

## RAPPORTERING PR. 23. NOVEMBER 2015



### Gribskov Kommune

Rådhusvej 3  
3200 Helsingør

#### Kontaktinformation:

Per Tillegreen  
Danske Capital  
Parallevej 17  
2800 Kgs. Lyngby  
Tel.: [+45] 4513 9600

# Gribskov Kommune

Rapportering pr. 23. november 2015

---

## Indhold

Rapport	Periode	Side
1. Porteføljeoverblik	År til dato samt seneste måned	1
2. Kapitalværdi og -fordeling	År til dato	2
3. Beholdning og afkast	År til dato	4
4. Beholdningens varighed	År til dato	7
5. Transaktioner	År til dato	8
6. Ordliste, forkortelser og forbehold		18

## Kundeinformation

**Kundekategori:** Professionel

Regnskabsår: 01.01 - 31.12

Valuta: DKK

**Kontonummer:**

3537163038

**Depotnummer:**

3002130149

**Referenceafkast:**

CIBOR 6 Måneder, DKK

Nordea realkredit CM 2

## Gribskov Kommune

Rapportering pr. 23-11-2015

### Porteføljens værdi i DKK\*

	Pr. 31-12-2014		Pr. 23-11-2015	
	Markedsværdi	Porteføljeandel	Markedsværdi	Porteføljeandel
Nordiske obligationer	242.313.799	99,9%	243.705.373	99,9%
Kontanter	198.786	0,1%	249.309	0,1%
Total	242.512.585	100,0%	243.954.682	100,0%

### Afkast i DKK\*

Periode	01-11-2015 til 23-11-2015	01-01-2015 til 23-11-2015
Total incl. urealiseret afkast	67.639	1.442.097

\* Porteføljens værdi er beregnet i henhold til de enkelte papirers officielle kurser på statusdagen inkl. vedhængende renter.

### Afkast i %\*\*

Periode	01-11-2015 til 23-11-2015	01-01-2015 til 23-11-2015
	Portefølje	Portefølje
Nordiske obligationer	0,02%	0,61%
Total incl. alle aktivtyper	0,02%	0,58%
Total før udbytteskat	0,02%	0,58%

\*\* Afkast i procent er porteføljens tidsvægtede afkast på statusdagen. Afkastet fra investeringsforeninger under Danske Invest er beregnet på basis af investeringsafdelingens indre værdi (NAV). Afkast i procent er efter evt. tilbageholdt aktieudbytteskat.

### Referenceafkast i procent

Periode	01-11-2015 til 23-11-2015	01-01-2015 til 23-11-2015
	Referenceafkast	Referenceafkast
CIBOR 6 Måneder, DKK	0,00%	0,07%
Nordea realkredit CM 2	0,31%	-0,38%

Gribskov Kommune  
Rådhusvej 3  
3200 Helsingør

### Kapitalværdi og -fordeling

Eksklusiv uafviklede handler

Aftale om portfolio management	Pr. 31-12-2014		Pr. 23-11-2015	
	DKK	% af kapital	DKK	% af kapital
Nordiske obligationer inkl. vedhængende rente	242.313.799	99,9 %	243.705.373	99,9 %
Kontanter	198.786	0,1 %	249.309	0,1 %
<b>Værdi ialt</b>	<b>242.512.585</b>	<b>100,0 %</b>	<b>243.954.682</b>	<b>100,0 %</b>

Gribskov Kommune  
 Rådhusvej 3  
 3200 Helsingør

Periodens ind- og udbetalinger  
 01-01-2015 - 23-11-2015

Aftale om  
 portfolio management

Indbetalt i perioden:	Værdipapirer	0,00
	Kontant	0,00
Udbetalt i perioden:	Værdipapirer	0,00
	Kontant	0,00
<b>Ind- og udbetalinger i alt</b>		<b>0,00</b>

## Beholdning og afkast

## Gribskov Kommune



for perioden 01-01-2015 til 23-11-2015

Eksklusiv uafviklede handler

23-11-2015

Afst i DKK

Papirnavn Fondskode	Beholdning Udtrukket beh.	Valuta- kurs	Papir- kurs	Kursværdi i DKK	Rente/udbytte Vedh. rente	Realiseret valutaafkast	Realiseret kursafkast	Urealiseret valutaafkast	Urealiseret kursafkast	Total afkast
Noteringsvaluta: DKK										
Konverterbare obligationer										
4 NORDEA ANN 35 DK0002012780	2.867.518,3900 0,0000	100,0000 0,0000	107,0500 0,0000	3.069.678,44 0,00	127.560,92 16.519,40	0,00	-120.466,13	0,00	61.651,65	85.265,84
TK VAR.40C CF 38 DK0004717204	17.313.514,4800 0,0000	100,0000 0,0000	104,7500 0,0000	18.135.906,42 0,00	116.811,57 14.282,90	0,00	33.630,27	0,00	121.194,60	285.919,34
TK VAR.30C CF 38 DK0004717394	11.562.239,3800 0,0000	100,0000 0,0000	105,9750 0,0000	12.253.083,18 0,00	7.097,74 9.538,34	0,00	-5.034,25	0,00	182.105,27	193.707,10
4 RD 22D 2025 DK0009270159	6.396.623,0100 0,0000	100,0000 0,0000	107,4000 0,0000	6.869.973,11 0,00	267.521,05 36.850,11	0,00	-282.208,88	0,00	81.556,94	103.719,22
4 RD 23D 2035 DK0009270233	1.936.334,0400 0,0000	100,0000 0,0000	106,6300 0,0000	2.064.712,99 0,00	88.432,53 11.154,97	0,00	-121.875,54	0,00	3.988,85	-18.299,19
RD VAR 83D5CF38 DK0009273682	11.020.071,3700 0,0000	100,0000 0,0000	104,6500 0,0000	11.532.504,69 0,00	7.525,00 16.982,29	0,00	-2.375,65	0,00	-46.835,30	-24.703,66
4 RD 23D 2038 DK0009274300	2.853.345,3800 0,0000	100,0000 0,0000	105,9500 0,0000	3.023.119,43 0,00	128.270,30 16.437,75	0,00	-135.459,21	0,00	14.495,00	23.743,84
4 RD 27S.S.OA 44 DK0009285421	5.237.817,1100 0,0000	100,0000 0,0000	104,3000 0,0000	5.463.043,25 0,00	252.945,28 30.174,38	0,00	-236.924,16	0,00	28.022,33	74.217,83
3,5 RD 23S.SA 44 DK0009288441	9.319.114,7600 0,0000	100,0000 0,0000	103,0300 0,0000	9.601.483,94 0,00	149.075,10 46.975,43	0,00	-112.022,13	0,00	49.391,31	133.419,71
3,5 RD 27S.SA 44 DK0009289258	22.019.333,3900 0,0000	100,0000 0,0000	102,0710 0,0000	22.475.353,78 0,00	647.555,35 110.994,19	0,00	-509.144,18	0,00	-258.590,38	-9.185,02
4 NYK 02 D 2025 DK0009757106	5.914.470,9200 0,0000	100,0000 0,0000	107,1500 0,0000	6.337.355,59 0,00	228.206,09 34.072,50	0,00	-184.648,51	0,00	44.358,53	121.988,61
NYK VAR.33DCF38 DK0009761488	23.697.063,9800 0,0000	100,0000 0,0000	105,3000 0,0000	24.953.008,37 0,00	213.149,35 28.200,73	0,00	-48.444,13	0,00	-5.213,35	187.692,60
NYK VAR.47DCF617 DK0009764664	0,0000 0,0000	0,0000 0,0000	0,0000 0,0000	0,00 0,00	94.811,90 0,00	0,00	-96.008,15	0,00	0,00	-1.196,25
NYK VAR.21ECF641 DK0009771362	7.273.259,4700 0,0000	100,0000 0,0000	105,7000 0,0000	7.687.835,26 0,00	42.401,33 4.407,91	0,00	-14.100,43	0,00	32.729,66	65.438,47

