



Slagelse Kommune
Deponerede Midler

3. Kvartalsrapport
2016





MARKEDSVÆRDI PR. AKTIV KLASSE

Slagelse Kommune

Depot nr.: 6100050832

Depot nr.:

Rapporten er opgjort på handelsdag

Dato: 09-30-2016

Aktivklasse	Markedsværdi	Vægt
Kontanter	3,924,091.31	5.6
Obl Dk nom	66,301,314.25	94.4
TOTAL	70,225,405.56	100.0

**PERFORMANCE RAPPORT - TIDSVÆGTET AFKAST- NET OF FEE****Slagelse Kommune**

Depot nr.: 6100050832

Depot nr.:

Rapporten er opgjort på handelsdag

Periode: 31-08-2016 til 30-09-2016

	Periode kr.	År til dato kr.
Beregningsperiodens start	31-08-2016	31-12-2015
Porteføljens startværdi	69,441,679.07	66,690,822.40
Vedhængende renter	443,447.53	718,328.03
Total	69,885,126.60	67,409,150.43
Indskud i perioden	0.00	0.00
Udtræk i perioden	0.00	-764.65
Afkast for perioden	340,278.96	2,817,019.78
Porteføljeværdi ultimo 30-09-2016	69,676,756.17	69,676,756.17
Vedhængende renter	548,649.39	548,649.39
Total	70,225,405.56	70,225,405.56
Specifikation af afkast		
Realiseret gevinst	-175,140.79	67,689.87
Realiseret kursgevinst	-175,140.79	67,689.87
Realiseret valutagevinst	0.00	0.00
Urealiseret gevinst	384,270.77	1,496,038.87
Urealiseret kursgevinst	384,270.77	1,496,038.87
Urealiseret valutagevinst	0.00	0.00
Realiserede Renter Depot	25,947.12	1,422,931.48
Realiserede Renter Kontantkonto	0.00	38.20
Modtaget og tilgodehavende udbytte	0.00	0.00
Ændring i vedhængende renter	105,201.85	-169,678.64
Afkast for perioden	340,278.96	2,817,019.78
Forvaltningsgebyr	0.00	0.00
Øvrige omkostninger	0.00	0.00
Total afkast for periode efter gebyrer	340,278.96	2,817,019.78
Tidsvægtet afkast	0.49%	4.18%

Forbehold: Der tages forbehold for eventuelle fejl i kurser, renter og udbytter / Disclaimer: SEB accepts no liability for possible errors in prices, interest rates and dividends

**PERFORMANCE RAPPORT - TIDSVÆGTET AFKAST- NET OF FEE****Slagelse Kommune**

Depot nr.: 6100050832

Depot nr.:

Rapporten er opgjort på handelsdag

Periode: 30-06-2016 til 30-09-2016

	Periode kr.	År til dato kr.
Beregningsperiodens start	30-06-2016	31-12-2015
Porteføljens startværdi	69,177,939.97	66,690,822.40
Vedhængende renter	470,720.94	718,328.03
Total	69,648,660.91	67,409,150.43
Indskud i perioden	0.00	0.00
Udtræk i perioden	0.00	-764.65
Afkast for perioden	576,744.65	2,817,019.78
Porteføljeværdi ultimo 30-09-2016	69,676,756.17	69,676,756.17
Vedhængende renter	548,649.39	548,649.39
Total	70,225,405.56	70,225,405.56
Specifikation af afkast		
Realiseret gevinst	-218,869.85	67,689.87
Realiseret kursgevinst	-218,869.85	67,689.87
Realiseret valutagevinst	0.00	0.00
Urealiseret gevinst	396,266.98	1,496,038.87
Urealiseret kursgevinst	396,266.98	1,496,038.87
Urealiseret valutagevinst	0.00	0.00
Realiserede Renter Depot	321,419.07	1,422,931.48
Realiserede Renter Kontantkonto	0.00	38.20
Modtaget og tilgodehavende udbytte	0.00	0.00
Ændring i vedhængende renter	77,928.45	-169,678.64
Afkast for perioden	576,744.65	2,817,019.78
Forvaltningsgebyr	0.00	0.00
Øvrige omkostninger	0.00	0.00
Total afkast for periode efter gebyrer	576,744.65	2,817,019.78
Tidsvægtet afkast	0.83%	4.18%

BEHOLDNINGSOVERSIGT
Slagelse Kommune

Depot nr.: 6100050832

Depot nr.:

