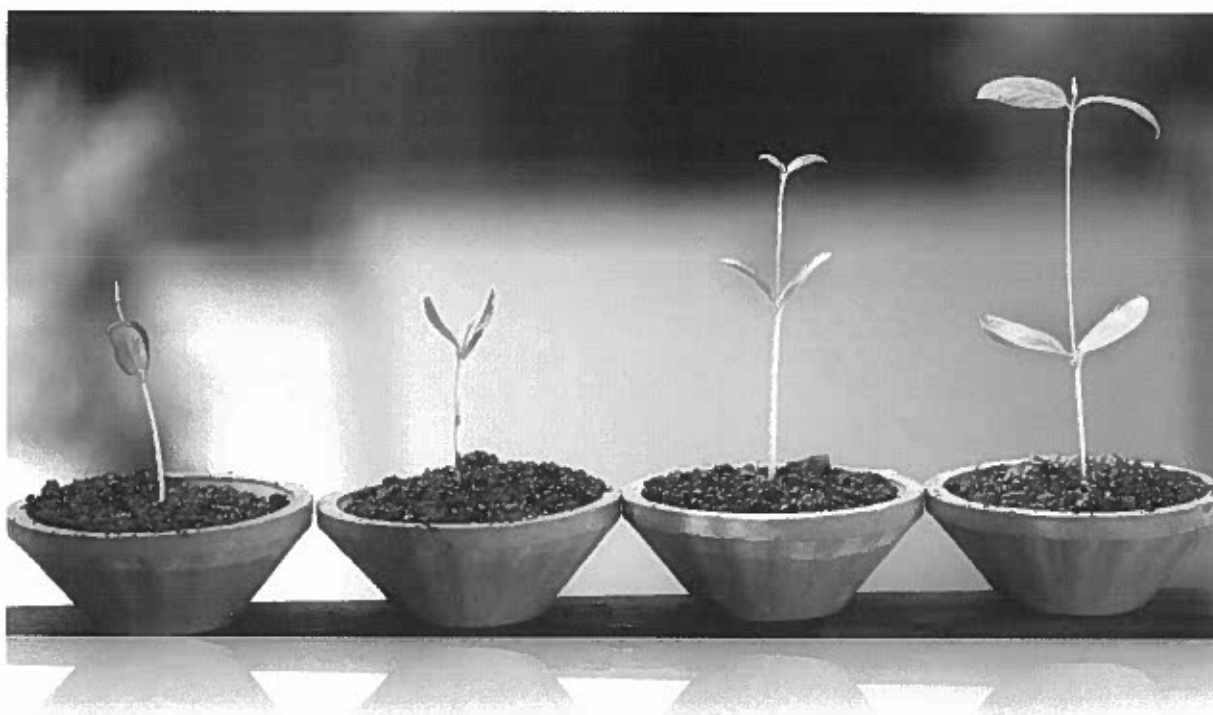


## Slagelse Kommune - Deponerede midler



---

Tobias Hallingskog  
+45 55472231  
[tobias.hallingskog@nordea.com](mailto:tobias.hallingskog@nordea.com)

## Indholdsfortegnelse

### Nordeas officielle rapportering

Afkastoversigt 3

#### **Obligationer**

DKK & EUR Obligationer 7

Danske obligationer 7

### Bilag - diverse

Beholdningsliste per: 31.12.2015 8

Transaktionsliste 10

# Afkastoversigt

Slagelse Kommune - Deres egne midler

Absolut 0,62%



Relativ -0,59%



## Afkastoversigt for aktivklasser - kvartal til dato

Afkast i %	Portefølje	Benchmark	Forskel
<b>Total</b>	<b>0,62</b>	<b>1,20</b>	<b>-0,59</b>
<b>Aktier</b>	<b>0,00</b>	<b>8,44</b>	<b>0,00</b>
Internationale aktier	0,00	8,44	0,00
Equities Global MP Common	0,00	8,44	0,00
<b>Obligationer</b>	<b>0,62</b>	<b>0,82</b>	<b>-0,20</b>
DKK & EUR Obligationer	0,51	0,60	-0,10
Danske obligationer	0,51	0,60	-0,10
Emerging Market obligationer	1,49	4,08	-2,59
Nordea Invest Højrentelande	1,49	4,08	-2,59
Investment Grade kreditobligationer	0,63	1,12	-0,48
NIE Euro Investment Grade	0,63	1,12	-0,48