## Beholdning og afkast

Gribskov Kommune



for perioden 01-01-2015 til 23-11-2015

Eksklusiv uafviklede handler

23-11-2015

Afst i DKK

Papirnavn Fondskode	Beholdning Udtrukket beh.	Valuta- kurs	Papir- kurs	Kursværdi i DKK	Rente/udbytte Vedh. rente	Realiseret valutaafkast	Realiseret kursafkast	Urealiseret valutaafkast	Urealiseret kursafkast	Total afkast
NYK VAR.21HCF623	45.521.191,6800	100,0000	101,7430	46.314.626,05	257.349,09	0,00	7.639,87	0,00	-444.742,05	-152.165,27
DK0009789224	0,0000	0,0000	0,0000	0,00	27.587,82					
<b>Total: Konverterbare obligationer</b>				<b>179.781.684,50</b>	<b>2.628.712,60</b>	<b>0,00</b>	<b>-1.827.441,21</b>	<b>0,00</b>	<b>-135.886,94</b>	<b>1.069.563,17</b>
				<b>0,00</b>	<b>404.178,72</b>					
<b>Inkonverterbare obligationer</b>										
2 NORDEA APR 18	17.800.000,0000	100,0000	104,7810	18.651.018,00	83.879,45	0,00	0,00	0,00	-87.042,00	226.389,36
DK0002028356	0,0000	0,0000	0,0000	0,00	229.551,91					
2 RD 10T AP 2018	0,0000	0,0000	0,0000	0,00	32.038,09	0,00	-2.728,00	0,00	0,00	29.310,09
DK0009286585	0,0000	0,0000	0,0000	0,00	0,00					
2 RD 10T JA 2017	11.400.000,0000	100,0000	102,3150	11.663.910,00	70.575,35	0,00	36.026,35	0,00	-125.336,35	184.903,71
DK0009287476	0,0000	0,0000	0,0000	0,00	203.638,36					
2 NYK12H B OK 16	0,0000	0,0000	0,0000	0,00	12.821,92	0,00	16.458,00	0,00	0,00	29.279,92
DK0009785073	0,0000	0,0000	0,0000	0,00	0,00					
NYK VAR.F3H 17RT	32.797.388,5700	100,0000	99,9200	32.771.150,66	-3,55	0,00	-46,18	0,00	-28.516,73	-28.325,56
DK0009797912	0,0000	0,0000	0,0000	0,00	240,90					
<b>Total: Inkonverterbare obligationer</b>				<b>63.086.078,66</b>	<b>199.311,26</b>	<b>0,00</b>	<b>49.710,17</b>	<b>0,00</b>	<b>-240.895,08</b>	<b>441.557,52</b>
				<b>0,00</b>	<b>433.431,17</b>					
<b>Total: DKK</b>				<b>242.867.763,16</b>	<b>2.828.023,86</b>	<b>0,00</b>	<b>-1.777.731,04</b>	<b>0,00</b>	<b>-376.782,02</b>	<b>1.511.120,69</b>
				<b>0,00</b>	<b>837.609,89</b>					
<b>Noteringsvaluta: DKK</b>										
<b>Bankkonti</b>										
GRÆSTED-GILLELEJE	249.308,8700	100,0000	1,0000	249.308,87	650,62	0,00	0,00	0,00	0,00	650,62
3537163038	0,0000	0,0000	0,0000	0,00	0,00					
<b>Total: Bankkonti</b>				<b>249.308,87</b>	<b>650,62</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>650,62</b>
				<b>0,00</b>	<b>0,00</b>					
<b>Total: DKK</b>				<b>249.308,87</b>	<b>650,62</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>650,62</b>
				<b>0,00</b>	<b>0,00</b>					

## Beholdning og afkast

Gribskov Kommune



for perioden 01-01-2015 til 23-11-2015

Eksklusiv uafviklede handler

23-11-2015

Afkast i DKK

Papirnavn Fondskode	Beholdning Udtrukket beh.	Valuta- kurs	Papir- kurs	Kursværdi i DKK	Rente/udbytte Vedh. rente	Realiseret valutaafkast	Realiseret kursafkast	Urealiseret valutaafkast	Urealiseret kursafkast	Total afkast
Noteringsvaluta: DKK										
Gebyrer										
Depotgebyr					-1.742,95					-1.742,95
PM-gebyr					-67.931,20					-67.931,20
<b>Total: Gebyrer</b>					<b>-69.674,15</b>					<b>-69.674,15</b>
<b>Total: DKK</b>					<b>-69.674,15</b>					<b>-69.674,15</b>
<b>Total for porteføljen</b>				<b>243.117.072,03</b>	<b>2.759.000,33</b>	<b>0,00</b>	<b>-1.777.731,04</b>	<b>0,00</b>	<b>-376.782,02</b>	<b>1.442.097,16</b>
				<b>0,00</b>	<b>837.609,89</b>					



