

# Pensionsformuepleje høj/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

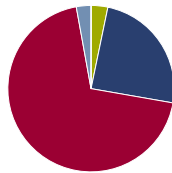
Navn	Morningstar Kategori™	Risiko mærke	Morningstar Rating™	Style Box™	Aktie	Obl	ÅTD%	1år%	3år%	5år%	5år% annual.	5år Std afv	ÅOP	Formidl. prov.	Formue %	Dato
BankInvest Korte Danske Obligationer W	Obligationer - DKK Korte Indenland...	Gul	★★				1.1	1.3	3.4	7.9	1.5	0.8	0.26	-	30.00	08-31
BankInvest Virksomhedsobligationer 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	-	25.00	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	-	15.00	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	-	10.00	08-31
<b>Valgt portefølje - alle fonde</b>			<b>2.9</b>				<b>2.2</b>	<b>2.1</b>	<b>12.8</b>	<b>34.5</b>	<b>6.1</b>	<b>4.1</b>	<b>*0.77</b>	<b>0.00</b>	<b>100.00</b>	
Porteføljens risikomål (inkl. korrelation)												<b>3.0</b>				
Vægtet kategorigennemsnit			(3.0)				2.6	2.9	13.0	34.7	6.1	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

31-08-2017

Aktivfordeling	% Formue
Kontant o.lign.	3.2
Aktier	24.5
Obligationer	69.4
Øvrige	2.9
Ikke klassificeret	0.0



## Valutafordeling

% Obligationer

Valutafordeling	% Obligationer
EUR	41.2
DKK	32.8
USD	15.8
Øvrige	10.2

## Løbetidsfordeling

% Obligationer

Løbetidsfordeling	% Obligationer
1 til 3 år	26.1
3 til 5 år	17.8
5 til 7 år	17.8
7 til 10 år	20.1
Over 10 år	18.2

## Regioner og sektorer

31-08-2017

### Regionalfordeling

% Aktier

Nordamerika	35.4
Central- og Sydamerika	0.2
England	5.8
Vesteuropa - Eurolande	9.5
Vesteuropa - Ikke-Eurolande	45.2
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)	2.4

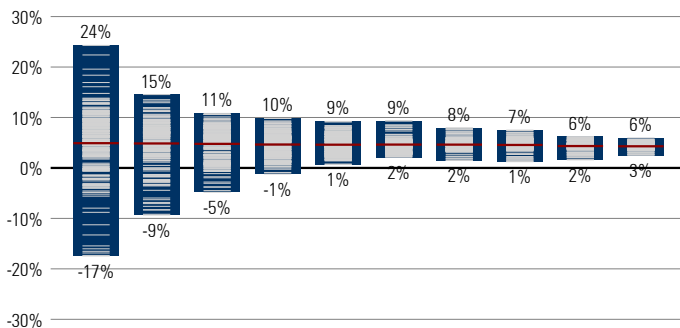


### Sektorfordeling

<b>Cykliske</b>	<b>34.6</b>
Materialer	6.8
Cyklisk forbrug	8.0
Finans	19.8
Ejendomme	0.0
<b>Følsomme</b>	<b>36.2</b>
Kommunikationsservice	0.1
Olie og gas	2.5
Industri	19.9
Teknologi	13.7
<b>Defensive</b>	<b>29.2</b>
Forbrugsvarer	10.1
Sundhed	17.4
Forsyning	1.6

## Afkastudsving for aktuell 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. Søjlerne yderpunkter viser max/min afkastet for investeringsperioden, de lyse streger angiver de enkelte periode afkast, og den røde streger angiver gennemsnittet af alle periodeafkast for den pågældende investeringsperiode.

Afkastene forudsætter månedlig rebalancering.

## Porteføljeoverblik for aktuelle sammensætning

31-08-2017

### Porteføljeudvikling

Porteføljeudvikling	%
ÅTD	2.2
1år	2.1
3år	12.8
5år	34.5
Annualiseret 3år	4.1
Annualiseret 5år	6.1

### 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 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 månedslutning.

### Porteføljens risikomål (inkl. korrelation)

Std. afv. 5 år	3.0%	
▼		
Lav	Moderat	Høj
▲		
Vægtet kategorigennemsnit	3.2%	

### Generelt

Antal investeringer(fonde) i porteføljen	5
Gennemsnitlig Morningstar Rating™	2.85