

# Pensionsformuepleje middel/kort

## 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

31-08-2017

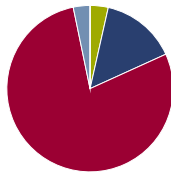
Navn	Morningstar Kategori™	Risiko mærke	Morningstar Rating™	Style Box™	Aktie	Obl	ÅTD%	1år%	3år%	5år%	5år% annual.	5år Std afv	ÅOP	Formidl. prov.	Formue %	Dato
BankInvest Korte Danske Obligationer W	Obligationer - DKK Korte Indenland...	Gul	★★				1.1	1.3	3.4	7.9	1.5	0.8	0.26	-	35.00	08-31
BankInvest Virksomhedsobligationer IG W	Obligationer - EUR Virksomheder	Gul	★★★				2.2	0.7	5.7	18.6	3.5	2.8	0.80	-	20.00	08-31
BankInvest Udenlandske Obligationer W	Obligationer - Globale EUR Fokus	Gul	★★★				0.2	-2.6	1.1	4.8	0.9	2.9	0.62	-	30.00	08-31
BankInvest Basis Globale Aktier Akk W	Aktier - Globale Large Cap Blend	Gul	★★★★				-1.4	6.2	25.5	67.2	10.8	10.4	1.57	-	10.00	08-31
BankInvest Danske Aktier Akk W	Aktier - Danmark	Gul	(3)				16.3	13.4	(65.3)	(171.7)	(22.1)	(11.4)	1.44	-	5.00	08-31
<b>Valgt portefølje - alle fonde</b>			<b>2.8</b>				<b>1.6</b>	<b>1.1</b>	<b>8.5</b>	<b>23.2</b>	<b>4.3</b>	<b>3.3</b>	<b>*0.67</b>	<b>0.00</b>	<b>100.00</b>	
Porteføljens risikomål (inkl. korrelation)												<b>2.3</b>				
Vægtet kategorigennemsnit			(3.0)				1.7	1.8	8.9	24.0	4.4	3.5	-	-		
- % analyseret på fondenes egne tal			95%				100%	100%	95%	95%	95%	95%	100%	100%		
- % analyseret på kategoriens gennemsnit (* Se note Porteføljeberegninger)			5%				0%	0%	5%	5%	5%	5%	-	-		

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

## Aktivfordeling

31-08-2017

Aktivfordeling	% Formue
Kontant o.lign.	3.5
Aktier	14.7
Obligationer	78.5
Øvrige	3.3
Ikke klassificeret	0.0



## Valutafordeling

% Obligationer

EUR	39.0
DKK	33.8
USD	16.8
Øvrige	10.5

## Løbetidsfordeling

% Obligationer

1 til 3 år	26.9
3 til 5 år	17.5
5 til 7 år	17.4
7 til 10 år	19.9
Over 10 år	18.3

## Regioner og sektorer

31-08-2017

### Regionalfordeling

% Aktier

Nordamerika	39.4
Central- og Sydamerika	0.2
England	6.5
Vesteuropa - Eurolande	10.5
Vesteuropa - Ikke-Eurolande	39.0
Østeuropa - Nye markeder	0.0
Mellemøsten & Afrika	0.0
Japan	0.2
Australasien	0.0
Asien - de 4 Tigre	1.6
Emerging Asien (ex 4 Tigre)	2.6

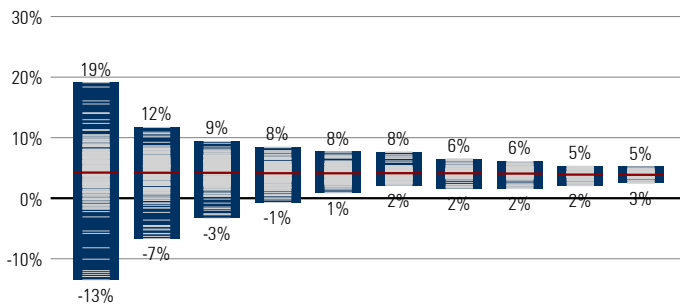


### Sektorfordeling

<b>Cykliske</b>	<b>35.3</b>
Materialer	6.5
Cyklisk forbrug	8.4
Finans	20.3
Ejendomme	0.0
<b>Følsomme</b>	<b>35.9</b>
Kommunikationsservice	0.2
Olie og gas	2.8
Industri	18.4
Teknologi	14.6
<b>Defensive</b>	<b>28.8</b>
Forbrugsvarer	10.6
Sundhed	16.7
Forsyning	1.5

## Afkastudsving for aktuel sammensætning

31-08-2017



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

31-08-2017

### Porteføljeudvikling

%

ÅTD	1.6
1år	1.1
3år	8.5
5år	23.2
Annualiseret 3år	2.8
Annualiseret 5år	4.3

### Porteføljens risikomål (inkl. korrelation)

Std. afv. 5 år	2.3%
▼	
▲	
Wægtet kategorigennemsnit	2.5%

### 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 gennemsnitfond, 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.

### Generelt

Antal investeringer(fonde) i porteføljen	5
Gennemsnitlig Morningstar Rating™	2.75