

Metodebeskrivelse for risikomærkning af kortsigtet investeringsrisiko

Markedsrenteprodukter risikomærkes på en skala fra 1,0 til 6,0 på basis af produktets 1-årige investeringsrisiko (standardafvigelse).

Beregning af den 1-årige investeringsrisiko i produktet

Den 1-årige standardafvigelse i produktet beregnes på grundlag af den af bestyrelsen vedtagne strategiske investeringsfordeling i produktet. Beregningen baseres på standardafvigelser og korrelationer for forskellige aktivklasser ifølge afkastforventninger fra Rådet for Afkastforventninger.

Fastsættelse af risikointervaller 1,0-6,0

Skalaen til brug for risikomærkning af kortsigtet investeringsrisiko består af 51 trin (risikotal): 1,0, 1,1, 1,2... 5,9, 6,0. Risikotallet 1,0 er defineret som standardafvigelse fra 2,5%, mens risikotallet 6,0 er standardafvigelse på over 20%. Mellem de to yderpunkter er skalaen inddelt i lige store intervaller. Fx er risikotallet 3,5 defineret som en standardafvigelse mellem 11,25% og 11,60%.

Risikointervallerne ligger som udgangspunkt fast og opdateres derfor ikke løbende.

25.10.2022

F&P

Philip Heymans Allé 1
2900 Hellerup
Tlf.: 41 91 91 91
fp@fogp.dk
www.fogp.dk

Kasper Andersen
Chefkonsulent
Dir. 41919146
kan@fogp.dk

Sagsnr. GES-2022-00017
DokID 452941