

# Afdeling 3 PFA Danske Statsobligationer

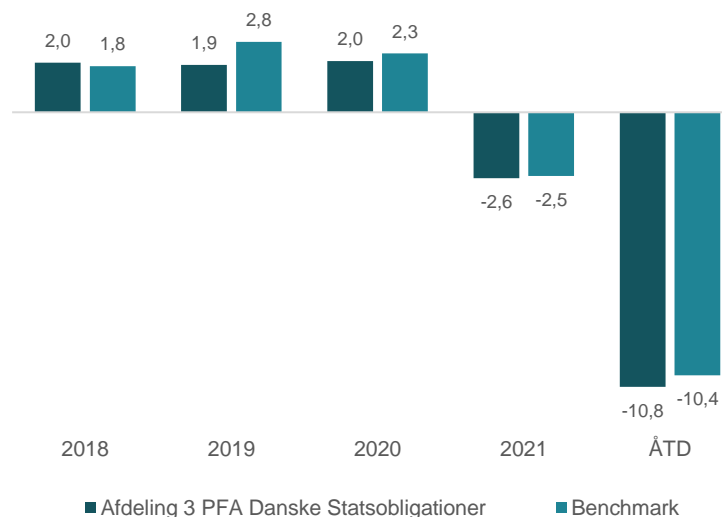
## Investeringsprofil

Danske Statsobligationer investerer primært i danske statsobligationer med den målsætning at skabe et langsigtet merafkast i forhold til afdelingens benchmark. Danske Statsobligationer skaber sine resultater gennem aktiv forvaltning med fokus på porteføljens sammensætning samt rentestrukturernes udseende.

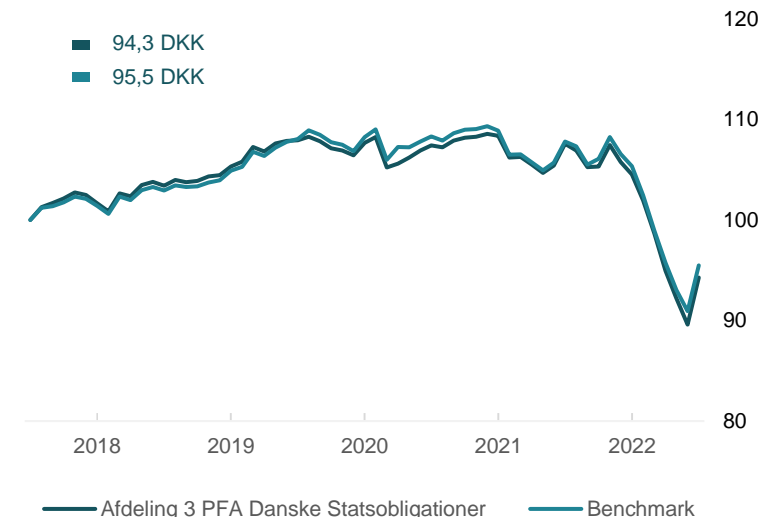
Det tilstræbes at have en renterisiko svarende til samlet korrigeret varighed over 5 år.

Benchmark: 25 % Nordea Markets Government Bond Denmark Index, 75 % realkreditbaserede indeks bestående af:  
 - 18,75 % Nordea DK Non-Callable mortgage constant maturity 3Y  
 - 56,25 % DK Mortgage Callable

## Årlige afkast i % pr. 31-07-2022



## 5 års afkast pr. 31-07-2022



## Stamdata

Fondskode	DK0060236818
Opstart	2010-06-21
Valuta	DKK
Formue	9.343 mio.

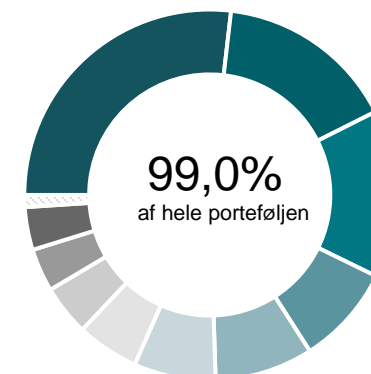
## Risikoindikatorer

	3 år	5 år
Afkast, %	-12,6	-5,7
Tracking Error, %	0,00	0,00
Information Ratio	0,00	0,00
Standardafvigelse, %	0,0	0,0

## 10 største positioner pr. 30-06-2022 \*)

Position	Valuta	Andel
0.5% DENMARK - BULLETT 15/11/2027	DKK	26,8%
0.5% DENMARK - BULLETT 15/11/2029	DKK	15,7%
0% DENMARK - BULLETT 15/11/2031	DKK	14,6%
4.5% DENMARK - BULLETT 15/11/2039	DKK	8,7%
1.75% DENMARK - BULLETT 15/11/2...	DKK	8,6%
0.2% INT BK RECON&DEV 15/11/2039	DKK	7,1%
0.375% KOMMUNEKREDIT 03/02/2045	DKK	5,4%
0% DENMARK - BULLETT 15/11/2024	DKK	4,4%
0.5% KOMMUNEKREDIT 19/06/2039	DKK	3,8%
0.25% DENMARK - BULLETT 15/11/2...	DKK	3,7%

\*) Bemærk at alle positioner er forsinket med 1 måned



# Bemærkninger

Oplysningerne er vejledende og alene til orientering. Alle oplysninger bygger på de informationer, som er kendt ved redaktionens afslutning. PFA Asset Management A/S påtager sig intet ansvar for, at oplysningerne er fuldstændige, korrekte eller ajourførte. Investering i PFA Kapitalforening er målrettet professionelle investorer. De penge, der placeres i afdelingen, kan således enten øges eller mindskes i værdi. Historiske afkast er ingen garanti for fremtidige afkast. Indholdet af denne side skal ikke ses som en opfordring til at købe eller sælge værdipapirer herunder investeringsbeviser.

Afkast er beregnet før adm. omkostninger, men efter transaktionsomkostninger.

PFA Asset Management A/S  
Sundkrogsgade 4  
2100 København Ø  
+45 39 17 50 00