Rapporten er opgjort på handelsdag

Dato: 30-09-2016

Værdipapirer	ISIN	Stk.	Gns. kopspris	Kostpris	Markeds-kurs	Markedsværdi	Ureal. gevinst/tab	Markedsværdi inkl. rente i DKK	Vægt %
Kontanter (DKK) (FX = 1.0000)	TRKONT0			3.924.091,31		3.924.091,31	0,00	3.924.091,31	5,59
Transaktionskonto (DKK)									
Obligationer - Inkonverterbare (DKK) (FX = 1.0000)									
Realkreditobligationer									
2% Real 20	DK0009287716	12.312.000,00	107,2800	13.208.313,60	106,7800	13.146.753,60	-61.560,00	13.330.424,42	18,98
2 RD T SDR0 2020 Jan									
1% Real 21									
1 NYK H SDO X 2021 Jan	DK0009503005	4.300.000,00	103,3250	4.442.975,00	104,1300	4.477.590,00	34.615,00	4.509.663,77	6,42
Sum Realkreditobligationer				17.651.288,60		17.624.343,60	-26.945,00	17.840.088,19	25,40
SUM Obligationer - Inkonverterbare				17.651.288,60		17.624.343,60	-26.945,00	17.840.088,19	25,40
Obligationer - Konverterbare (DKK) (FX = 1.0000)									
Realkreditobligationer									
4% Real 41									
4 RD S SDR0 2041 ALM	DK0009282329	3.538.358,48	104,3984	3.693.988,72	107,7200	3.811.519,75	117.531,04	3.854.727,26	5,49
3 5% Real 44									
3 5 RD S SDO 2044 ALM	DK0009288441	6.048.521,82	102,1500	6.178.565,04	105,3300	6.370.908,03	192.342,99	6.437.851,22	9,17
2% Real 47									
2 NYK E SDO 2047 ALM	DK0009504169	25.162.129,17	96,9902	24.404.802,95	99,2000	24.960.832,14	556.029,19	25.085.950,11	35,72
3 5% Real 44									
3 5 NYK E SDO 2044 IO10	DK0009787442	4.875.576,05	102,1066	4.978.283,54	104,8750	5.113.260,38	134.976,84	5.162.846,66	7,35
2% Real 24									
2 NYK I RO2L 2024 ALM	DK0009788415	679.829,10	102,9000	699.544,14	103,2500	701.923,55	2.379,40	705.771,64	1,01
2 5% Real 47									
2 5 NYK E SDO 2047 ALM	DK0009798803	7.001.833,41	101,6750	7.119.114,12	102,4000	7.169.877,41	50.763,29	7.214.079,18	10,27
Sum Realkreditobligationer				47.074.298,50		48.128.321,26	1.054.022,76	48.461.226,06	69,01
SUM Obligationer - Konverterbare				47.074.298,50		48.128.321,26	1.054.022,76	48.461.226,06	69,01
TOTAL								70.225.405,56	100,00

Forbehold: Der tages forbehold for eventuelle fejl i kurser, renter og udbytter / Disclaimer: SEB accepts no liability for possible errors in prices, interest rates and dividends





OBLIGATIONSOVERSIGT OG RISIKOMÅL

Slagelse Kommune

Depot nr.: 6100050832

Depot nr.:

Rapporten er opgjort på handelsdag

Dato: 30-09-2016

Værdipapirer	Fondskode	Nom	Markedsværdi+ påløbne rente	Vægt %	Mod. OAD (MOAD)	Opt.just. Varighed (OAD)	Varighed Official	Kon- vekslet	Varighed Finans- tilsynet	Korr. Faktor Official	Off Eff. Rente
Kontanter (DKK)											
Transaktionskonto (DKK)	TRKONTO	3.924.091,31	3.924.091,31	5,6	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Obligationer - Inkonverterbare (DKK)											
1 NYK 11 SDO X 2021 Jan	DK0009503005	4.300.000,00	4.509.663,77	6,4	4,15	4,35	4,15	0,23	4,15	0,24	0,03
2 RD T SDO 2020 Jan	DK0009287716	12.312.000,00	13.330.424,42	19,0	3,14	3,40	3,13	0,14	3,13	0,32	-0,08
		16.612.000,00	17.840.088,19	25,4	3,39	3,64	3,39	0,16	3,39	0,30	0,07
Obligationer - Konverterbare (DKK)											
2 NYK 1 RO2L 2024 ALM	DK0009788416	679.829,10	703.771,64	1,0	2,96	3,06	7,42	0,14	7,30	0,13	1,58
2 NYK E SDO 2047 ALM	DK0009504169	25.162.129,17	25.085.950,11	35,7	6,73	6,68	23,26	-4,67	22,79	0,04	2,05
2,5 NYK E SDO 2047 ALM	DK0009798803	7.001.833,41	7.214.079,18	10,3	2,90	2,97	21,90	-7,25	21,38	0,05	2,41
3,5 NYK E SDO 2044 IQ10	DK0009787442	4.875.576,05	5.162.846,66	7,4	-1,10	-1,16	18,31	-0,55	12,41	0,05	3,27
3,5 RD S SDO 2044 ALM	DK0009288441	6.048.521,82	6.437.851,22	9,2	-1,47	-1,55	18,24	0,46	12,36	0,05	3,25
4 RD S SDO 2041 ALM	DK0009282329	3.538.358,48	3.854.727,26	5,5	-0,88	-0,95	16,34	-0,22	3,15	0,06	3,58
		47.306.248,03	48.461.226,06	69,0	3,58	3,54	21,08	-3,51	18,30	0,05	2,51
SUM TOTAL		67.842.339,34	70.225.405,56	100,0	3,33	3,37	15,41	-2,38	13,49	0,11	1,75
Ændring i porteføljeværdi ved renteændring på 1 pct. point i DKK			Beregnet ved Opt. justeret varighed	Beregnet ved official varighed		Beregnet ved Finanstilsynets varighed					
			2.339.634,39	10.634.042,43		9.311.430,90					
Ændring i porteføljeværdi ved renteændring på 1 pct. point i % af markedsværdi incl. renter			3,33	15,14		13,26					

Forbehold. Der tages forbehold for eventuelle fejl i kurser, renter og udbytter / Disclaimer: SEB accepts no liability for possible errors in prices, interest rates and dividends