

## Mål og investeringspolitik

### Mål

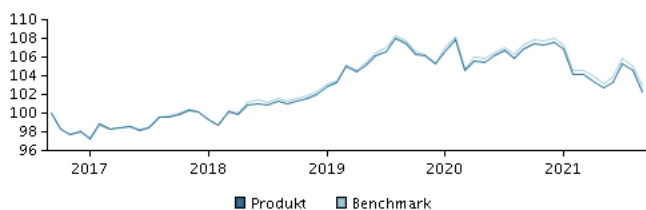
Målet med denne afdeling er at opnå et afkast, som svarer til afkastet for benchmark, som består af 50% Danske Statsobligationer og 50% Danske Realkreditobligationer.

### Investeringspolitik

Investeringsstrategien er passiv, dvs. indeksbaseret. Det betyder, at investeringerne er sammensat, så de følger det valgte indeks.

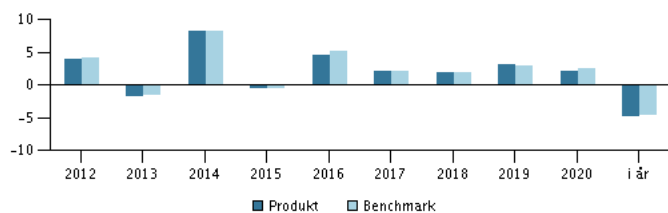
Derved kan du som investor forvente, at afkastet i store træk svarer til udviklingen i indekset. Afkastet vil typisk være lidt lavere end udviklingen i det valgte indeks pga. omkostningerne.

## Afkast i perioden: 30.09.2016 - 30.09.2021



Grafen viser som udgangspunkt afkastet seneste 5 år pr. ultimo forrige måned (eller siden start, hvis afdelingen er under 5 år). Tidligere afkast er ingen garanti for fremtidige afkast. Afkastet kan blive både positivt og negativt.

## Årlige afkast pr. 30.09.2021, %



## Årlige afkast pr. 30.09.2021

	2016	2017	2018	2019	2020	i år
Produkt, %	4,7	2,1	1,9	3,2	2,0	-4,8
Benchmark, %	5,1	2,1	2,0	3,0	2,5	-4,6

## Afkast pr. 30.09.2021

	1 mdr.	3 mdr.	1 år	3 år	5 år
Produkt, %	-2,1	-0,9	-4,3	1,3	2,4
Benchmark, %	-2,0	-0,9	-4,0	1,6	3,0

## Omkostninger

Løbende administrationsomkostninger	0,10%
Årlige omk. i procent. (ÅOP)	0,10%
Max. indtrædelsesomkostninger	0,00%
Max. udtrædelsesomkostning	0,00%
Resultatbetinget honorar (performance fee)	0,00%

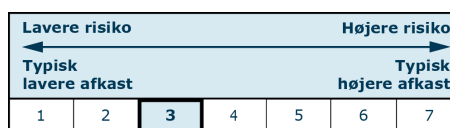
## 10 største investeringer pr. 31.08.2021 \*)

Investering	Vægt
4,50 Dansk Statslån St Lån (Ink) 2039	15,6%
1.00% 1nyk01ea50 50	11,8%
1.00% 1nyk01eda50 50	10,2%
0,50 Dansk Statslån St Lån (Ink) 2029	7,6%
0,50 Dansk Statslån St Lån (Ink) 2027	5,6%
0,25 Dansk Statslån St Lån (Ink) 20202	5,4%
1,75 Dansk Statslån St Lån (Ink) 2025	5,0%
1,00 Nykredit 01ed A 2053	4,7%
1.00% 1 111.E.53 53	4,3%
1,50 Dansk Statslån St Lån (Ink) 2023	4,2%

\*) Bemærk, at alle beholdninger er forsinket med 1 måned.

## Risikoindikator

Risikoindikatoren viser den typiske sammenhæng mellem risikoen ved og dine afkastmuligheder af investeringen.



## Risikoindikatorer for perioden 30.09.2018 - 30.09.2021

Gennemsnitligt årligt afkast, %	0,43
Sharpe Ratio	-
Volatilitet	3,72
Tracking Error	0,51
Information Ratio	-0,19

## Stamdata

Fondskode	DK0060353969
Benchmark	50% Bloomberg Barclays Series-E Denmark Govt All > 1 Y, 50% Nykredit Mortgage Bond Index
Website	www.danicapension.dk
Fondens domicil	Danmark
Beviserne udstedt i	DKK
Formue (mio.), 14.10.2021, DKK	196,6
Indre værdi, 14.10.2021	124,14
Korrigeret varighed, 30.09.2021	8,89
Effektiv rente, 30.09.2021	0,60