NIF ID 27-56-1387

## Afkastoversigt for aktivklasser - år til dato

Afkast i %	Portefølje	Benchmark	Forskel
<b>Total</b>	<b>-0,46</b>	<b>1,63</b>	<b>-2,09</b>
<b>Aktier</b>	<b>0,00</b>	<b>10,66</b>	<b>0,00</b>
Internationale aktier	0,00	10,66	0,00
Equities Global MP Common	0,00	10,66	0,00
<b>Obligationer</b>	<b>-0,43</b>	<b>1,10</b>	<b>-1,53</b>
DKK & EUR Obligationer	-0,69	0,48	-1,17
Danske obligationer	-0,69	0,48	-1,17
Emerging Market obligationer	1,52	12,96	-11,44
Nordea Invest Højrentelande	1,52	12,96	-11,44
Investment Grade kreditobligationer	0,15	-0,34	0,50
NIE Euro Investment Grade	0,15	-0,34	0,50

NIF ID 171340999

**Resultat - kvartal til dato**

Aktiv fordeling	Markedsværdi 2015-09-30	Kvt. til dato		Markedsværdi 2015-12-31
		Pengestrøm	Afkast	
<b>Total</b>	<b>71.149.075</b>	<b>-237</b>	<b>438.339</b>	<b>71.587.177</b>
<b>Obligationer</b>	<b>71.144.959</b>	<b>1.010</b>	<b>438.337</b>	<b>71.584.306</b>
DKK & EUR Obligationer	59.096.453	3.588.180	290.115	62.974.749
Danske obligationer	59.096.453	3.588.180	290.115	62.974.749
Emerging Market obligationer	4.997.586	0	74.631	5.072.217
Nordea Invest Højrentelande	4.997.586	0	74.631	5.072.217
Investment Grade kreditobligationer	7.050.919	-3.587.170	73.591	3.537.340
NIE Euro Investment Grade	7.050.919	-3.587.170	73.591	3.537.340
<b>Kontant</b>	<b>4.116</b>	<b>-1.247</b>	<b>2</b>	<b>2.871</b>
Kontant allokering	4.116	-1.247	2	2.871
Pengemarkedskonto	4.116	-1.247	2	2.871

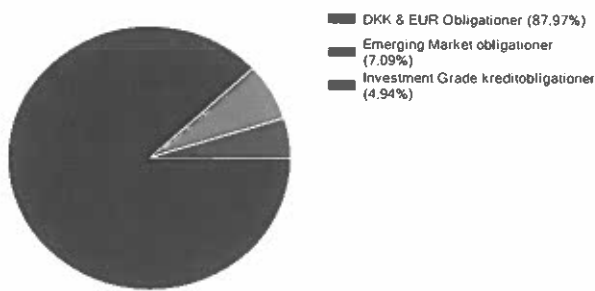
Aktid ID 174581612

**Resultat - år til dato**

Aktiv fordeling	Markedsværdi 2014-12-31	År til dato		Markedsværdi 2015-12-31
		Pengestrøm	Afkast	
<b>Total</b>	<b>82.295.795</b>	<b>-10.422.092</b>	<b>-286.526</b>	<b>71.587.177</b>
<b>Obligationer</b>	<b>82.287.145</b>	<b>-10.416.297</b>	<b>-286.542</b>	<b>71.584.306</b>
DKK & EUR Obligationer	68.344.391	-4.961.820	-407.822	62.974.749
Danske obligationer	68.344.391	-4.961.820	-407.822	62.974.749
Emerging Market obligationer	5.836.893	-838.943	74.266	5.072.217
Nordea Invest Højrentelande	5.836.893	-838.943	74.266	5.072.217
Investment Grade kreditobligationer	8.105.861	-4.615.534	47.014	3.537.340
NIE Euro Investment Grade	8.105.861	-4.615.534	47.014	3.537.340
<b>Kontant</b>	<b>8.650</b>	<b>-5.795</b>	<b>16</b>	<b>2.871</b>
Kontant allokering	8.650	-5.795	16	2.871
Pengemarkedskonto	8.650	-5.795	16	2.871

