

Benchmark for aktivklasser i Værdipleje

Nedenstående er en oversigt over de benchmark, der benyttes for de forskellige aktivklasser i Værdipleje.

Aktivklasse: Korte obligationer	Benchmark: EFFAS 1-3
Beskrivelse af benchmark: Som benchmark for 'Korte obligationer' anvendes European Federation of Financial Analysts Societies (EFFAS) 1-3. Indekset består af danske statsobligationer med en kort løbetid på mellem 1 og 3 år.	

Aktivklasse: Mellemlange obligationer	Benchmark: EFFAS 3-5
Beskrivelse af benchmark: Som benchmark for 'Korte obligationer' anvendes EFFAS 3-5, der består af danske statsobligationer med en løbetid på mellem 3 og 5 år.	

Aktivklasse: Lange obligationer	Benchmark: EFFAS 5-10
Beskrivelse af benchmark: Som benchmark for 'Lange obligationer' anvendes EFFAS 5-10. EFFAS 5-10 består af danske statsobligationer med en løbetid på mellem 5 og 10 år.	

Aktivklasse: Basisaktier	Benchmark: MSCI World
Beskrivelse af benchmark: Som benchmark for 'Basisaktier' benyttes Morgan Stanleys verdensindeks. Indekset består af 1500 af verdens største europæiske, nordamerikanske, japanske og australske selskaber.	

Aktivklasse: Emerging Markets	Benchmark: MSCI Emerging Markets
Beskrivelse af benchmark: Som benchmark for 'Emerging Markets' benyttes Morgan Stanleys Emerging Markets indeks. Indekset er sammenvæjet af de nationale indeksi i lande i Asien, Østeuropa, Latinamerika og Mellemøsten. Lande inkluderet i indekset er bl.a. Argentina, Brasilien, Mexico, Kina, Indien, Sydafrika, Rusland og Egypten.	

Aktivklasse: Virksomhedsobligationer	Benchmark: ML Global Markets Corporate
Beskrivelse af benchmark: Som benchmark for 'Virksomhedsobligationer' anvendes Merrill Lynch Global Markets Corporate Index, der er sammensat af obligationer udstedt af virksomheder i hele verden.	

Aktivklasse: Konvertible Obligationer	Benchmark: ML Global Markets Corporate
Beskrivelse af benchmark: Som benchmark for 'Konvertible Obligationer' anvendes Merrill Lynch Global Markets Corporate Index, der er sammensat af obligationer udstedt af virksomheder i hele verden.	

Aktivklasse: Ejendomme	Benchmark: EFFAS 5-10
Beskrivelse af benchmark: Som benchmark for 'Ejendomme' anvendes EFFAS 5-10. EFFAS 5-10 består af danske statsobligationer med en løbetid på mellem 5 og 10 år. Valget af benchmark skyldes, at 'Ejendomme' indgår i Værdipleje som et alternativ til en obligationsinvestering.	