



SPPs placeringsportföljer t o m 2015-12-31

	Premiebestämd (Portfölj 1)	Premiebestämd (Portfölj 2)	Premiebestämd (Portfölj 3)	Premiebestämd (Portfölj 4)*	Förmånsbestämd
Garanterad ränta	Mellan 0,5 % och 2,5 %	Mellan 2,7 % och 4 %	Mellan 4,5 % och 5,2 %	Mellan 0,5 % och 5,2 %	BTP/FTP/ITP/PTP

Förvalt kapital 2015-12-31

SEK mrd	12,7	13,8	10,9	4,5	41,1
---------	------	------	------	-----	------

Portföljsammansättning 2015-12-31

Aktier	26 %	4 %	0 %	0 %	6 %
Räntebärande instrument	64 %	89 %	94 %	88 %	88 %
Fastigheter	9 %	7 %	6 %	12 %	6 %

Portföljens känslighet för stora marknadsrörelser 2015-12-31

Aktier ner 10 %	-2,6 %	-0,4 %	0,0 %	0,0 %	-0,6 %
Långa räntor upp 1 %	-3,3 %	-5,1 %	-7,8 %	-1,4 %	-4,9 %
Fastigheter ner 10 %	-0,9 %	-0,7 %	-0,6 %	-1,2 %	-0,6 %

Portföljutveckling fram till årsskiftet 2015/2016

Till och med Januari	1,9 %	1,6 %	2,0 %	0,4 %	1,6 %
Till och med Februari	3,2 %	1,3 %	1,2 %	0,4 %	1,5 %
Till och med Mars	4,2 %	2,5 %	2,7 %	1,0 %	3,0 %
Till och med April	4,4 %	2,3 %	2,4 %	1,1 %	2,9 %
Till och med Maj	4,3 %	1,4 %	1,2 %	0,8 %	1,8 %
Till och med Juni	1,8 %	-0,4 %	-1,0 %	0,5 %	0,0 %
Till och med Juli	3,3 %	0,9 %	0,7 %	0,7 %	1,3 %
Till och med Augusti	1,8 %	1,1 %	1,1 %	0,9 %	1,0 %
Till och med September	0,7 %	0,7 %	0,8 %	0,6 %	0,6 %
Till och med Oktober	2,6 %	1,1 %	1,1 %	0,6 %	1,3 %
Till och med November	3,1 %	1,3 %	1,2 %	0,7 %	1,4 %
Till och med December	1,4 %	0,0 %	-0,6 %	0,7 %	0,1 %
2007-2014 snittavkastning per år	5,3 %	4,9 %	5,9 %	1,8 %	4,8 %
2010-2014 snittavkastning per år	7,9 %	6,5 %	7,0 %	1,7 %	2,7 %
2007	0,4 %	0,4 %	0,4 %	-	0,4 %
2008	-5,9 %	1,2 %	9,6 %	-	0,6 %
2009	9,6 %	4,7 %	2,8 %	1,3 %	4,1 %
2010	7,0 %	5,3 %	3,4 %	0,1 %	6,0 %
2011	3,3 %	7,6 %	12,5 %	2,8 %	8,6 %
2012	9,0 %	6,8 %	6,4 %	3,7 %	6,6 %
2013	6,5 %	0,4 %	-1,8 %	2,7 %	1,4 %
2014	14,0 %	13,0 %	15,4 %	4,2 %	11,6 %
2015	1,4 %	0,0 %	-0,6 %	0,7 %	0,1 %

Detaljerad portföljsammansättning 2015-12-31

Svenska aktier	5 %	1 %	0 %	0 %	1 %
Utländska aktier	11 %	2 %	0 %	0 %	3 %
Tillväxtmarknader	3 %	0 %	0 %	0 %	1 %
Private Equity	6 %	1 %	0 %	0 %	2 %
Hedgefonder	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %
Stats- och statsgarant. obligationer	18 %	26 %	39 %	14 %	32 %
Bostadsinstitut	12 %	28 %	29 %	36 %	24 %
Företagsobligationer	34 %	35 %	26 %	38 %	31 %
Fastigheter & infrastruktur	9 %	7 %	6 %	12 %	6 %

* När det är mindre än 5 år kvar av beräknad utbetalningstid placeras försäkringskapitalet i denna portfölj.

Välkommen till spp.se eller ring Kundcenter på 0771-533 533.

SPP Pension & Försäkring AB (publ). Org nr 516401-8599. Styrelsens säte Stockholm.
SE-105 39 Stockholm.