



RAPPORTERING PR. 31. MAJ 2015



Gribskov Kommune

Rådhusvej 3
3200 Helsingø

Kontaktinformation:

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



Gribskov Kommune

Rapportering pr. 31. maj 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	6
5. Transaktioner	År til dato	8
6. Ordliste, forkortelser og forbehold		14

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. 31-05-2015

Porteføljens værdi i DKK*

	Pr. 31-12-2014		Pr. 31-05-2015	
	Markedsværdi	Porteføljeandel	Markedsværdi	Porteføljeandel
Nordiske obligationer	242.313.799	99,9%	243.373.975	99,9%
Kontanter	198.786	0,1%	264.084	0,1%
Total	242.512.585	100,0%	243.638.058	100,0%

Afkast i DKK*

Periode	01-05-2015 til 31-05-2015	01-01-2015 til 31-05-2015
Total incl. urealiseret afkast	-696.513	1.125.474

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

Afkast i %**

Periode	01-05-2015 til 31-05-2015	01-01-2015 til 31-05-2015
	Portefølje	Portefølje
Nordiske obligationer	-0,26%	0,49%
Total incl. alle aktivtyper	-0,26%	0,48%

** 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	01-05-2015 til 31-05-2015	01-01-2015 til 31-05-2015
	Referenceafkast	Referenceafkast
CIBOR 6 Måneder, DKK	0,00%	0,02%
Nordea realkredit CM 2	-0,73%	-0,38%

Gribskov Kommune
Rådhusvej 3
3200 Helsingør

Kapitalværdi og -fordeling

Eksklusiv uafviklede handler

Aftale om portfolio management	Pr. 31-12-2014		Pr. 31-05-2015	
	DKK	% af kapital	DKK	% af kapital
Nordiske obligationer inkl. vedhængende rente	242.313.799	99,9 %	243.373.975	99,9 %
Kontanter	198.786	0,1 %	264.084	0,1 %
Værdi i alt	242.512.585	100,0 %	243.638.058	100,0 %

Gribskov Kommune
 Rådhusvej 3
 3200 Helsingør

Periodens ind- og udbetalinger
 01-01-2015 - 31-05-2015

Aftale om
 portfolio management

Indbetalt i perioden:	Værdipapirer	0,00
	Kontant	0,00
Udbetalt i perioden:	Værdipapirer	0,00
	Kontant	0,00
Ind- og udbetalinger i alt		0,00

Beholdning og afkast

Gribskov Kommune



for perioden 01-01-2015 til 31-05-2015

Eksklusiv uafviklede handler

31-05-2015

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										
Konverterbare obligationer										
4 NORDEA ANN 35 DK0002012780	3.120.350,5100 1.111.360,8100	100,0000 100,0000	106,8500 100,0000	3.334.094,52 1.111.360,81	54.040,30 27.901,39	0,00	-53.620,68	0,00	6.390,16	34.711,17
TK VAR.40C CF 38 DK0004717204	18.611.035,9500 2.169.805,7100	100,0000 100,0000	106,2000 100,0000	19.764.920,18 2.169.805,71	38.644,86 33.966,40	0,00	16.199,86	0,00	312.260,14	401.071,26
4 RD 22D 2025 DK0009270159	6.836.717,2100 1.916.497,8800	100,0000 100,0000	107,4000 100,0000	7.342.634,28 1.916.497,88	111.621,73 57.713,51	0,00	-137.867,62	0,00	-30.217,35	1.250,27
4 RD 23D 2035 DK0009270233	2.083.203,0200 785.600,1900	100,0000 100,0000	107,0450 100,0000	2.229.964,67 785.600,19	38.912,47 18.915,18	0,00	-61.973,72	0,00	-37.530,27	-41.676,34
4 RD 23D 2038 DK0009274300	3.188.056,1500 1.031.007,6400	100,0000 100,0000	106,4050 100,0000	3.392.251,15 1.031.007,64	54.199,10 27.818,00	0,00	-61.136,81	0,00	-25.406,45	-4.526,16
4 RD 27S.S.OA 44 DK0009285421	5.566.589,4000 2.449.205,5900	100,0000 100,0000	105,3380 100,0000	5.863.733,94 2.449.205,59	117.121,44 52.851,40	0,00	-132.333,29	0,00	-4.650,14	32.989,41
3,5 RD 23S.SA 44 DK0009288441	9.606.385,2500 4.193.614,7500	100,0000 100,0000	102,8870 100,0000	9.883.721,59 4.193.614,75	-55.730,77 79.615,38	0,00	0,00	0,00	-67.663,66	-43.779,05
3,5 RD 27S.SA 44 DK0009289258	22.660.468,8800 10.066.913,3300	100,0000 100,0000	102,6080 100,0000	23.251.453,91 10.066.913,33	162.911,65 188.811,82	0,00	-161.627,43	0,00	-471.142,49	-281.046,45
4 NYK 02 D 2025 DK0009757106	6.331.351,1100 1.239.942,0200	100,0000 100,0000	107,3410 100,0000	6.796.135,59 1.239.942,02	89.179,65 49.920,61	0,00	-78.611,89	0,00	-19.778,28	40.710,09
NYK VAR.33DCF38 DK0009761488	24.341.876,6400 1.308.975,0200	100,0000 100,0000	105,2530 100,0000	25.620.555,42 1.308.975,02	83.020,43 52.644,85	0,00	-15.717,50	0,00	-86.459,54	33.488,24
NYK VAR.47DCF617 DK0009764664	20.813.735,5300 13.004,5800	100,0000 100,0000	101,1980 100,0000	21.063.084,08 13.004,58	41.611,94 27.079,34	0,00	-156,03	0,00	13.173,32	81.708,57
NYK VAR.21ECF641 DK0009771362	7.556.917,5700 468.558,7100	100,0000 100,0000	105,6000 100,0000	7.980.104,95 468.558,71	17.607,98 11.105,59	0,00	-4.595,18	0,00	1.849,87	25.968,26
NYK VAR.21HCF623 DK0009789224	48.989.017,5400 2.228,9500	100,0000 100,0000	103,3340 100,0000	50.622.311,38 2.228,95	104.100,07 67.793,65	0,00	-44,64	0,00	300.731,93	472.581,01
Total: Konverterbare obligationer				187.144.965,66 26.756.715,18	857.240,85 696.137,12	0,00	-691.484,93	0,00	-108.442,76	753.450,28

