

INSTITUTIONELL FONDPORTFÖLJ MÅTTLIG

Portföljöversikt

30.9.2020

ALLOKERING AV TILLGÅNGSSLAGEN

	Andel av portfölje	Neutralvikt
Aktieplaceringar	30,5 %	25 %
Ränteplasseringar	69,5 %	
Obligationer	63,0 %	60 %
Peningmarknaden	6,5 %	15 %
	100,0 %	

AVKASTNING, kumulativ per 30.9.2020

	Portfölj	Referensindex	Skillnad	Aktieplaceringar	Ränteplasseringar
Från ingången av året	0,9 %	1,5 %	-0,5 %	-2,9 %	2,7 %
1 mån.	-0,4 %	0,0 %	-0,4 %	-1,1 %	-0,1 %
3 mån.	2,4 %	2,3 %	0,2 %	3,5 %	2,0 %
6 mån.	9,3 %	9,6 %	-0,2 %	17,3 %	6,2 %
1 år	2,1 %	2,4 %	-0,2 %	2,7 %	1,9 %
3 år	11,8 %	11,9 %	-0,1 %	17,1 %	9,7 %
Från början (30.9.2015)	25,9 %	25,8 %	0,1 %	47,2 %	17,5 %

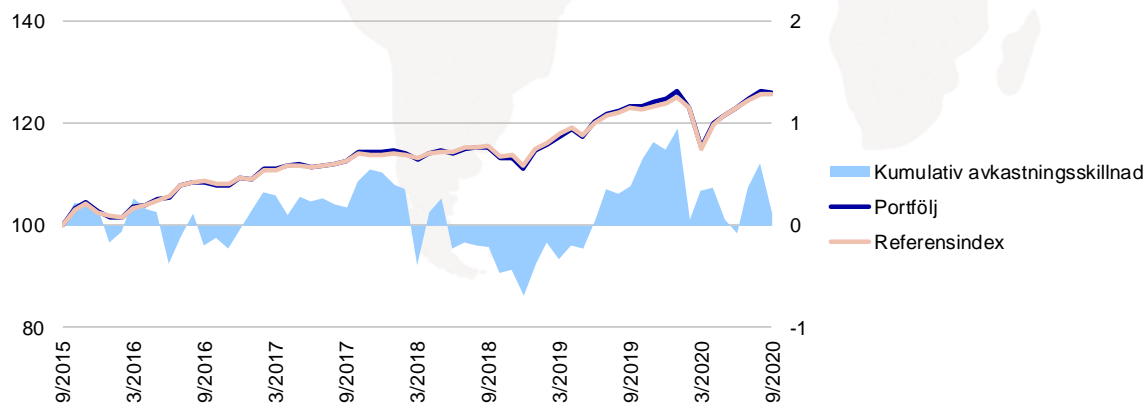
NYCKELTAL (12 mån.)

Volatilitet	9,95 %	2016
Tracking Error	2,59 %	2017
Information Ratio	-0,09	2018
Omsättningshastighet	0,30	2019
Sharpe	0,24	

AVKASTNING, årtig

	Portfölj	Referensindex	Skillnad	Aktieplaceringar	Ränteplasseringar
2016	6,5 %	6,7 %	-0,2 %	8,6 %	4,7 %
2017	4,5 %	4,0 %	0,5 %	9,9 %	2,4 %
2018	-2,8 %	-1,8 %	-1,1 %	-6,5 %	-1,3 %
2019	12,4 %	11,0 %	1,4 %	24,2 %	7,7 %

UTVECKLINGEN AV PORTFÖLJEN OCH REFERENSINDEXET (30.9.2015=100)



Referensindex:

4 % OMX Helsinki Benchmark Cap, 18 % MSCI World TR Net, 4 % MSCI Emerging Markets TR Net, 23 % JP Morgan EMU Gov. Bond, 11 % Merrill Lynch EMU Corporate, 8 % BarCap US Credit Bond, EUR hedged, 11 % Merrill Lynch Global HY Constrained, EUR hedged, 8 % iBoxx EUR Covered Bond Index, 15 % EURIBOR 3M Total Return

Portföljens utveckling omfattar förmedlingsavgifter och utdelning efter beskattning, men inte förvaltningsprovision. Referensindexet omfattar dividender.