Aktid ID 172011967

Aktivfordeling



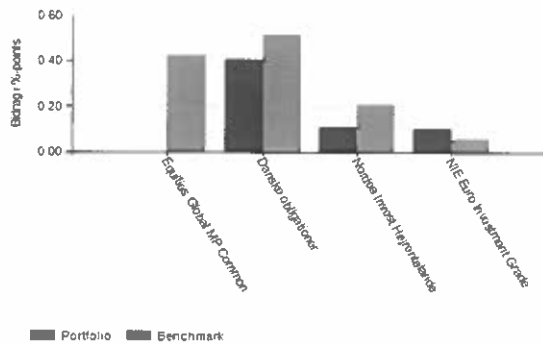
NIMA ID 167092466

Attribution fra aktivklasser - kvartal til dato

Bidrag i %	Aktiv fordeling	Papir udvælgelse	Bidrag
<b>Total</b>	-0,38	-0,20	-0,59
<b>Aktier</b>	-0,37	0,00	-0,37
<b>Obligationer</b>	-0,02	-0,20	-0,22
DKK & EUR Obligationer	0,02	-0,07	-0,05
Emerging Market obligationer	0,06	-0,19	-0,13
Investment Grade kreditobligationer	0,02	-0,04	-0,02
<b>Kontant</b>	0,00	0,00	0,00

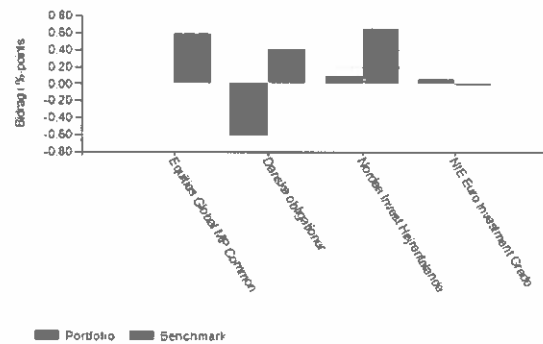
NIMA ID 166992463

Afkastbidrag fra aktivklasser - kvartal til dato



NIMA ID 1797814578

Afkastbidrag fra aktivklasser - år til dato



NIMA ID 1796224662

Aktivfordeling

Assét allocation limits	LimitMin	LimitMax	Portefølje
<b>Rentebærende aktiver</b>			
Dansk stat- og boligkredit	0,00	100,00	86,04
Emerging markets obligationer	0,00	10,00	7,01
Kreditobligationer	0,00	10,00	4,91
Modificeret varighed	3,00	5,00	3,69
<b>Kontantallokering</b>			
Kontant	0,00	20,00	1,93

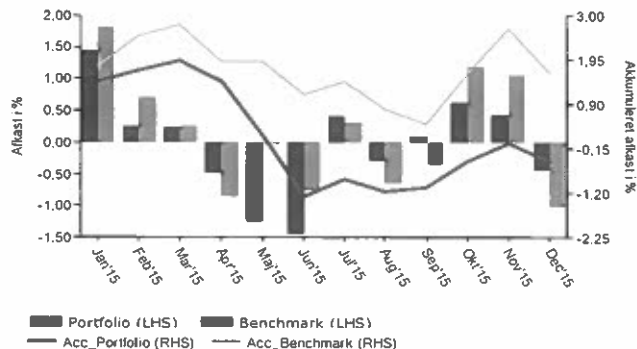
NIFA ID 57330-1451

Karakteristika for porteføljen

	Portefølje	Benchmark
Nøgletal		
Markedsværdi (mio.)	71,59	
Antal beholdninger	448,00	2.569,00
Standardafvigelse (%)	2,45	2,54
Tracking error (%)	2,18	
Sharpe ratio (%)	-0,43	0,37
Information ratio (%)	-0,91	
Treynor (%)	-1,78	