Beholdning og afkast

Gribskov Kommune



for perioden 01-01-2015 til 31-05-2015

Eksklusiv uafviklede handler

31-05-2015

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
Inkonverterbare obligationer										
2 NORDEA APR 18 DK0002028356	17.800.000,0000 0,0000	100,0000 0,0000	105,1900 0,0000	18.723.820,00 0,00	83.879,45 58.360,66	0,00	0,00	0,00	-14.240,00	128.000,11
2 RD 10T 2018 DK0009286585	0,0000 0,0000	0,0000 0,0000	0,0000 0,0000	0,00 0,00	32.038,09 0,00	0,00	-2.728,00	0,00	0,00	29.310,09
2 RD 10T JA 2017 DK0009287476	9.600.000,0000 0,0000	100,0000 0,0000	103,2820 0,0000	9.915.072,00 0,00	91.090,41 78.904,11	0,00	36.026,35	0,00	-21.034,35	184.986,52
2 NYK12H B OK 16 DK0009785073	0,0000 0,0000	0,0000 0,0000	0,0000 0,0000	0,00 0,00	12.821,92 0,00	0,00	16.458,00	0,00	0,00	29.279,92
Total: Inkonverterbare obligationer				28.638.892,00 0,00	219.829,87 137.264,77	0,00	49.756,35	0,00	-35.274,35	371.576,64
Total: DKK				215.783.857,66 26.756.715,18	1.077.070,72 833.401,89	0,00	-641.728,58	0,00	-143.717,11	1.125.026,92
Noteringsvaluta: DKK										
Bankkonti										
GRÆSTED-GILLELEJE 3537163038	264.047,7100 0,0000	100,0000 0,0000	1,0000 0,0000	264.047,71 0,00	410,76 35,94	0,00	0,00	0,00	0,00	446,70
Total: Bankkonti				264.047,71 0,00	410,76 35,94	0,00	0,00	0,00	0,00	446,70
Total: DKK				264.047,71 0,00	410,76 35,94	0,00	0,00	0,00	0,00	446,70
Total for porteføljen				216.047.905,37 26.756.715,18	1.077.481,48 833.437,83	0,00	-641.728,58	0,00	-143.717,11	1.125.473,62