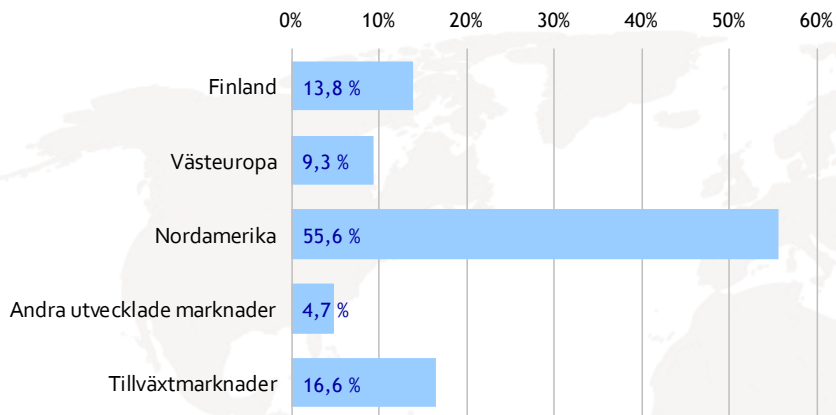
Den historiska utvecklingen är ingen garanti för framtida utveckling. Utvecklingen av en enskild placerares portfölj samt sektorvikterna kan avvika från exempelportföljen i materialet.

