

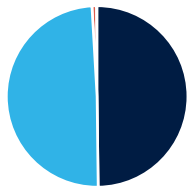
Pensionsformuepleje Høj/Mellem

Porteføljedata

31 dec 2022

Beholdninger										
Beholdning	Kategori	Morningstar Rating™	ÅTD	1 år	3 år ann.	5 år ann.	ÅOP	IHO	Vægt (%)	
BankInvest Glb Akt Bæred Udvik Akk. W	Aktier - Globale Large Cap Blend	-	-12,23	-12,23	5,77	6,70	1,28	0,09	15,00	
BankInvest Mellemlange Danske Obl W	Obligationer - DKK Indenlandske	★★★★	-10,24	-10,24	-4,05	-2,46	0,35	0,01	15,00	
BankInvest Globale Obl Bæred Udv Akk W	Obligationer - Globale Fleksibel EUR Valutasikret	-	-13,47	-13,47	-5,10	-2,65	0,70	0,11	14,00	
BankInvest GI Akt Akk W (Col Threadn)	Aktier - Globale Large Cap Growth	-	-19,79	-19,79	3,96	6,88	1,32	0,02	13,00	
BankInvest Virksomhedsobl IG Akk W	Obligationer - EUR Virksomheder	★★★★	-12,97	-12,97	-3,75	-1,43	0,69	0,21	13,00	
BankInvest Danske Aktier Akk W	Aktier - Danmark	★★★★	-17,82	-17,82	9,90	9,51	1,28	0,02	10,00	
BankInvest Højt Udbytte Aktier Akk. W	Aktier - Globale Højt Udbytte	★★★★	-2,86	-2,86	6,94	8,27	1,23	0,02	7,00	
BankInvest Emerging Markets Aktier W	Aktier - Globale Nye Markeder	★	-21,57	-21,57	-5,37	-3,02	1,62	0,08	5,00	
Bl Erhvervsjendomme	Ejendomme Direkte - Øvrige	-	-4,31	-4,31	1,04	1,77	1,68	0,00	5,00	
Bl Boligejendomme	Ejendomme Direkte - Øvrige	-	-6,08	-6,08	-5,13	-1,90	1,59	0,00	3,00	

Aktivfordeling



Aktivfordeling	Portefølje
● Aktier	49,81
● Obligationer	49,28
● Kontant o. lign.	0,79
● Andet	0,12
● Ej klassificeret	0,00

Statistik

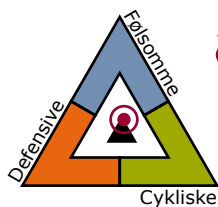
Risiko og afkast statistik	3 år	5 år
Standardafvigelse inkl. korrelation	10,55	9,01
Sharpe Ratio	0,16	0,36
Portefølje risiko (1-7)		4
Portefølje ÅOP		1,03
Portefølje IHO		0,07

Regionsfordeling



Europa inkl. Østeuropa	Aktier	Aktier	Aktier
38,09	43,70	18,21	
Storbritannien	USA	Japan	2,98
Vesteuropa - Eurolande	Canada	Australasien	0,08
Vesteuropa - ikke Eurolande	Central & Latinamerika	Nye markeder 4 Tigre	6,03
Nye markeder Europa		Nye markeder Asien - ex 4 Tigre	9,12
Mellemøsten / Afrika			

Aktiesektorer



▲ Kategori
● Portefølje

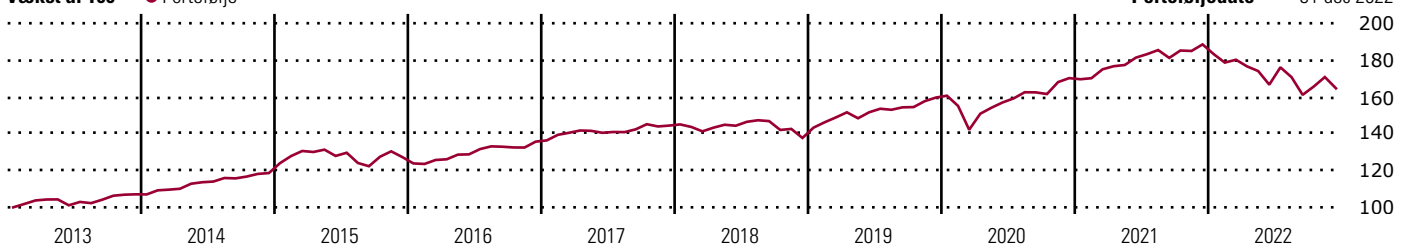
Kategori	Aktier
Cykliske	32,57
Materialer	3,63
Cyklisk forbrug	8,16
Finans	19,47
Ejendomme	1,31

Følsomme	Aktier
39,19	
Kommunikationsservice	6,49
Olie og gas	2,74
Industri	12,89
Teknologi	17,08

Defensiv	Aktier
28,21	
Forbrugsvarer	8,00
Sundhed	17,45
Forsyning	2,76

Afkast

Vækst af 100 ● Portefølje



Løbende afkast %	Portefølje	Årlige afkast %	Samlet afkast	Periodevis afkast %	Bedste	Dårligste
ÅTD	-12,65	2022	-12,65	1 år	35,25 (mar 09-mar 10)	-27,40 (dec 07-dec 08)
3 måneder	2,20	2021	10,76	3 år ann.	15,16 (feb 09-feb 12)	-9,37 (feb 06-feb 09)
6 måneder	-1,20	2020	6,62	5 år ann.	12,22 (feb 09-feb 14)	-1,28 (feb 04-feb 09)
1 år	-12,65	2019	15,93	7 år ann.	10,61 (mar 09-mar 16)	-0,71 (mar 02-mar 09)
3 år ann.	1,04	2018	-4,65	10 år ann.	9,15 (mar 09-mar 19)	3,10 (nov 01-nov 11)
5 år ann.	2,66			15 år ann.	6,70 (feb 03-feb 18)	4,02 (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.