

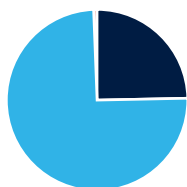
Pensionsformuepleje Høj/Kort

Porteføljedata

31 dec 2022

| Beholdninger | | | | | | | | | |
|--|--|---------------------|--------|--------|-----------|-----------|------|------|----------|
| Beholdning | Kategori | Morningstar Rating™ | ÅTD | 1 år | 3 år ann. | 5 år ann. | ÅOP | IHO | Vægt (%) |
| BankInvest Globale Obl Bæred Udv Akk W | Obligationer - Globale Flexibel EUR Valutasikret | - | -13,47 | -13,47 | -5,10 | -2,65 | 0,70 | 0,11 | 25,00 |
| BankInvest Korte HY Obligationer W | Obligationer - Øvrige | - | -5,05 | -5,05 | -1,02 | - | 0,80 | 0,16 | 22,00 |
| BankInvest Mellemlange Danske Obl W | Obligationer - DKK Indenlandske | ★★★★ | -10,24 | -10,24 | -4,05 | -2,46 | 0,35 | 0,01 | 20,00 |
| BankInvest Glb Akt Bæred Udvik Akk. W | Aktier - Globale Large Cap Blend | - | -12,23 | -12,23 | 5,77 | 6,70 | 1,28 | 0,09 | 11,50 |
| BankInvest Danske Aktier Akk W | Aktier - Danmark | ★★★★ | -17,82 | -17,82 | 9,90 | 9,51 | 1,28 | 0,02 | 5,00 |
| BankInvest GI Akt Akk W (Col Threadn) | Aktier - Globale Large Cap Growth | - | -19,79 | -19,79 | 3,96 | 6,88 | 1,32 | 0,02 | 5,00 |
| BI Erhvervsjendomme | Ejendomme Direkte - Øvrige | - | -4,31 | -4,31 | 1,04 | 1,77 | 1,68 | 0,00 | 5,00 |
| BankInvest Højt Udbytte Aktier Akk. W | Aktier - Globale Højt Udbytte | ★★★★ | -2,86 | -2,86 | 6,94 | 8,27 | 1,23 | 0,02 | 3,50 |
| BI Boligejendomme | Ejendomme Direkte - Øvrige | - | -6,08 | -6,08 | -5,13 | -1,90 | 1,59 | 0,00 | 3,00 |

Aktivfordeling



| Aktivfordeling | Portefølje |
|--------------------|------------|
| ● Aktier | 24,95 |
| ● Obligationer | 75,55 |
| ● Kontant o. lign. | -0,56 |
| ● Andet | 0,06 |
| ● Ej klassificeret | 0,00 |

Statistik

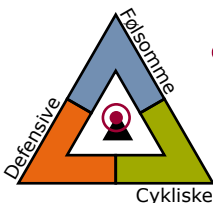
| Risiko og afkast statistik | 3 år | 5 år |
|-------------------------------------|-------|------|
| Standardafvigelse inkl. korrelation | 7,90 | 6,57 |
| Sharpe Ratio | -0,02 | 0,20 |
| Portefølje risiko (1-7) | | 4 |
| Portefølje ÅOP | | 0,87 |
| Portefølje IHO | | 0,08 |

Regionsfordeling



| Europa inkl. Østeuropa | Aktier | Aktier | Asien inkl. Fj.øst. & Japan | Aktier |
|-----------------------------|--------|------------------------|---------------------------------|--------|
| 39,38 | | 49,23 | 11,38 | |
| Storbritannien | 3,78 | USA | Japan | 3,88 |
| Vesteuropa - Eurolande | 10,09 | Canada | Australasien | 0,13 |
| Vesteuropa - ikke Eurolande | 25,27 | Central & Latinamerika | Nye markeder 4 Tigre | 3,22 |
| Nye markeder Europa | 0,00 | | Nye markeder Asien - ex 4 Tigre | 4,15 |
| Mellemøsten / Afrika | 0,25 | | | |

Aktiesektorer

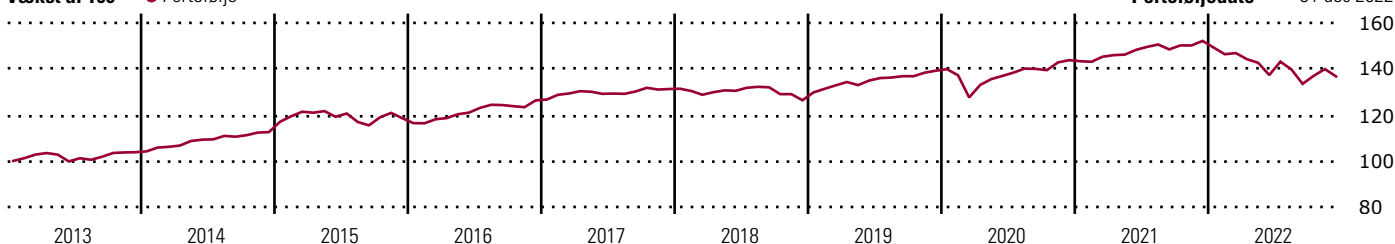


▲ Kategori
● Portefølje

| Cykliske | Aktier | Følsomme | Aktier | Defensive | Aktier |
|-----------------|--------|-----------------------|--------|---------------|--------|
| 30,80 | | 38,89 | | 30,29 | |
| Materialer | 3,12 | Kommunikationsservice | 6,05 | Forbrugsvarer | 8,86 |
| Cyklisk forbrug | 8,13 | Olie og gas | 2,47 | Sundhed | 18,80 |
| Finans | 18,45 | Industri | 13,49 | Forsyning | 2,64 |
| Ejendomme | 1,10 | Teknologi | 16,87 | | |

Afkast

Vækst af 100 ● Portefølje



| Løbende afkast % | Portefølje | Årlige afkast % | Samlet afkast | Periodevis afkast % | Bedste | Dårligste |
|------------------|------------|-----------------|---------------|---------------------|-----------------------|------------------------|
| ÅTD | -10,12 | 2022 | -10,12 | 1 år | 26,08 (mar 09-mar 10) | -19,35 (dec 07-dec 08) |
| 3 måneder | 2,44 | 2021 | 5,82 | 3 år ann. | 12,53 (feb 09-feb 12) | -6,42 (feb 06-feb 09) |
| 6 måneder | -0,43 | 2020 | 3,29 | 5 år ann. | 9,86 (feb 09-feb 14) | -0,49 (feb 04-feb 09) |
| 1 år | -10,12 | 2019 | 10,17 | 7 år ann. | 8,50 (mar 09-mar 16) | 0,28 (mar 02-mar 09) |
| 3 år ann. | -0,59 | 2018 | -3,72 | 10 år ann. | 7,14 (mar 09-mar 19) | 3,13 (sep 12-sep 22) |
| 5 år ann. | 0,83 | | | 15 år ann. | 5,42 (sep 02-sep 17) | 3,06 (sep 07-sep 22) |

Bedste og dårligste periodiske afkast viser de bedste og værste annualiserede afkast for en given portefølje. Tidspærioderne i parentes angiver, i hvilken tidsperiode de bedste og værste afkast er observeret.