Beholdningens varighed
pr. 31-05-2015

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
Nordiske obligationer											
Konverterbare obligationer											
DK0002012780	4 NORDEA ANN 35	DKK	3.120.350,51	106,850	100,000	1,45	0,69	8,91	3.334.095	20.574	3.354.668
DK0002012780	4 NORDEA ANN 35	DKK	1.111.360,81	100,000	100,000	1,45	0,09	0,09	1.111.361	7.328	1.118.688
DK0004717204	TK VAR.40C CF 38	DKK	18.611.035,95	106,200	100,000	0,45	0,95	0,08	19.764.920	30.420	19.795.340
DK0004717204	TK VAR.40C CF 38	DKK	2.169.805,71	100,000	100,000	0,45	0,09	0,09	2.169.806	3.547	2.173.352
DK0009270159	4 RD 22D 2025	DKK	6.836.717,21	107,400	100,000	1,03	0,99	4,62	7.342.634	45.077	7.387.712
DK0009270159	4 RD 22D 2025	DKK	1.916.497,88	100,000	100,000	1,03	0,09	0,09	1.916.498	12.636	1.929.134
DK0009270233	4 RD 23D 2035	DKK	2.083.203,02	107,045	100,000	1,44	0,68	8,83	2.229.965	13.735	2.243.700
DK0009270233	4 RD 23D 2035	DKK	785.600,19	100,000	100,000	1,44	0,09	0,09	785.600	5.180	790.780
DK0009274300	4 RD 23D 2038	DKK	3.188.056,15	106,405	100,000	1,37	0,48	9,06	3.392.251	21.020	3.413.271
DK0009274300	4 RD 23D 2038	DKK	1.031.007,64	100,000	100,000	1,37	0,09	0,09	1.031.008	6.798	1.037.805
DK0009285421	4 RD 27S.S.OA 44	DKK	5.566.589,40	105,338	100,000	1,46	0,36	12,26	5.863.734	36.703	5.900.437
DK0009285421	4 RD 27S.S.OA 44	DKK	2.449.205,59	100,000	100,000	1,46	0,09	0,09	2.449.206	16.149	2.465.354
DK0009288441	3,5 RD 23S.SA 44	DKK	9.606.385,25	102,887	100,000	1,61	2,29	11,62	9.883.722	55.421	9.939.143
DK0009288441	3,5 RD 23S.SA 44	DKK	4.193.614,75	100,000	100,000	1,61	0,09	0,09	4.193.615	24.194	4.217.809
DK0009289258	3,5 RD 27S.SA 44	DKK	22.660.468,88	102,608	100,000	1,66	3,04	12,95	23.251.454	130.733	23.382.187
DK0009289258	3,5 RD 27S.SA 44	DKK	10.066.913,33	100,000	100,000	1,66	0,09	0,09	10.066.913	58.078	10.124.992
DK0009757106	4 NYK 02 D 2025	DKK	6.331.351,11	107,341	100,000	0,98	0,92	4,57	6.796.136	41.745	6.837.881
DK0009757106	4 NYK 02 D 2025	DKK	1.239.942,02	100,000	100,000	0,98	0,09	0,09	1.239.942	8.175	1.248.117
DK0009761488	NYK VAR.33DCF38	DKK	24.341.876,64	105,253	100,000	0,79	0,93	0,08	25.620.555	49.958	25.670.514
DK0009761488	NYK VAR.33DCF38	DKK	1.308.975,02	100,000	100,000	0,79	0,09	0,09	1.308.975	2.686	1.311.662
DK0009764664	NYK VAR.47DCF617	DKK	20.813.735,53	101,198	100,000	0,14	0,09	0,08	21.063.084	27.062	21.090.147
DK0009764664	NYK VAR.47DCF617	DKK	13.004,58	100,000	100,000	0,14	0,09	0,09	13.005	17	13.021
DK0009771362	NYK VAR.21ECF641	DKK	7.556.917,57	105,600	100,000	0,38	1,20	0,08	7.980.105	10.457	7.990.562
DK0009771362	NYK VAR.21ECF641	DKK	468.558,71	100,000	100,000	0,38	0,09	0,09	468.559	648	469.207
DK0009789224	NYK VAR.21HCF623	DKK	48.989.017,54	103,334	100,000	0,42	0,14	7,78	50.622.311	67.791	50.690.102
DK0009789224	NYK VAR.21HCF623	DKK	2.228,95	100,000	100,000	0,42	0,09	0,09	2.229	3	2.232
Konverterbare obligationer			206.462.419,94			1,10	0,83	4,84	213.901.681	696.137	214.597.818

Beholdningens varighed
pr. 31-05-2015

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
Inkonverterbare obligationer											
DK0002028356	2 NORDEA APR 18	DKK	17.800.000,00	105,190	100,000	0,17	2,77	2,77	18.723.820	58.361	18.782.181
DK0009287476	2 RD 10T JA 2017	DKK	9.600.000,00	103,282	100,000	-0,04	1,57	1,56	9.915.072	78.904	9.993.976
Inkonverterbare obligationer			27.400.000,00			0,12	2,36	2,35	28.638.892	137.265	28.776.157
Bankkonti											
3537163038	GRÆSTED-GILLELEJE	DKK	264.047,71	1,000	100,000	0,00	0,00	0,00	264.048	36	264.084
Bankkonti			264.047,71			0,00	0,00	0,00	264.048	36	264.084
Total			234.126.467,65			1,04	1,01	4,54	242.804.621	833.438	243.638.058
Total for porteføljen			234.126.467,65			1,04	1,01	4,54	242.804.621	833.438	243.638.058

