

Investeringsstatistik - afkast

Administrative oplysninger

Navn: Investeringsstatistik - beholdning

Emnegruppe: Pension

Kilder: Forsikring & Pensions egen indsamling af data fra pensionselskaberne.

Indhold

Indholdsbeskrivelse: Statistikken indeholder oplysninger om afkast for pensionsbranchen som helhed, opdelt på ti aktivklasser, som følger af Forsikring & Pensions og Finans Danmarks [Vejledning om indplacering af investeringsaktiver ved beregning af pensionsprognoser](#).

Selskaberne indberetter afkast for hvert kvartal sammenlignet med forudgående kvartal, dvs. fx afkastet i 2. kvartal 2020 beregnes fra ultimo 1. kvartal 2020 til ultimo 2. kvartal 2020. Afkastet indberettes for hver af de ti aktivklasser og for henholdsvis markedrente og gennemsnitsrente, og afkastet for aktiver tilknyttet henholdsvis markedrentepension og gennemsnitsrentepension offentliggøres. Afkastet opdeles ikke på danske og udenlandske investeringer, aktive og passive investeringer samt intern og ekstern forvaltning. Afkastet opgøres i procent og beregnes tidsvægtet i danske kroner inklusive valutaafdækning, i det omfang valutaafdækning med rimelighed kan attribueres til de enkelte aktivklasser. På baggrund af de afkastdata, selskaberne indberetter for de ti aktivklasser, beregner Forsikring & Pension en vægtet opgørelse af afkastet for hver aktivklasse på brancheniveau. Som vægte benyttes selskabernes indberettede beholdninger ultimo referencetiden.

Den første indsamling af kvartalsvise tal fandt sted ultimo 3. kvartal 2020. I første indsamling indgik *helårstal* for 2018 og 2019, og kvartalsvise tal for 1. kvartal 2020 og 2. kvartal 2020.

Referencetid og indberetningsperioder

Referencetid er det kvartal, som indberetningen vedrører. Indberetningsperioden er som udgangspunkt den sidste måned i det efterfølgende kvartal. Indberetninger til statistikken laves på baggrund af selskabets beholdninger af aktiver ultimo referencetiden og det opgjorte afkast i referencetiden. Statistikens udgivelsestidspunkt er ca. fire uger efter, at indberetningsperioden slutter.

Sammenlignelighed og usikkerhed

Statistikken er påvirket af udviklingen i Forsikring & Pensions medlemsselskaber. Databrud med videre som følge af fx ændringer i koncernstrukturer og selskaber, som indberetter til statistikken, meddeles på de respektive statistiksider på Forsikring & Pensions hjemmeside. Fejlindberetninger eller manglende indberetninger kan udgøre en usikkerhed ved statistikken. Selskaber, der bliver opmærksom på egne fejlindberetninger, kan revidere indberettede data bagud i tid. I tilfælde af manglende indberetninger opregner Forsikring & Pension aktivbeholdningerne på brancheniveau på baggrund af relevante data for investeringsaktiver. Selskabernes placering af konkrete aktiver i de ti aktivkategorier kan i begrænset omfang være baseret på skøn og individuelle vurderinger, hvilket kan have betydning for statistikken. Den samlede effekt heraf vurderes at være lille.

Tilgængelighed

Distributionskanaler: Statistikken offentliggøres udelukkende på Forsikring & Pensions hjemmeside.