Beholdningens varighed  
pr. 23-11-2015

Gribskov Kommune



Eksklusiv uafviklede handler

Værdi i DKK

Fondskode	Papirnavn	Valuta	Beholdning Evt. udtrukne	Papir- kurs	Valuta- kurs	Eff. rente	DC varighed	Ukorrigeret varighed	Risikoværdi	Vedh. rente	Samlet risikoværdi
<b>Nordiske obligationer</b>											
<b>Konverterbare obligationer</b>											
DK0002012780	4 NORDEA ANN 35	DKK	2.867.518,39	107,050	100,000	1,76	0,93	8,67	3.069.678	16.519	3.086.198
DK0004717204	TK VAR.40C CF 38	DKK	17.313.514,48	104,750	100,000	0,34	1,03	0,10	18.135.906	14.283	18.150.189
DK0004717394	TK VAR.30C CF 38	DKK	11.562.239,38	105,975	100,000	0,28	1,08	0,10	12.253.083	9.538	12.262.622
DK0009270159	4 RD 22D 2025	DKK	6.396.623,01	107,400	100,000	1,23	1,26	4,28	6.869.973	36.850	6.906.823
DK0009270233	4 RD 23D 2035	DKK	1.936.334,04	106,630	100,000	1,75	0,91	8,55	2.064.713	11.155	2.075.868
DK0009273682	RD VAR 83D5CF38	DKK	11.020.071,37	104,650	100,000	0,63	1,36	0,10	11.532.505	16.982	11.549.487
DK0009274300	4 RD 23D 2038	DKK	2.853.345,38	105,950	100,000	1,69	0,73	8,81	3.023.119	16.438	3.039.557
DK0009285421	4 RD 27S.S.OA 44	DKK	5.237.817,11	104,300	100,000	1,80	0,74	12,01	5.463.043	30.174	5.493.218
DK0009288441	3,5 RD 23S.SA 44	DKK	9.319.114,76	103,030	100,000	1,91	3,29	11,43	9.601.484	46.975	9.648.459
DK0009289258	3,5 RD 27S.SA 44	DKK	22.019.333,39	102,071	100,000	1,98	4,08	12,64	22.475.354	110.994	22.586.348
DK0009757106	4 NYK 02 D 2025	DKK	5.914.470,92	107,150	100,000	1,16	1,16	4,27	6.337.356	34.073	6.371.428
DK0009761488	NYK VAR.33DCF38	DKK	23.697.063,98	105,300	100,000	0,57	1,19	0,10	24.953.008	28.201	24.981.209
DK0009771362	NYK VAR.21ECF641	DKK	7.273.259,47	105,700	100,000	0,21	1,26	0,10	7.687.835	4.408	7.692.243
DK0009789224	NYK VAR.21HCF623	DKK	45.521.191,68	101,743	100,000	0,19	0,14	0,10	46.314.626	27.588	46.342.214
<b>Konverterbare obligationer</b>			<b>172.931.897,36</b>			<b>1,81</b>	<b>1,36</b>	<b>3,34</b>	<b>179.781.685</b>	<b>404.179</b>	<b>180.185.863</b>
<b>Inkonverterbare obligationer</b>											
DK0002028356	2 NORDEA APR 18	DKK	17.800.000,00	104,781	100,000	0,12	2,30	2,33	18.651.018	229.552	18.880.570
DK0009287476	2 RD 10T JA 2017	DKK	11.400.000,00	102,315	100,000	-0,08	1,09	1,08	11.663.910	203.638	11.867.548
DK0009797912	NYK VAR.F3H 17RT	DKK	32.797.388,57	99,920	100,000	0,06	0,10	0,10	32.771.151	241	32.771.392
<b>Inkonverterbare obligationer</b>			<b>61.997.388,57</b>			<b>0,07</b>	<b>0,94</b>	<b>0,94</b>	<b>63.086.079</b>	<b>433.431</b>	<b>63.519.510</b>
<b>Bankkonti</b>											
3537163038	GRÆSTED-GILLELEJE	DKK	249.308,87	1,000	100,000	0,00	0,00	0,00	249.309	0	249.309
<b>Bankkonti</b>			<b>249.308,87</b>			<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>249.309</b>	<b>0</b>	<b>249.309</b>
<b>Total</b>			<b>235.178.594,80</b>			<b>1,65</b>	<b>1,25</b>	<b>2,71</b>	<b>243.117.072</b>	<b>837.610</b>	<b>243.954.682</b>
<b>Total for porteføljen</b>			<b>235.178.594,80</b>			<b>1,65</b>	<b>1,25</b>	<b>2,71</b>	<b>243.117.072</b>	<b>837.610</b>	<b>243.954.682</b>

Transaktioner  
i perioden 01-01-2015 til 23-11-2015

Gribskov Kommune



Værdi i DKK

Valørdato	Fondskode	Papirnavn	Nominal/stk.	Valuta	Valutakurs	Handelskurs	Kursværdi	Kurtage	Øvrige omk.	Renter	Afregningsbeløb
Depot nr. 3002130149											
<b>Køb</b>											
05-01-2015	DK0002028356	2 NORDEA APR 18	17.800.000,00	DKK	100,00	105,2700	18.738.060,00			272.120,55	19.010.180,55
08-01-2015	DK0009287476	2 RD 10T JA 2017	1.900.000,00	DKK	100,00	103,5200	1.966.880,00			728,77	1.967.608,77
30-01-2015	DK0004717204	TK VAR.40C CF 38	23.000.000,00	DKK	100,00	104,0500	23.931.500,00			18.372,14	23.949.872,14
01-04-2015	DK0009289258	3,5 RD 27S.SA 44	19.500.000,00	DKK	100,00	103,3250	20.148.375,00				20.148.375,00
13-05-2015	DK0009288441	3,5 RD 23S.SA 44	13.800.000,00	DKK	100,00	102,5000	14.145.000,00			55.730,77	14.200.730,77
02-07-2015	DK0009797912	NYK VAR.F3H 17RT	26.500.000,00	DKK	100,00	100,0450	26.511.925,00				26.511.925,00
06-07-2015	DK0009287476	2 RD 10T JA 2017	1.400.000,00	DKK	100,00	103,1100	1.443.540,00			14.268,49	1.457.808,49
24-08-2015	DK0004717394	TK VAR.30C CF 38	12.000.000,00	DKK	100,00	104,4000	12.528.000,00			10.086,26	12.538.086,26
03-09-2015	DK0009273682	RD VAR 83D5CF38	11.500.000,00	DKK	100,00	105,0750	12.083.625,00			17.200,00	12.100.825,00
05-10-2015	DK0009797912	NYK VAR.F3H 17RT	6.400.000,00	DKK	100,00	99,8500	6.390.400,00			3,55	6.390.403,55
13-10-2015	DK0009287476	2 RD 10T JA 2017	300.000,00	DKK	100,00	102,4000	307.200,00			4.684,93	311.884,93
13-10-2015	DK0009287476	2 RD 10T JA 2017	100.000,00	DKK	100,00	102,4000	102.400,00			1.561,64	103.961,64
<b>Total: Køb</b>							<b>138.296.905,00</b>			<b>394.757,10</b>	<b>138.691.662,10</b>
<b>Salg</b>											
30-01-2015	DK0009287476	2 RD 10T JA 2017	15.700.000,00	DKK	100,00	103,8000	16.296.600,00			24.947,95	16.321.547,95
30-01-2015	DK0009785073	2 NYK12H B OK 16	7.800.000,00	DKK	100,00	103,3400	8.060.520,00			51.715,07	8.112.235,07
13-05-2015	DK0009286585	2 RD 10T AP 2018	4.400.000,00	DKK	100,00	105,2000	4.628.800,00			10.098,36	4.638.898,36
13-05-2015	DK0009287476	2 RD 10T JA 2017	9.000.000,00	DKK	100,00	103,3800	9.304.200,00			65.095,89	9.369.295,89
24-08-2015	DK0009764664	NYK VAR.47DCF617	12.600.000,00	DKK	100,00	100,7225	12.691.040,70			6.842,83	12.697.883,53
03-09-2015	DK0009764664	NYK VAR.47DCF617	8.213.735,53	DKK	100,00	100,6000	8.263.017,94			5.286,79	8.268.304,73
03-09-2015	DK0009789224	NYK VAR.21HCF623	3.460.000,00	DKK	100,00	102,9500	3.562.070,00			2.532,12	3.564.602,12