WMT ID 17461926

Afkast - 1 år



WMT ID 15579467

Afkast - år til dato - overblik

Afkast i %	Portefølje	Benchmark	Forskel
<b>Total</b>	<b>-0,46</b>	<b>1,63</b>	<b>-2,09</b>
<b>4. kvartal</b>	<b>0,62</b>	<b>1,20</b>	<b>-0,59</b>
December	-0,43	-1,02	0,59
November	0,42	1,05	-0,62
Oktober	0,63	1,18	-0,56
<b>3. kvartal</b>	<b>0,21</b>	<b>-0,69</b>	<b>0,91</b>
September	0,10	-0,35	0,45
August	-0,29	-0,64	0,34
Juli	0,41	0,30	0,11
<b>2. kvartal</b>	<b>-3,15</b>	<b>-1,60</b>	<b>-1,54</b>
Juni	-1,45	-0,76	-0,68
Maj	-1,24	0,00	-1,24
April	-0,49	-0,85	0,36
<b>1. kvartal</b>	<b>1,93</b>	<b>2,77</b>	<b>-0,85</b>
Marts	0,23	0,26	-0,03
Februar	0,25	0,70	-0,45
Januar	1,44	1,79	-0,36

WMT ID 15673365

Afkast efter gebyrer - år til dato - overblik

Afkast i %	Portefølje	Benchmark	Forskel
<b>Total</b>	<b>-0,64</b>	<b>1,63</b>	<b>-2,27</b>
<b>4. kvartal</b>	<b>0,62</b>	<b>1,20</b>	<b>-0,59</b>
December	-0,43	-1,02	0,59
November	0,42	1,05	-0,62
Oktober	0,63	1,18	-0,56
<b>3. kvartal</b>	<b>0,21</b>	<b>-0,69</b>	<b>0,91</b>
September	0,10	-0,35	0,45
August	-0,29	-0,64	0,34
Juli	0,41	0,30	0,11
<b>2. kvartal</b>	<b>-3,15</b>	<b>-1,60</b>	<b>-1,54</b>
Juni	-1,45	-0,76	-0,68
Maj	-1,24	0,00	-1,24
April	-0,49	-0,85	0,36
<b>1. kvartal</b>	<b>1,74</b>	<b>2,77</b>	<b>-1,03</b>
Marts	0,23	0,26	-0,03
Februar	0,25	0,70	-0,45
Januar	1,25	1,79	-0,54

WMT ID 16239731

Benchmark sammensætning

Benchmark	Vægt i %	Afkast i %	
		KTD	ATD
MSCI World (NDR)	5,00	8,44	10,66
EFFAS Denmark 3-5	85,00	0,60	0,48
JP Morgan EMBI Global diversified	5,00	4,08	12,96
Merrill Lynch EMU Corporate Index Hedged DKK	5,00	1,12	-0,34
<b>Total</b>	<b>100,00</b>	<b>1,20</b>	<b>1,63</b>

WMT ID 419195291

# Danske obligationer

Obligationer - DKK & EUR Obligationer

## Afkast - år til dato - overblik

Afkast i %	Portefølje
<b>Total</b>	<b>-0,69</b>
<b>4. kvartal</b>	<b>0,51</b>
December	-0,28
November	0,44
Oktober	0,35
<b>3. kvartal</b>	<b>0,37</b>
September	0,22
August	-0,12
Juli	0,26
<b>2. kvartal</b>	<b>-3,26</b>
Juni	-1,29
Maj	-1,34
April	-0,66
<b>1. kvartal</b>	<b>1,76</b>
Marts	0,18
Februar	0,12
Januar	1,45