INSTITUTIONELL FONDPORTFÖLJ MÅTTLIG

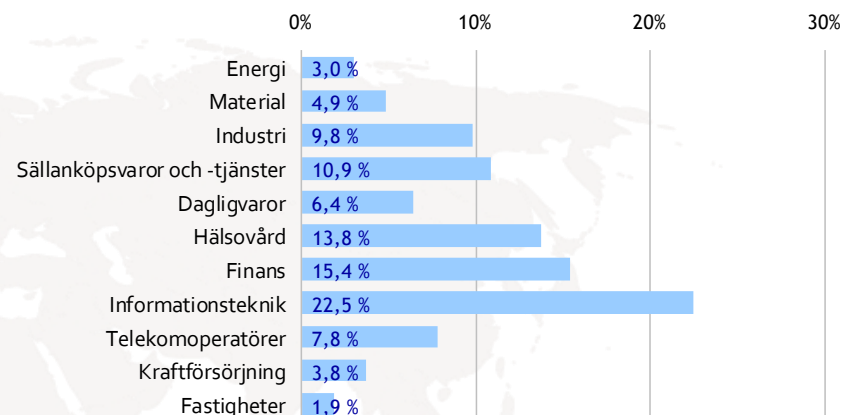
Portföljoversikt

30.9.2020

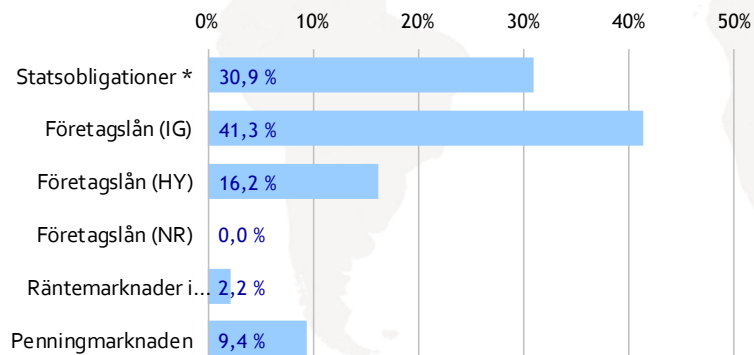
REGIONFÖRDELNING AV AKTIEPLACERINGAR



SEKTORFÖRDELNING AV AKTIEPLACERINGAR



ALLOKERING AV RÄNTEPLACERINGAR



* inklusive obligationer med statsborgen

INSTITUTIONELL FONDPORTFÖLJ MÅTTLIG

Portföljoversikt

30.9.2020

AKTIEPLACERINGAR		Andel av portföljen	Andel av tillgångsslaget	RÄNTEPLACERINGAR		Andel av portföljen	Andel av tillgångsslaget
AKTIEFONDER		25,5 %	100,0 %	RÄNTEFONDER		60,5 %	100,0 %
Nordea Equity Opportunities I tillväxt		10,1 %	39,6 %	Nordea Fixed Income Credit Opp. Fund I tillväxt		32,7 %	54,1 %
Nordea Equity Core I tillväxt		10,0 %	39,2 %	Nordea Pro Euro Obligation C tillväxt		16,5 %	27,3 %
Nordea Pro Finland C tillväxt		4,1 %	16,1 %	Nordea 1 - European Covered Bond BC-EUR		5,9 %	9,7 %
Nordea 1 - Global Portfolio Fund BC-EUR		1,3 %	5,1 %	Nordea Corporate Bond C tillväxt		3,3 %	5,5 %
				Nordea 1 - Flexible Fixed Income Fund BC-EUR		1,7 %	2,8 %
				Nordea Ränta C tillväxt		0,4 %	0,6 %
TAKTISKA VIKTNINGAR BETRÄFFANDE FÖRMÖGENHETSSLAG - GENOMFÖRANDE AV SYN PÅ AKTIE-, RÄNTE- OCH							Andel av portföljen
BLANDFONDER							
Nordea Tactical Asset Allocation I tillväxt							12,0 %

INSTITUTIONELL FONDPORTFÖLJ MÅTTLIG

Portföljöversikt

30.9.2020

AVKASTNINGEN PÅ PORTFÖLJEN PER MÅNAD

	1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	År
2015	—	—	—	—	—	—	—	—	—	3,37 %	1,09 %	-1,77 %	2,6 %
2016	-1,12 %	0,08 %	2,04 %	0,30 %	1,00 %	0,42 %	2,21 %	0,65 %	-0,07 %	-0,54 %	-0,09 %	1,50 %	6,5 %
2017	-0,29 %	1,90 %	0,07 %	0,48 %	0,35 %	-0,53 %	0,26 %	0,25 %	0,47 %	1,63 %	-0,11 %	-0,06 %	4,5 %
2018	0,31 %	-0,47 %	-1,06 %	1,20 %	0,46 %	-0,51 %	0,80 %	0,13 %	0,04 %	-1,88 %	0,10 %	-1,91 %	-2,8 %
2019	3,13 %	1,23 %	1,33 %	1,22 %	-1,30 %	2,45 %	1,37 %	0,54 %	0,63 %	0,11 %	0,64 %	0,43 %	12,4 %
2020	1,14 %	-2,43 %	-6,44 %	4,17 %	1,24 %	1,19 %	1,60 %	1,21 %	-0,38 %	—	—	—	—

INSTITUTIONELL FONDPORTFÖLJ MÅTTLIG

Portföljöversikt

30.9.2020

ANSVARFRISKRIVNING

Nordea Bank Abp övervakas av Europeiska centralbanken och Finansinspektionen i Finland.

Nordea har gjort upp detta material som allmän information och för personligt bruk till placerare som Nordea erbjuder sina tjänster. Materialet beaktar inte enskilda placerares ekonomiska situation, placeringserfarenhet, placeringsobjekt eller riskprofil. Avkastningen på en enskild placerares portfölj samt sektorvikterna kan avvika från exempelportföljen i materialet. Skattekonsekvenserna har inte beaktats i avkastningsutvecklingen. Informationen i materialet ska inte uppfattas som ett anbudsprospekt, inte heller som en köp- eller säljrekommendation. Materialet är uppgjort på basis av information som är allmänt tillgänglig hos Nordea, förutom beskrivningar, rekommendationer, uppskattningar och dylika gjorda av en annan namngiven part. Informationen anses tillförlitlig men Nordea garanterar inte informationens riktighet eller fullständighet och ansvarar inte för skada eller kostnader som användningen av detta material eventuellt förorsakar, även om tjänsteleverantören eller dennas representant hade haft kännedom om ett eventuellt fel i materialet. Nordeakoncernen, dess dotterbolag eller andra bolag i Nordeakoncernen eller i dessa bolag anställda personer kan äga och bedriva handel med värdepapper i bolagen som nämns i detta material samt erbjuda bolagen vilka banktjänster som helst.

För att undvika eventuella intressekonflikter har de anställda inom Nordea förbundit sig att följa bankens interna regler om hantering av insiderinformation, hantering av opublicerat placeringsanalysmaterial, samarbete med andra enheter i banken samt om personlig handel med värdepapper. Nordeakoncernen innehar upphovsrätten till materialet. Denna rapport är inte avsedd för och får inte distribueras till personer eller organisationer med hemvist i USA.