Transaktioner  
i perioden 01-01-2015 til 23-11-2015

Gribskov Kommune



										Værdi i DKK	
Valørdato	Fondskode	Papirnavn	Nominal/stk.	Valuta	Valutakurs	Handelskurs	Kursværdi	Kurtage	Øvrige omk.	Renter	Afregningsbeløb
Total: Salg							62.806.248,64			166.519,01	62.972.767,65
Transaktionsomkostninger											
Køb							138.296.905,00	0,00	0,00	394.757,10	138.691.662,10
Salg							62.806.248,64	0,00	0,00	166.519,01	62.972.767,65

Transaktioner  
i perioden 01-01-2015 til 23-11-2015

Gribskov Kommune



Værdi i DKK

Valørdato	Fondskode	Papirnavn	Nominal/stk.	Valuta	Valutakurs	Kursværdi	Kurtage	Øvrige omk.	Renter	Afregningsbeløb
Depot nr.	3002130149									
<b>Rente</b>										
02-01-2015	DK0002012780	4 NORDEA ANN 35	18.516,87	DKK	100,00	18.516,87				18.516,87
02-01-2015	DK0002012780	4 NORDEA ANN 35	53.260,11	DKK	100,00	53.260,11				53.260,11
02-01-2015	DK0009270159	4 RD 22D 2025	110.041,15	DKK	100,00	110.041,15				110.041,15
02-01-2015	DK0009270159	4 RD 22D 2025	35.372,18	DKK	100,00	35.372,18				35.372,18
02-01-2015	DK0009270233	4 RD 23D 2035	14.768,71	DKK	100,00	14.768,71				14.768,71
02-01-2015	DK0009270233	4 RD 23D 2035	38.335,25	DKK	100,00	38.335,25				38.335,25
02-01-2015	DK0009274300	4 RD 23D 2038	17.802,47	DKK	100,00	17.802,47				17.802,47
02-01-2015	DK0009274300	4 RD 23D 2038	53.424,89	DKK	100,00	53.424,89				53.424,89
02-01-2015	DK0009285421	4 RD 27S.S.OA 44	51.693,77	DKK	100,00	51.693,77				51.693,77
02-01-2015	DK0009285421	4 RD 27S.S.OA 44	115.306,23	DKK	100,00	115.306,23				115.306,23
02-01-2015	DK0009287476	2 RD 10T JA 2017	648.000,00	DKK	100,00	648.000,00				648.000,00
02-01-2015	DK0009289258	3,5 RD 27S.SA 44	160.951,87	DKK	100,00	160.951,87				160.951,87
02-01-2015	DK0009289258	3,5 RD 27S.SA 44	19.347,86	DKK	100,00	19.347,86				19.347,86
02-01-2015	DK0009757106	4 NYK 02 D 2025	87.996,04	DKK	100,00	87.996,04				87.996,04
02-01-2015	DK0009757106	4 NYK 02 D 2025	20.895,93	DKK	100,00	20.895,93				20.895,93
02-01-2015	DK0009761488	NYK VAR.33DCF38	89.862,54	DKK	100,00	89.862,54				89.862,54
02-01-2015	DK0009761488	NYK VAR.33DCF38	2.435,82	DKK	100,00	2.435,82				2.435,82
02-01-2015	DK0009764664	NYK VAR.47DCF617	29,51	DKK	100,00	29,51				29,51
02-01-2015	DK0009764664	NYK VAR.47DCF617	47.302,72	DKK	100,00	47.302,72				47.302,72
02-01-2015	DK0009771362	NYK VAR.21ECF641	19.851,73	DKK	100,00	19.851,73				19.851,73
02-01-2015	DK0009771362	NYK VAR.21ECF641	637,51	DKK	100,00	637,51				637,51

Transaktioner  
i perioden 01-01-2015 til 23-11-2015

Gribskov Kommune



Værdi i DKK

Valørdato	Fondskode	Papirnavn	Nominal/stk. Valuta	Valutakurs	Kursværdi	Kurtage	Øvrige omk.	Renter	Afregningsbeløb
02-01-2015	DK0009789224	NYK VAR.21HCF623	2,72 DKK	100,00	2,72				2,72
02-01-2015	DK0009789224	NYK VAR.21HCF623	117.411,46 DKK	100,00	117.411,46				117.411,46
01-04-2015	DK0002012780	4 NORDEA ANN 35	10.943,00 DKK	100,00	10.943,00				10.943,00
01-04-2015	DK0002012780	4 NORDEA ANN 35	42.317,11 DKK	100,00	42.317,11				42.317,11
01-04-2015	DK0002028356	2 NORDEA APR 18	356.000,00 DKK	100,00	356.000,00				356.000,00
01-04-2015	DK0004717204	TK VAR.40C CF 38	5.501,29 DKK	100,00	5.501,29				5.501,29
01-04-2015	DK0004717204	TK VAR.40C CF 38	51.515,71 DKK	100,00	51.515,71				51.515,71
01-04-2015	DK0009270159	4 RD 22D 2025	87.532,15 DKK	100,00	87.532,15				87.532,15
01-04-2015	DK0009270159	4 RD 22D 2025	22.509,00 DKK	100,00	22.509,00				22.509,00
01-04-2015	DK0009270233	4 RD 23D 2035	9.647,22 DKK	100,00	9.647,22				9.647,22
01-04-2015	DK0009270233	4 RD 23D 2035	28.688,03 DKK	100,00	28.688,03				28.688,03
01-04-2015	DK0009274300	4 RD 23D 2038	42.190,64 DKK	100,00	42.190,64				42.190,64
01-04-2015	DK0009274300	4 RD 23D 2038	11.234,25 DKK	100,00	11.234,25				11.234,25
01-04-2015	DK0009285421	4 RD 27S.S.OA 44	35.148,28 DKK	100,00	35.148,28				35.148,28
01-04-2015	DK0009285421	4 RD 27S.S.OA 44	80.157,95 DKK	100,00	80.157,95				80.157,95
01-04-2015	DK0009286585	2 RD 10T AP 2018	88.000,00 DKK	100,00	88.000,00				88.000,00
01-04-2015	DK0009289258	3,5 RD 27S.SA 44	115.739,59 DKK	100,00	115.739,59				115.739,59
01-04-2015	DK0009289258	3,5 RD 27S.SA 44	45.212,28 DKK	100,00	45.212,28				45.212,28
01-04-2015	DK0009757106	4 NYK 02 D 2025	12.283,11 DKK	100,00	12.283,11				12.283,11
01-04-2015	DK0009757106	4 NYK 02 D 2025	75.712,93 DKK	100,00	75.712,93				75.712,93
01-04-2015	DK0009761488	NYK VAR.33DCF38	2.172,50 DKK	100,00	2.172,50				2.172,50
01-04-2015	DK0009761488	NYK VAR.33DCF38	79.844,69 DKK	100,00	79.844,69				79.844,69
01-04-2015	DK0009764664	NYK VAR.47DCF617	27,13 DKK	100,00	27,13				27,13