NIM ID 156211307

## Basis nøgletal

	Portefølje
Markedsværdi (mio.)	62,97
Antal beholdninger	18,00
Antal udstedere	3,00
Varighed	6,90
Korrigeret varighed	4,23
Konveksitet	-0,76
Effektiv rente (%)	2,22
Gns. udløbstid (år)	12,82
Standardafvigelse	2,61
Tracking error	2,01
Information ratio	-0,55

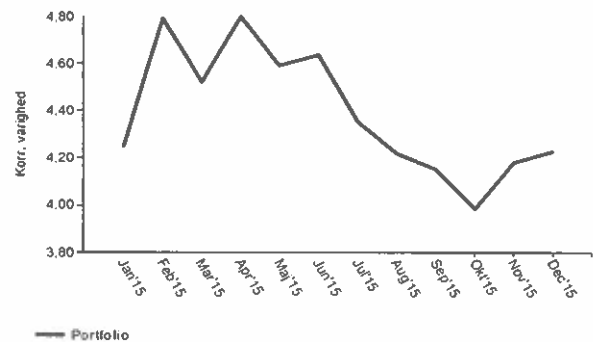
NIM ID 156211307

## Sektorfordeling - DKK obligationssegmenter

Vægt i %	Portefølje
Inkonverterbar realkredit	53,00
Konverterbar realkredit	45,71
Kontant allokering	1,30
<b>Total</b>	<b>100,00</b>

NIM ID 3671214717

## Korr. varighed



NIM ID 162211150

## Horisontafkast - 12 måneder

	Portefølje
Rentefald (-50bp)	4,08
Uændret	2,00
Rentestigning (+50bp)	-0,45

NIM ID 125611156

## Nøglerentersisiko

Nøglerentersisiko	Portefølje
2 år	0,73
5 år	1,08
10 år	1,51
30 år	0,91
<b>Total</b>	<b>4,23</b>

NIM ID 128011160

## Beholdningsliste per: 31.12.2015

(i millioner DKK)

**Total - beholdningsliste, alle instrumenter (handelsdato)**

Porteføje	Valuta	Markedsværdi	% af por.
Slagelse Kommune	DKK	71.587.177,07	100,00

(i millioner DKK)

**Fondscertifikater - beholdningsliste (handelsdato)**

Papir	ISIN	Valuta	Nominal	Børskurs	Valutakurs	Markedsværdi	% af por.
<b>Total</b>						<b>8.608.557,24</b>	<b>12,03</b>
<b>Total obligationsbaserede fonde</b>						<b>8.608.557,24</b>	<b>12,03</b>
NIE Euro Investment Grade	DK0016006857	DKK	33.463.000	105,00398	1,0000	3.513.747,48	4,01
NIE Euro Investment Grade Lückback	DK0016006857	DKK				23.562,94	0,03
Nordea Invest Højrentelån	DK0016254899	DKK	44.439.000	112,62807	1,0000	5.018.410,64	7,01
Nordea Invest Højrentelån Lückback	DK0016254899	DKK				53.805,18	0,08

(i millioner DKK)

