

Danica Pension “Handelsgennemsigtighed”

Danica Pension overblik

400 mia. DKK investeringsaktiver

600.000 kunder

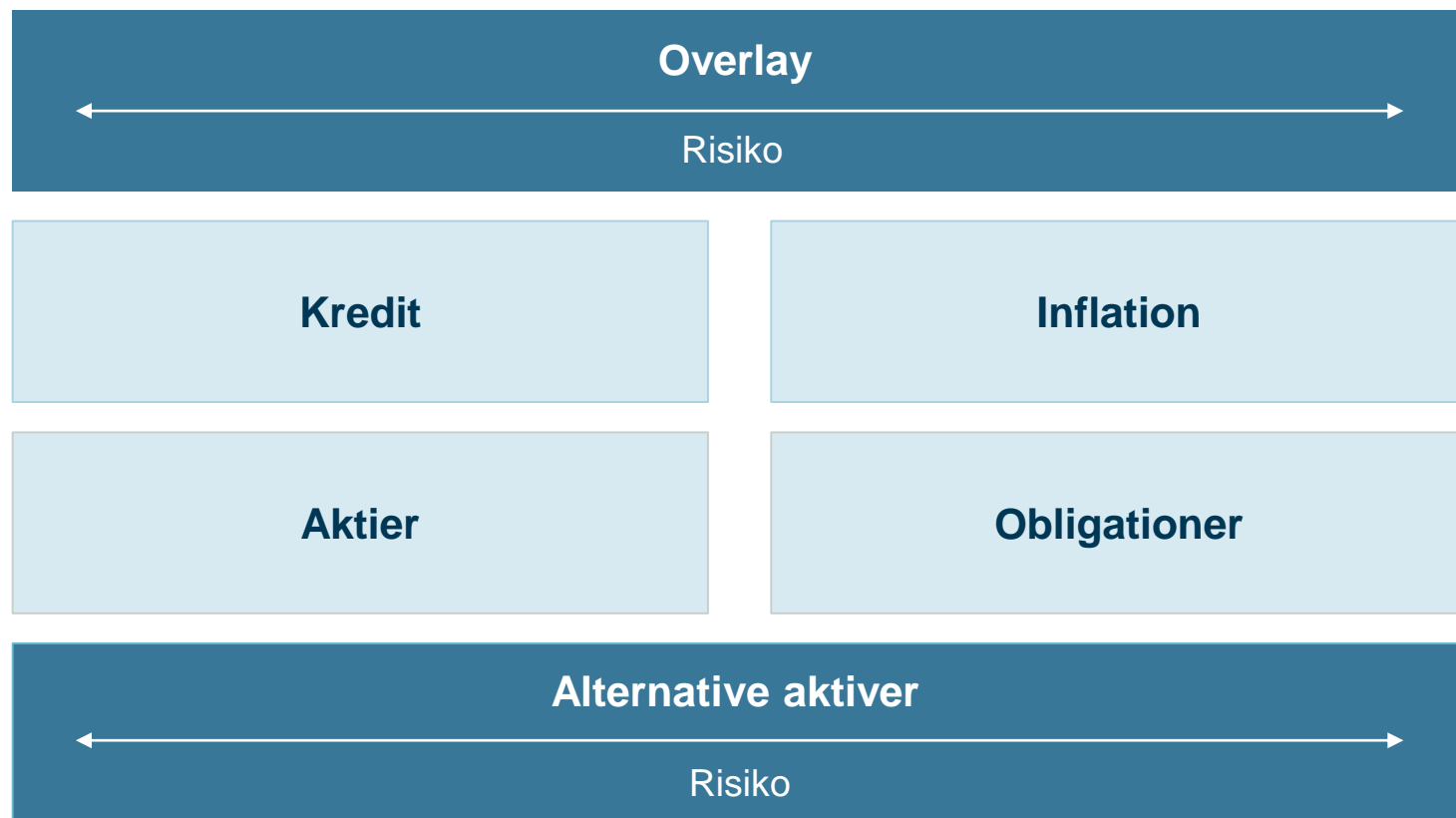
Intern og ekstern forvaltning
75/25

Aktiv intern investeringsstrategi

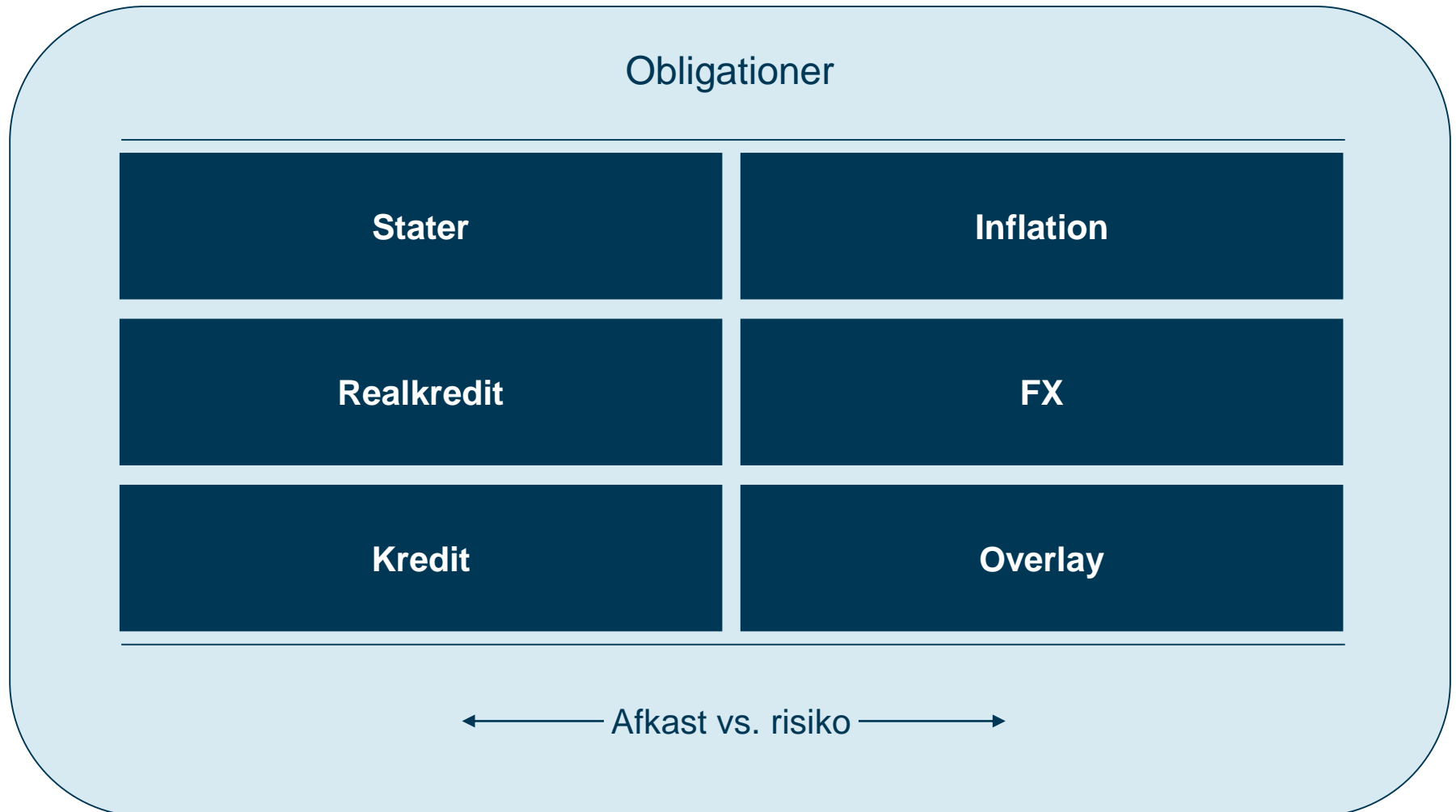
Markedsrente