Transaktioner  
i perioden 01-01-2015 til 23-11-2015

Gribskov Kommune



Værdi i DKK

Valørdato	Fondskode	Papirnavn	Nominal/stk.	Valuta	Valutakurs	Kursværdi	Kurtage	Øvrige omk.	Renter	Afregningsbeløb
01-04-2015	DK0009764664	NYK VAR.47DCF617	41.070,33	DKK	100,00	41.070,33				41.070,33
01-04-2015	DK0009771362	NYK VAR.21ECF641	541,81	DKK	100,00	541,81				541,81
01-04-2015	DK0009771362	NYK VAR.21ECF641	16.843,47	DKK	100,00	16.843,47				16.843,47
01-04-2015	DK0009789224	NYK VAR.21HCF623	102.820,38	DKK	100,00	102.820,38				102.820,38
01-04-2015	DK0009789224	NYK VAR.21HCF623	3,44	DKK	100,00	3,44				3,44
01-07-2015	DK0002012780	4 NORDEA ANN 35	11.113,61	DKK	100,00	11.113,61				11.113,61
01-07-2015	DK0002012780	4 NORDEA ANN 35	31.203,51	DKK	100,00	31.203,51				31.203,51
01-07-2015	DK0004717204	TK VAR.40C CF 38	46.136,76	DKK	100,00	46.136,76				46.136,76
01-07-2015	DK0004717204	TK VAR.40C CF 38	5.378,95	DKK	100,00	5.378,95				5.378,95
01-07-2015	DK0009270159	4 RD 22D 2025	19.164,98	DKK	100,00	19.164,98				19.164,98
01-07-2015	DK0009270159	4 RD 22D 2025	68.367,17	DKK	100,00	68.367,17				68.367,17
01-07-2015	DK0009270233	4 RD 23D 2035	7.856,00	DKK	100,00	7.856,00				7.856,00
01-07-2015	DK0009270233	4 RD 23D 2035	20.832,03	DKK	100,00	20.832,03				20.832,03
01-07-2015	DK0009274300	4 RD 23D 2038	10.310,08	DKK	100,00	10.310,08				10.310,08
01-07-2015	DK0009274300	4 RD 23D 2038	31.880,56	DKK	100,00	31.880,56				31.880,56
01-07-2015	DK0009285421	4 RD 27S.S.OA 44	55.665,89	DKK	100,00	55.665,89				55.665,89
01-07-2015	DK0009285421	4 RD 27S.S.OA 44	24.492,06	DKK	100,00	24.492,06				24.492,06
01-07-2015	DK0009288441	3,5 RD 23S.SA 44	36.694,13	DKK	100,00	36.694,13				36.694,13
01-07-2015	DK0009288441	3,5 RD 23S.SA 44	84.055,87	DKK	100,00	84.055,87				84.055,87
01-07-2015	DK0009289258	3,5 RD 27S.SA 44	198.279,10	DKK	100,00	198.279,10				198.279,10
01-07-2015	DK0009289258	3,5 RD 27S.SA 44	88.085,49	DKK	100,00	88.085,49				88.085,49
01-07-2015	DK0009757106	4 NYK 02 D 2025	12.399,42	DKK	100,00	12.399,42				12.399,42
01-07-2015	DK0009757106	4 NYK 02 D 2025	63.313,51	DKK	100,00	63.313,51				63.313,51

Transaktioner  
i perioden 01-01-2015 til 23-11-2015

Gribskov Kommune



Værdi i DKK

Valørdato	Fondskode	Papirnavn	Nominal/stk.	Valuta	Valutakurs	Kursværdi	Kurtage	Øvrige omk.	Renter	Afregningsbeløb
01-07-2015	DK0009761488	NYK VAR.33DCF38	75.770,18	DKK	100,00	75.770,18				75.770,18
01-07-2015	DK0009761488	NYK VAR.33DCF38	4.074,51	DKK	100,00	4.074,51				4.074,51
01-07-2015	DK0009764664	NYK VAR.47DCF617	25,65	DKK	100,00	25,65				25,65
01-07-2015	DK0009764664	NYK VAR.47DCF617	41.044,69	DKK	100,00	41.044,69				41.044,69
01-07-2015	DK0009771362	NYK VAR.21ECF641	15.860,08	DKK	100,00	15.860,08				15.860,08
01-07-2015	DK0009771362	NYK VAR.21ECF641	983,39	DKK	100,00	983,39				983,39
01-07-2015	DK0009789224	NYK VAR.21HCF623	102.815,70	DKK	100,00	102.815,70				102.815,70
01-07-2015	DK0009789224	NYK VAR.21HCF623	4,68	DKK	100,00	4,68				4,68
01-10-2015	DK0002012780	4 NORDEA ANN 35	2.528,32	DKK	100,00	2.528,32				2.528,32
01-10-2015	DK0002012780	4 NORDEA ANN 35	28.675,18	DKK	100,00	28.675,18				28.675,18
01-10-2015	DK0004717204	TK VAR.40C CF 38	1.858,05	DKK	100,00	1.858,05				1.858,05
01-10-2015	DK0004717204	TK VAR.40C CF 38	24.792,95	DKK	100,00	24.792,95				24.792,95
01-10-2015	DK0004717394	TK VAR.30C CF 38	626,87	DKK	100,00	626,87				626,87
01-10-2015	DK0004717394	TK VAR.30C CF 38	16.557,13	DKK	100,00	16.557,13				16.557,13
01-10-2015	DK0009270159	4 RD 22D 2025	4.400,94	DKK	100,00	4.400,94				4.400,94
01-10-2015	DK0009270159	4 RD 22D 2025	63.966,23	DKK	100,00	63.966,23				63.966,23
01-10-2015	DK0009270233	4 RD 23D 2035	19.363,34	DKK	100,00	19.363,34				19.363,34
01-10-2015	DK0009270233	4 RD 23D 2035	1.468,69	DKK	100,00	1.468,69				1.468,69
01-10-2015	DK0009273682	RD VAR 83D5CF38	23.693,15	DKK	100,00	23.693,15				23.693,15
01-10-2015	DK0009273682	RD VAR 83D5CF38	1.031,85	DKK	100,00	1.031,85				1.031,85
01-10-2015	DK0009274300	4 RD 23D 2038	3.347,11	DKK	100,00	3.347,11				3.347,11
01-10-2015	DK0009274300	4 RD 23D 2038	28.533,45	DKK	100,00	28.533,45				28.533,45
01-10-2015	DK0009285421	4 RD 27S.S.OA 44	3.287,72	DKK	100,00	3.287,72				3.287,72