**Obligationer - beholdningsliste (handelsdato)**

Papir	ISIN	Valuta	Nominal	Børskurs	Valutakurs	Kursværdi ekskl. rente/udb.	Vedb. rente	Markedsværdi	Rente	Varighed (eff. rente)	Mod. varighed (rente kurve)	Tid til udløb	Kupon	Udløbsdato	% af por.
<b>Total</b>						<b>61.529.826,79</b>	<b>626.060,82</b>	<b>62.159.147,88</b>		<b>6,99</b>	<b>4,28</b>				<b>86,83</b>
<b>Konverterbare realkreditobligationer</b>						<b>36.613.438,16</b>	<b>240.862,30</b>	<b>36.857.557,31</b>		<b>10,31</b>	<b>6,34</b>				<b>51,49</b>
<b>5 - 7 år restløbetid</b>						<b>7.862.943,20</b>	<b>78.883,01</b>	<b>8.071.926,21</b>		<b>4,86</b>	<b>4,83</b>				<b>11,28</b>
1 00 Realkredit Danmark 2021-Jan RT	DK0009295818	DKK	7.920.000.000	100,92100	1,0000	7.902.943,20	78.983,01	8.071.926,21	0,811	4,86	4,83	5,00	1,0000	01-01-2021	11,28
<b>20 år+ restløbetid</b>						<b>28.620.484,86</b>	<b>161.879,29</b>	<b>28.785.631,10</b>		<b>11,84</b>	<b>6,76</b>				<b>40,21</b>
3 CF Realkredit Danmark 2038 IO	DK0006273682	DKK	4.529.757.530	105,00000	1,0000	4.750.245,41	11.853,70	4.768.783,72	1,890	10,20	2,32	0,01	1,0700	01-01-2018	0,06
6 00 Realkredit Danmark 2038	DK0006278210	DKK	15.722.700	112,80000	1,0000	17.735,27	230,71	17.962,75	4,714	9,17	2,08	22,78	0,0000	01-10-2038	0,03
7 00 Nykredit 2041 IO	DK0009772410	DKK	16.805.830	116,30000	1,0000	19.810,78	284,28	20.110,35	5,265	10,15	4,18	25,76	7,0000	01-10-2041	0,03
3 50 Nordea Kredit 2044	DK0009202465	DKK	1.103.611.720	103,25000	1,0000	1.139.470,10	9.446,67	1.149.278,29	3,204	11,81	3,34	28,76	3,5000	01-10-2044	1,61
1 50 Nykredit 2037	DK0009504326	DKK	3.888.878.950	93,20000	1,0000	3.622.571,18	14.258,94	3.636.892,98	2,251	9,53	8,66	21,70	1,5000	01-10-2037	5,08
4 00 Nordea Kredit 2041	DK0009292320	DKK	695.951.420	108,85000	1,0000	743.824,09	6.806,22	750.888,08	3,368	10,51	1,00	25,70	4,0000	01-10-2041	1,05
4 00 Realkredit Danmark 2041	DK0009292320	DKK	342.871.290	107,25000	1,0000	367.729,48	3.354,18	371.244,88	3,362	10,56	1,37	25,70	4,0000	01-10-2041	0,52
3 00 Nordea Kredit 2044	DK0009202800	DKK	587.384.530	100,42500	1,0000	589.805,96	4.182,95	574.645,82	2,996	11,88	5,99	28,76	3,0000	01-10-2044	0,80
3 50 Nykredit 2044	DK0009787398	DKK	2.708.211.430	103,25000	1,0000	2.784.183,30	23.104,57	2.818.090,38	3,251	11,29	3,38	28,76	3,5000	01-10-2044	3,94
2 50 Nordea Kredit 2047	DK0009203083	DKK	2.708.072.700	95,50000	1,0000	2.581.782,43	47.131,63	2.468.301,96	2,884	13,06	6,50	31,76	2,5000	01-10-2047	10,35
2 50 Realkredit Danmark 2047	DK0009292559	DKK	2.589.552.320	95,47500	1,0000	2.472.375,08	15.832,86	2.488.301,96	2,884	13,06	8,62	31,76	2,5000	01-10-2047	3,48
2 00 Nykredit 2047	DK0009504198	DKK	5.182.749.780	91,75000	1,0000	4.755.172,92	25.350,38	4.780.885,94	2,666	13,30	10,22	31,76	2,0000	01-10-2047	6,68
<b>Ovrige inkonvertible obligationer</b>						<b>24.916.388,54</b>	<b>385.198,52</b>	<b>25.301.590,57</b>		<b>2,16</b>	<b>1,28</b>				<b>35,34</b>
<b>1 - 3 år restløbetid</b>						<b>22.838.718,94</b>	<b>357.046,89</b>	<b>23.296.772,34</b>		<b>2,07</b>	<b>1,13</b>				<b>32,54</b>
4 00 Nykredit 2018 H	DK0009783375	DKK	7.810.000.000	107,03000	1,0000	8.405.903,00	311.544,11	8.717.447,11	0,180	1,90	1,90	2,00	4,0000	01-01-2018	12,18
2 00 Nykredit 01-07-2017 H	DK0009791980	DKK	4.290.000.000	102,95800	1,0000	4.416.812,40	-2.900,00	4.459.712,40	0,029	1,48	1,49	1,50	2,0000	01-07-2017	0,23
FRN CITA+35 Nykredit 2018-07-01	DK0009506988	DKK	2.830.903.430	90,54000	1,0000	2.817.681,27	-389,11	2.817.491,42	0,349	2,49	2,49	0,01	-0,0562	01-01-2018	3,94