Gennemsnitsrente

Investeringsunivers og tilgang - top-down



Investeringsunivers og tilgang - top-down



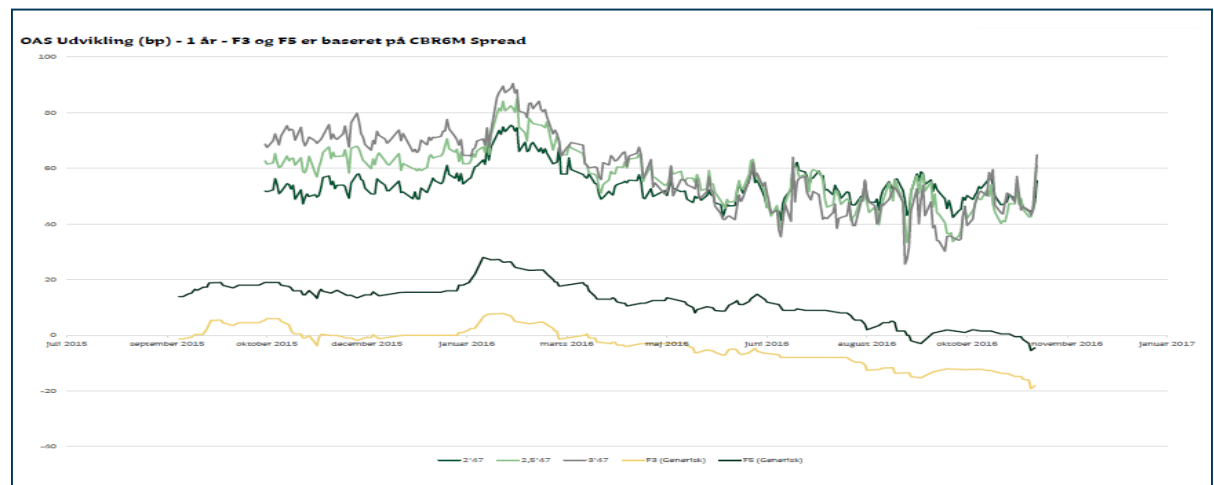
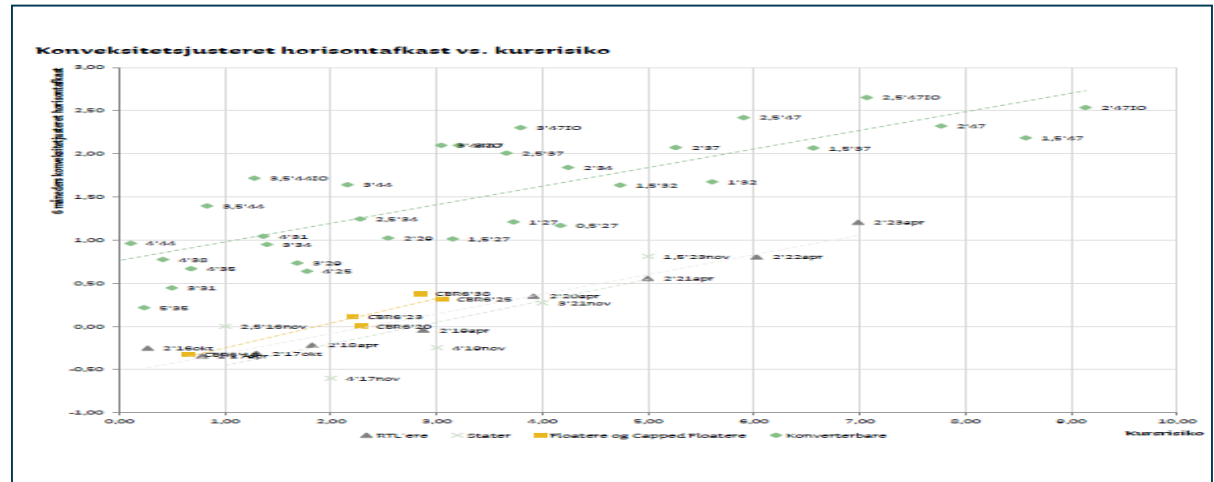
Investeringsunivers og tilgang - bottom-up

Pris/RV analyse

OAS analyse

Kreditvurdering

Likviditetsanalyse



Investeringsstilgang Realkredit

Intern pris (RV)

Markedspris



Modellering af realkredit (teoretisk pris) vs. løbende monitorering af markedspriser

Kredit/illikviditetspræmier

Åben dialog med alle markedsdeltagere om flow

Vurdering af RV ift. markedspris



Handel