Transaktioner  
i perioden 01-01-2015 til 23-11-2015

Gribskov Kommune



Værdi i DKK

Valørdato	Fondskode	Papirnavn	Nominal/stk.	Valuta	Valutakurs	Kursværdi	Kurtage	Øvrige omk.	Renter	Afregningsbeløb
01-10-2015	DK0009285421	4 RD 27S.S.OA 44	52.378,17	DKK	100,00	52.378,17				52.378,17
01-10-2015	DK0009288441	3,5 RD 23S.SA 44	2.513,62	DKK	100,00	2.513,62				2.513,62
01-10-2015	DK0009288441	3,5 RD 23S.SA 44	81.542,25	DKK	100,00	81.542,25				81.542,25
01-10-2015	DK0009289258	3,5 RD 27S.SA 44	5.609,94	DKK	100,00	5.609,94				5.609,94
01-10-2015	DK0009289258	3,5 RD 27S.SA 44	192.669,17	DKK	100,00	192.669,17				192.669,17
01-10-2015	DK0009757106	4 NYK 02 D 2025	4.168,80	DKK	100,00	4.168,80				4.168,80
01-10-2015	DK0009757106	4 NYK 02 D 2025	59.144,71	DKK	100,00	59.144,71				59.144,71
01-10-2015	DK0009761488	NYK VAR.33DCF38	48.952,21	DKK	100,00	48.952,21				48.952,21
01-10-2015	DK0009761488	NYK VAR.33DCF38	1.332,02	DKK	100,00	1.332,02				1.332,02
01-10-2015	DK0009771362	NYK VAR.21ECF641	298,41	DKK	100,00	298,41				298,41
01-10-2015	DK0009771362	NYK VAR.21ECF641	7.651,47	DKK	100,00	7.651,47				7.651,47
01-10-2015	DK0009789224	NYK VAR.21HCF623	47.888,29	DKK	100,00	47.888,29				47.888,29
01-10-2015	DK0009789224	NYK VAR.21HCF623	8,23	DKK	100,00	8,23				8,23
<b>Total: Rente</b>						<b>4.870.999,90</b>				<b>4.870.999,90</b>
<b>Udtrækning</b>										
02-01-2015	DK0002012780	4 NORDEA ANN 35	1.851.686,96	DKK	100,00	1.851.686,96				1.851.686,96
02-01-2015	DK0009270159	4 RD 22D 2025	3.537.217,59	DKK	100,00	3.537.217,59				3.537.217,59
02-01-2015	DK0009270233	4 RD 23D 2035	1.476.870,67	DKK	100,00	1.476.870,67				1.476.870,67
02-01-2015	DK0009274300	4 RD 23D 2038	1.780.246,73	DKK	100,00	1.780.246,73				1.780.246,73
02-01-2015	DK0009285421	4 RD 27S.S.OA 44	5.169.376,58	DKK	100,00	5.169.376,58				5.169.376,58
02-01-2015	DK0009289258	3,5 RD 27S.SA 44	2.211.184,55	DKK	100,00	2.211.184,55				2.211.184,55
02-01-2015	DK0009757106	4 NYK 02 D 2025	2.089.592,95	DKK	100,00	2.089.592,95				2.089.592,95
02-01-2015	DK0009761488	NYK VAR.33DCF38	714.213,38	DKK	100,00	736.353,99				736.353,99



Transaktioner  
i perioden 01-01-2015 til 23-11-2015

Gribskov Kommune



Værdi i DKK

Valørdato	Fondskode	Papirnavn	Nominal/stk.	Valuta	Valutakurs	Kursværdi	Kurtage	Øvrige omk.	Renter	Afregningsbeløb
02-01-2015	DK0009764664	NYK VAR.47DCF617	13.002,53	DKK	100,00	13.002,53				13.002,53
02-01-2015	DK0009771362	NYK VAR.21ECF641	266.019,04	DKK	100,00	275.356,31				275.356,31
02-01-2015	DK0009789224	NYK VAR.21HCF623	1.134,76	DKK	100,00	1.134,76				1.134,76
01-04-2015	DK0002012780	4 NORDEA ANN 35	1.094.299,58	DKK	100,00	1.094.299,58				1.094.299,58
01-04-2015	DK0004717204	TK VAR.40C CF 38	2.219.158,34	DKK	100,00	2.325.234,11				2.325.234,11
01-04-2015	DK0009270159	4 RD 22D 2025	2.250.899,90	DKK	100,00	2.250.899,90				2.250.899,90
01-04-2015	DK0009270233	4 RD 23D 2035	964.721,64	DKK	100,00	964.721,64				964.721,64
01-04-2015	DK0009274300	4 RD 23D 2038	1.123.425,42	DKK	100,00	1.123.425,42				1.123.425,42
01-04-2015	DK0009285421	4 RD 27S.S.OA 44	3.514.828,43	DKK	100,00	3.514.828,43				3.514.828,43
01-04-2015	DK0009289258	3,5 RD 27S.SA 44	5.167.117,38	DKK	100,00	5.167.117,38				5.167.117,38
01-04-2015	DK0009757106	4 NYK 02 D 2025	1.228.310,71	DKK	100,00	1.228.310,71				1.228.310,71
01-04-2015	DK0009761488	NYK VAR.33DCF38	697.934,96	DKK	100,00	719.361,56				719.361,56
01-04-2015	DK0009764664	NYK VAR.47DCF617	13.759,29	DKK	100,00	13.759,29				13.759,29
01-04-2015	DK0009771362	NYK VAR.21ECF641	258.156,44	DKK	100,00	267.114,47				267.114,47
01-04-2015	DK0009789224	NYK VAR.21HCF623	1.641,34	DKK	100,00	1.641,34				1.641,34
01-07-2015	DK0002012780	4 NORDEA ANN 35	1.111.360,81	DKK	100,00	1.111.360,81				1.111.360,81
01-07-2015	DK0004717204	TK VAR.40C CF 38	2.169.805,71	DKK	100,00	2.270.701,68				2.270.701,68
01-07-2015	DK0009270159	4 RD 22D 2025	1.916.497,88	DKK	100,00	1.916.497,88				1.916.497,88
01-07-2015	DK0009270233	4 RD 23D 2035	785.600,19	DKK	100,00	785.600,19				785.600,19
01-07-2015	DK0009274300	4 RD 23D 2038	1.031.007,64	DKK	100,00	1.031.007,64				1.031.007,64
01-07-2015	DK0009285421	4 RD 27S.S.OA 44	2.449.205,59	DKK	100,00	2.449.205,59				2.449.205,59
01-07-2015	DK0009288441	3,5 RD 23S.SA 44	4.193.614,75	DKK	100,00	4.193.614,75				4.193.614,75
01-07-2015	DK0009289258	3,5 RD 27S.SA 44	10.066.913,33	DKK	100,00	10.066.913,33				10.066.913,33

