.26	-	15.00	10-31
BankInvest Virksomhedsobligationer IG W	Obligationer - EUR Virksomheder	Gul	★★★				3.1	2.5	6.4	17.6	3.3	2.8	0.80	-	10.00	10-31
BankInvest Udenlandske Obligationer W	Obligationer - Globale EUR Fokus	Gul	★★				-0.2	-1.8	0.6	4.0	0.8	2.9	0.62	-	15.00	10-31
BankInvest Lange Danske Obligationer W	Obligationer - DKK Indenlandske	Gul	★★★★★				2.8	3.0	9.0	19.5	3.6	3.1	0.41	-	35.00	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	-	15.00	10-31
BankInvest Danske Aktier Akk W	Aktier - Danmark	Gul	(3)				19.5	20.1	(66.8)	(175.6)	(22.5)	(11.4)	1.44	-	10.00	10-31
<b>Valgt portefølje - alle fonde</b>			<b>3.6</b>				<b>3.9</b>	<b>5.0</b>	<b>15.3</b>	<b>39.2</b>	<b>6.8</b>	<b>4.5</b>	<b>*0.74</b>	<b>0.00</b>	<b>100.00</b>	
Porteføljens risikomål (inkl. korrelation)												<b>3.3</b>				
Vægtet kategorigennemsnit			(3.0)				4.2	5.3	14.7	36.6	6.4	4.4	-	-		
- % analyseret på fondenes egne tal			90%				100%	100%	90%	90%	90%	90%	100%	100%		
- % analyseret på kategoriens gennemsnit (* Se note Porteføljeberegninger)			10%				0%	0%	10%	10%	10%	10%	-	-		

\* 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.	1.8
Aktier	25.0
Obligationer	68.9
Øvrige	4.2
Ikke klassificeret	0.0



## Valutafordeling

% Obligationer

EUR	40.2
DKK	25.0
USD	18.1
Øvrige	16.6

## Løbetidsfordeling

% Obligationer

1 til 3 år	15.5
3 til 5 år	16.9
5 til 7 år	11.0
7 til 10 år	17.1
Over 10 år	39.6

## Regioner og sektorer

30-09-2017

### Regionalfordeling

% Aktier

Nordamerika	34.5
Central- og Sydamerika	0.2
England	5.4
Vesteuropa - Eurolande	9.6
Vesteuropa - Ikke-Eurolande	42.6
Østeuropa - Nye markeder	0.0
Mellemøsten & Afrika	0.0
Japan	0.1
Australasien	0.0
Asien - de 4 Tigre	1.4
Emerging Asien (ex 4 Tigre)	3.2

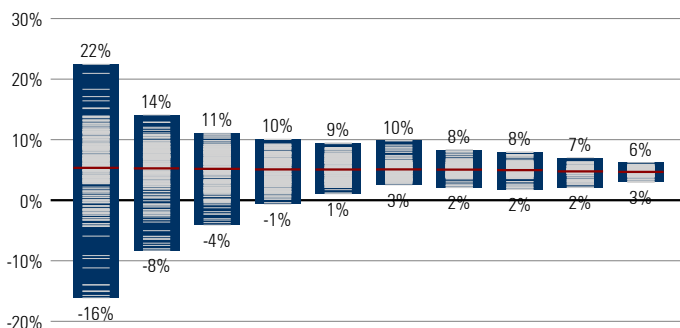


### Sektorfordeling

<b>Cykliske</b>	<b>35.2</b>
Materialer	6.5
Cyklisk forbrug	9.2
Finans	19.5
Ejendomme	0.0
<b>Følsomme</b>	<b>36.7</b>
Kommunikationsservice	0.1
Olie og gas	2.8
Industri	19.6
Teknologi	14.1
<b>Defensive</b>	<b>28.0</b>
Forbrugsvarer	10.0
Sundhed	16.3
Forsyning	1.7

## Afkastudsving for aktuell 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. 229 217 205 193 181 169 157 145 133 121  
 Historik: 20 år og 0 måneder

Porteføljens afkastudsving vist på forskellige investeringsperioder. Søjlernes 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

%

ÅTD	3.9
1år	5.0
3år	15.3
5år	39.2
Annualiseret 3år	4.9
Annualiseret 5år	6.8

### Porteføljeberegninger (historik)

\*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 gennemsnitfond, som erstatning. Mærket 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)

Std. afv. 5 år	3.3%
▼	
Low	
Moderat	
Høj	
▲	
Vægtet kategorigennemsnit	3.2%

### Generelt

Antal investeringer(fonde) i porteføljen	6
Gennemsnitlig Morningstar Rating™	3.55