Transaktioner
i perioden 01-01-2015 til 31-05-2015

Gribskov Kommune



Værdi i DKK

Valørdato	Fondskode	Papirnavn	Nominal/stk.	Valuta	Valutakurs	Handelskurs	Kursværdi	Kurtage	Øvrige omk.	Renter	Afregningsbeløb
Depot nr. 3002130149											
Køb											
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
Total: Køb							78.929.815,00			346.952,23	79.276.767,23
Salg											
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 NYK12HB 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 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
Total: Salg							38.290.120,00			151.857,27	38.441.977,27
Transaktionsomkostninger											
Køb							78.929.815,00	0,00	0,00	346.952,23	79.276.767,23
Salg							38.290.120,00	0,00	0,00	151.857,27	38.441.977,27

Transaktioner
i perioden 01-01-2015 til 31-05-2015

Gribskov Kommune



Værdi i DKK

Valørdato	Fondskode	Papirnavn	Nominal/stk.	Valuta	Valutakurs	Kursværdi	Kurtage	Øvrige omk.	Renter	Afregningsbeløb
Depot nr.	3002130149									
Rente										
02-01-2015	DK0002012780	4 NORDEA ANN 35	53.260,11	DKK	100,00	53.260,11				53.260,11
02-01-2015	DK0002012780	4 NORDEA ANN 35	18.516,87	DKK	100,00	18.516,87				18.516,87
02-01-2015	DK0009270159	4 RD 22D 2025	35.372,18	DKK	100,00	35.372,18				35.372,18
02-01-2015	DK0009270159	4 RD 22D 2025	110.041,15	DKK	100,00	110.041,15				110.041,15
02-01-2015	DK0009270233	4 RD 23D 2035	38.335,25	DKK	100,00	38.335,25				38.335,25
02-01-2015	DK0009270233	4 RD 23D 2035	14.768,71	DKK	100,00	14.768,71				14.768,71
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	19.347,86	DKK	100,00	19.347,86				19.347,86
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	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	2.435,82	DKK	100,00	2.435,82				2.435,82
02-01-2015	DK0009761488	NYK VAR.33DCF38	89.862,54	DKK	100,00	89.862,54				89.862,54
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 31-05-2015

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	42.317,11	DKK	100,00	42.317,11				42.317,11
01-04-2015	DK0002012780	4 NORDEA ANN 35	10.943,00	DKK	100,00	10.943,00				10.943,00
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	51.515,71	DKK	100,00	51.515,71				51.515,71
01-04-2015	DK0004717204	TK VAR.40C CF 38	5.501,29	DKK	100,00	5.501,29				5.501,29
01-04-2015	DK0009270159	4 RD 22D 2025	22.509,00	DKK	100,00	22.509,00				22.509,00
01-04-2015	DK0009270159	4 RD 22D 2025	87.532,15	DKK	100,00	87.532,15				87.532,15
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	80.157,95	DKK	100,00	80.157,95				80.157,95
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	DK0009286585	2 RD 10T 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	75.712,93	DKK	100,00	75.712,93				75.712,93
01-04-2015	DK0009757106	4 NYK 02 D 2025	12.283,11	DKK	100,00	12.283,11				12.283,11
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	41.070,33	DKK	100,00	41.070,33				41.070,33

Transaktioner
i perioden 01-01-2015 til 31-05-2015

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	27,13	DKK	100,00	27,13				27,13
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	3,44	DKK	100,00	3,44				3,44
01-04-2015	DK0009789224	NYK VAR.21HCF623	102.820,38	DKK	100,00	102.820,38				102.820,38
Total: Rente						3.086.903,63				3.086.903,63
Udtrækning										
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
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

Transaktioner
i perioden 01-01-2015 til 31-05-2015

Gribskov Kommune



Værdi i DKK

Valørdato	Fondskode	Papirnavn	Nominal/stk.	Valuta	Valutakurs	Kursværdi	Kurtage	Øvrige omk.	Renter	Afregningsbeløb
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
Total: Udtrækning						37.812.737,45				37.812.737,45

Transaktioner
i perioden 01-01-2015 til 31-05-2015

Gribskov Kommune



Værdi i DKK

Valørdato	Nominal/stk.	Valuta	Valutakurs	Kursværdi	Kurtage	Øvrige omk.	Renter	Afregningsbeløb
Konto nr. 3537163038								
Kontantrente								
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
Total: Kontantrente				438,79				438,79

Gribskov Kommune

Rapportering pr. 31. maj 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 middelmurser.

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. 31. maj 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.

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. 31. maj 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. 31. maj 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.msциbarra.com)