Transaktioner  
i perioden 01-01-2015 til 23-11-2015

Gribskov Kommune



Værdi i DKK

Valørdato	Fondskode	Papirnavn	Nominal/stk.	Valuta	Valutakurs	Kursværdi	Kurtage	Øvrige omk.	Renter	Afregningsbeløb
01-07-2015	DK0009757106	4 NYK 02 D 2025	1.239.942,02	DKK	100,00	1.239.942,02				1.239.942,02
01-07-2015	DK0009761488	NYK VAR.33DCF38	1.308.975,02	DKK	100,00	1.361.464,92				1.361.464,92
01-07-2015	DK0009764664	NYK VAR.47DCF617	13.004,58	DKK	100,00	13.004,58				13.004,58
01-07-2015	DK0009771362	NYK VAR.21ECF641	468.558,71	DKK	100,00	488.191,32				488.191,32
01-07-2015	DK0009789224	NYK VAR.21HCF623	2.228,95	DKK	100,00	2.228,95				2.228,95
01-10-2015	DK0002012780	4 NORDEA ANN 35	252.832,12	DKK	100,00	252.832,12				252.832,12
01-10-2015	DK0004717204	TK VAR.40C CF 38	1.297.521,47	DKK	100,00	1.354.482,66				1.354.482,66
01-10-2015	DK0004717394	TK VAR.30C CF 38	437.760,62	DKK	100,00	451.987,84				451.987,84
01-10-2015	DK0009270159	4 RD 22D 2025	440.094,20	DKK	100,00	440.094,20				440.094,20
01-10-2015	DK0009270233	4 RD 23D 2035	146.868,98	DKK	100,00	146.868,98				146.868,98
01-10-2015	DK0009273682	RD VAR 83D5CF38	479.928,63	DKK	100,00	501.909,36				501.909,36
01-10-2015	DK0009274300	4 RD 23D 2038	334.710,77	DKK	100,00	334.710,77				334.710,77
01-10-2015	DK0009285421	4 RD 27S.S.OA 44	328.772,29	DKK	100,00	328.772,29				328.772,29
01-10-2015	DK0009288441	3,5 RD 23S.SA 44	287.270,49	DKK	100,00	287.270,49				287.270,49
01-10-2015	DK0009289258	3,5 RD 27S.SA 44	641.135,49	DKK	100,00	641.135,49				641.135,49
01-10-2015	DK0009757106	4 NYK 02 D 2025	416.880,19	DKK	100,00	416.880,19				416.880,19
01-10-2015	DK0009761488	NYK VAR.33DCF38	644.812,66	DKK	100,00	663.576,71				663.576,71
01-10-2015	DK0009771362	NYK VAR.21ECF641	283.658,10	DKK	100,00	294.011,62				294.011,62
01-10-2015	DK0009789224	NYK VAR.21HCF623	7.825,86	DKK	100,00	7.825,86				7.825,86
01-10-2015	DK0009797912	NYK VAR.F3H 17RT	102.611,43	DKK	100,00	102.611,43				102.611,43
<b>Total: Udtrækning</b>						<b>70.967.441,12</b>				<b>70.967.441,12</b>

Transaktioner  
i perioden 01-01-2015 til 23-11-2015

Gribskov Kommune



Værdi i DKK

Valørdato	Nominel/stk. Valuta	Valutakurs	Kursværdi	Kurtage	Øvrige omk.	Renter	Afregningsbeløb
<b>Konto nr. 3537163038</b>							
<b>Kontantrente</b>							
01-01-2015	28,03 DKK	100,00	28,03				28,03
01-02-2015	248,60 DKK	100,00	248,60				248,60
01-03-2015	54,70 DKK	100,00	54,70				54,70
01-04-2015	60,56 DKK	100,00	60,56				60,56
01-05-2015	46,90 DKK	100,00	46,90				46,90
01-06-2015	35,94 DKK	100,00	35,94				35,94
01-07-2015	26,79 DKK	100,00	26,79				26,79
01-08-2015	138,08 DKK	100,00	138,08				138,08
01-09-2015	26,71 DKK	100,00	26,71				26,71
01-10-2015	12,34 DKK	100,00	12,34				12,34
<b>Total: Kontantrente</b>			<b>678,65</b>				<b>678,65</b>
<b>Depotgebyr</b>							
12-06-2015	1.742,95 DKK	100,00	1.742,95				1.742,95
<b>Total: Depotgebyr</b>			<b>1.742,95</b>				<b>1.742,95</b>
<b>PM-gebyr</b>							
25-06-2015	-54.344,96 DKK	100,00	-54.344,96		-13.586,24		-67.931,20
25-06-2015	54.344,96 DKK	100,00	54.344,96		13.586,24		67.931,20
30-06-2015	54.344,96 DKK	100,00	54.344,96		13.586,24		67.931,20
<b>Total: PM-gebyr</b>			<b>54.344,96</b>		<b>13.586,24</b>		<b>67.931,20</b>

# Gribskov Kommune

Rapportering pr. 23. november 2015

## Ordliste og forkortelser

### Anskaffelsesdato

Anskaffelsesdato svarer til den faktiske anskaffelsesdato.

### Afkast i procent

Afkast i procent er porteføljens tidsvægtede afkast på statusdagen. Afkast fra investeringsforeninger under Danske Invest er beregnet på basis af investeringsafdelingernes indre værdi (NAV). Afkast i procent er efter eventuel tilbageholdt aktieudbytteskat.

Ved beregning af det procentvise tidsvægtede afkast opdeles den betragtede periode i daglige delperioder. Afkastet beregnes for hver periode som den procentvise ændring mellem primo- og ultimoværdien justeret for nettoind- og -udbetalinger. Ud fra delperiodens afkast beregnes periodens samlede tidsvægtede afkast. Det er dette afkast, som anvendes ved afkastsammenligninger.

Omregning til danske kroner sker i performanceopgørelser ved anvendelse af Reuters valutakurser, når markedet lukker (kl. 16 London-tid).

### Afkast pr. fondskode

Afkast pr. fondskode opgøres som det tidsvægtede afkast i procent.

### Gebyrer

Gebyrer består af depotgebyr (aftalt med depotbanken) og porteføljeplejegebyr (beregnet på baggrund af de vilkår, der er fastsat i porteføljeaftalen).

### Porteføljens værdi

Porteføljens værdi er beregnet i henhold til de enkelte papirers officielle kurser på statusdagen inkl. vedhængende renter.

Omregning til danske kroner sker i beholdningsoversigter ved anvendelse af kurser leveret af Danske Bank. For dagligt noterede kurser gælder, at de svarer til Nationalbankens middeltkurser.

### Afkast

Afkastet består af 4 komponenter: Realiserede kursgevinster (også eventuel valutagevinst), periodens ændring i urealiserede kursgevinster (også eventuel valutagevinst), løbende afkast i form af modtagne aktieudbytter eller periodiserede renteindtægter og omkostninger. Hvis der anvendes futures, indregnes marginbetalinger.

Kursgevinsten udgør summen af en eventuel kursstigning på værdipapiret - og eventuelt valutakursgevinst. Gevinsterne beregnes ud fra markedsværdien primo perioden (værdien primo perioden er altid lig værdien ultimo forrige periode). Der tages hensyn til beholdningsforskydninger i perioden.

Renteindtægten er den periodiserede renteindtægt, hvilket vil sige:

- forfaldne renter i perioden inkl. handelsrenter
- plus tilgodehavende ikke-forfaldne renter ultimo
- minus tilgodehavende ikke-forfaldne renter primo

Kontantsaldoen påvirkes kun af nettoafkastet. Det vil sige bruttoafkastet minus eventuelt tilbageholdt udbytte-/renteskat.

# Gribskov Kommune

Rapportering pr. 23. november 2015

---

## Totalafkast / Afkast i DKK

Totalafkastet består af kursværdien, renter og udbytter tillagt/fratrullet realiseret og urealiseret kursgevinst.

Kursgevinsten udgør summen af en eventuel kursstigning på værdipapiret og eventuel valutakursgevinst. Gevinsten beregnes ud fra markedsværdien primo perioden.

## Varighed

Varighed er et mål for obligationens renterisiko udtrykt ved prisændringen som funktion af en ændring i den effektive rente.

I daglig tale defineres varighed ofte som udtryk for obligationens kursfølsomhed i forbindelse med renteændringer.

Jo højere varighed obligationen har, jo større kursudsving vil den være udsat for ved en renteændring.

DC-varighed – optionskorrigeret varighed – adskiller sig fra kurslistens varighed (ukorrigeret varighed).

Kurslistens varighed tager ikke højde for, at afdragsprofilen på konverterbare obligationer kan blive påvirket af låntagers konverteringsmulighed. For at få et mere korrekt mål for rentefølsomheden på konverteringsstruede realkreditobligationer er det nødvendigt at korrigere varigheden for forventede konverteringer.

Til beregning af DC-varighed på realkreditobligationer anvender Danske Capital en realkreditmodel, som er udarbejdet af Danske Markets. Realkreditmodellen tager udgangspunkt i:

- debitorsammensætningen pr. realkreditobligation
- debitors krav til gevinst ved konvertering
- debitors samlede omkostninger ved konvertering
- renteforventninger (simuleret ved brug af en rentestrukturmodel)
- swaprentekurve (estimeres dagligt på baggrund af priser på danske swaps)

Efterfølgende foretager Danske Capital en markedsmæssig justering af resultatet af den teoretiske realkreditmodel. Denne justering medfører, at DC-varigheden i langt højere grad afspejler den varighed, som observeres i markedet.

Vi gør opmærksom på, at Finanstilsynets beregning af den korrigerede varighed adskiller sig fra såvel DC-varighed som kurslistens varighed – der henvises til [www.finanstilsynet.dk](http://www.finanstilsynet.dk).

## Øvrige omkostninger

En negativ post under øvrige omkostninger i forbindelse med en købstransaktion betyder, at der er ydet en godtgørelse i forbindelse med transaktionen, jf. porteføljeaftalen.

## Forkortelser

### Navn på foreninger:

- DI = Danske Invest
- DIE = Danske Invest Engros
- DIH = Danske Invest Hedge
- DIL = Danske Invest Luxembourg
- DIS = Danske Invest Select
- PLPI = Placeringsforeningen Profil Invest
- DPFDI = Den professionelle forening Danske Invest

# Gribskov Kommune

Rapportering pr. 23. november 2015

## Navn på afdelinger:

DAN.MELLOBLG	Dannebrog mellem lange obligationer
DANM. AKKUM.	Danmark - akkumulerende
DI DANM. INDEKS	Danmark Indeks
DK. LANGE OBL	Danske lange obligationer
DK. MELLOBL	Danske mellem lange obligationer
DK.KORTE OBL	Danske korte obligationer
EU.FOKUS AKKL	Europa Fokus - akkumulerende KL
EU.INDEKS BNP	Europa Indeks - BNP
EUR.VAL. AKK.	Europa valutasikret - akkumulerende
EUROP H.U AKK	Europa Højt Udbytte - akkumulerende KL
EUROP.OBLG.	Europa obligationer
EUROPA H.U.	Europa Højt Udbytte
EUROPA S.C.	Europa Small Cap
FJ.ØST INDEKS	Fjernøsten indeks
GL.STOCKP AKK	Global StockPicking - Akkumulerende KL
GLBIDXOB KLDK	Global Indeksobligationer, akk, klasse dk
GLBINDEKS OBUD	Global Indeksobligationer
GLO.STOCKP.2	Global StockPicking - 2
GLO.STOCKPICK	Global StockPicking
GLOB.VIRK.OBL	Globale virksomhedsobligationer
NYE MA.OBLLV	Nye markeder obligationer - Lokal valuta
NYE MARK.OBL	Nye markeder obligationer
NYE MARK.S.C	Nye markeder - small cap
NYE MRK. AKK.	Nye markeder - akkumulerende
UDENL.OBLMK	Udenlandske obligationsmarkeder
US VALUTA. KL	USA valutasikret - akkumulerende, klasse DK
ØSTEUR.KONV.	Østeuropa konvergens
DANM.FOKUS	Danmark Fokus
DANM.SMLCAP	Danmark small cap
EMERG. MKTS	Emerging Markets
GL.RESTRICT	Global Restricted
GLOBAL H.Y.B	Global High Yield Bonds
KOM.EUR.OBL.	Kommuner Europæiske obligationer
LOW V.USA AK	Low volatilité USA - akkumulerende
EU.I.G.C.B.R	Euro Investment Grade Corporate Bonds Restricted
FISF DKK	Fixed Income Strategies Fund
FISF DO	Fixed Income Strategies Fund
MORT ARB DKK	Mortgage Arbitrage Fund
EQT EUR	European Equities Absolute Fund
GLB EQT SOL	Global Equities Solution
DKOB ABSLAV	Danske obligationer, varighed 0-3
DKOBABS(BAH	Danske obligationer, varighed 0-6
IAMM	Money Market Fund

# Gribskov Kommune

Rapportering pr. 23. november 2015

## Forbehold

### Bemærk:

Rapportens data og beregninger erstatter ikke kontoudtog, depotudtog, fondsnotaer, udbytte-, rente- og udtrækningsmeddelelser mv., der er sendt fra Danske Bank. Indholdet i rapporten er ikke revideret og kan som sådan ikke anvendes som regnskabsgrundlag. En mere detaljeret opdeling af gebyrer for porteføljepleje samt handelsomkostninger kan på anmodning fås hos Danske Capital.

### Kilde:

MSCI-oplysninger må kun anvendes til internt brug, og må ikke gengives eller videregives i nogen form eller bruges som grundlag for eller som en bestanddel af et finansielt instrument, produkt eller indeks. MSCI-oplysninger skal ikke opfattes som investeringsvejledning eller som en anbefaling om at foretage (eller undlade at foretage) en investeringsbeslutning af enhver art, og investorer må ikke handle i tillid til sådanne oplysninger. Historiske data og analyser skal ikke betragtes som en indikation af eller garanti for fremtidige performanceanalyser, forventninger eller forudsigelser. MSCI-oplysninger gives som "de er og forefindes", og brugeren af sådanne oplysninger påtager sig den fulde risiko for enhver anvendelse deraf. MSCI, dets tilknyttede selskaber og andre, der er involveret i eller tilknyttet kompilering, beregning eller udarbejdelse af MSCI-oplysninger (under ét "MSCI-parterne"), fraskriver sig udtrykkeligt ethvert ansvar (herunder, men ikke begrænset til, ansvar for originalitet, nøjagtighed, fuldstændighed, betimelighed, ikke-krænkelser, kurans og brugbarhed), hvad angår sådanne oplysninger. Uden begrænsning af ovenstående kan ingen MSCI-part under nogen omstændigheder holdes ansvarlig for direkte eller indirekte tab eller skader, for dokumenterede tab eller skader samt for afledte skader, følgeskader (herunder, uden begrænsning, driftstab) eller andre skader samt for pønalerstatning. ([www.msci Barra.com](http://www.msci Barra.com))