(i millioner DKK)

(i millioner DKK)



Papir	ISIN	Valuta	Nominel	Beskurt	Valutakurs	Kursværdi ekskl. rentekøb	Vedh. rente	Markedsværdi	Rente	Vægtighed (eff. rente)	Mod. vægtighed (rentekurve)	Tid til udløb	Kupon	Udløbsdato	% af port.
FRN CIBOR3M+15 Nykredit 2018-07-01	DK0006507188	DKK	7 310 617 2000	60.72000	1.0000	7 260 122.27	2 004.69	7 302 121.41	0.370	2.48	0.24	0.01	0.1673	01-01-2018	10.20
3 - 5 år restløbetid						1 876 668.60	28 148.63	2 004 818.23		3.14	3.13				2.89
2 00 Realkredit Danmark 2019-Apr T	DK0000280068	DKK	1 890 000 0000	105.14200	1.0000	1 876 668.60	28 148.63	2 004 818.23	0.405	3.14	3.13	3.25	2.0000	01-04-2019	2.80

14.10.2015 10:49

\* = udtrukne obligationer

Kontanter - beholdningsliste (handelsdato)

Papir	Valuta	Nominel	Valutakurs	Vedh. rente	Markedsværdi	% af port.
<b>Total</b>					<b>818.471,95</b>	<b>1,14</b>
<b>Danske obligationer</b>					<b>815.600,75</b>	<b>1,14</b>
Kontant allokering DKK	DKK	814 822 5100	1.0000	778 24	815 600.75	1.14
<b>Pengemarkedskonto</b>					<b>2.871,20</b>	<b>0,00</b>
Kontant allokering DKK	DKK	2 849 9500	1.0000	21 25	2 871 20	0.00

14.10.2015 10:49

## Transaktionsliste

2015-12-31

## Transaktionsliste - inddelt efter instrumenttype, transaktionstype, kvartal til dato

Papir	ISIN	Handels- dato	Afvirkings- dato	Nominal	Handelskurs	Valutakurs	Kursværdi ekskl. rent/udb.	Værdi, rent/ udb.	Handelsomk.	Afregningsbef. i basisvaluta
<b>Total</b>								256.305,38	0,00	-65.669,38
<b>Aktivpassiv instrumenter</b>										
<b>Total Indskud / Udtræk fra kontantkonto</b>										
Custody Fee		01-12-2015	01-12-2015	-15.0000	1.00000	1.0000	-15,00	0,00	0,00	-222,00
Custody Fee		10-12-2015	10-12-2015	-207.0000	1.00000	1.0000	-207,00	0,00	0,00	-15,00
<b>Fondscertifikater</b>										
<b>Total Fonds salg</b>										
NIE Euro Investment Grade	DK0010008657	18-11-2015	23-11-2015	-33.854.0000	105.90000	1.0000	-3.587.100,84	0,00	0,00	3.587.169,84
<b>Obligationer</b>										
<b>Total Fondssalg</b>										
FRN CIBOR3M+15 Nykredit 2018-07-01	DK0006507188	08-10-2015	08-10-2015	870.000.0000	98.50500	1.0000	855.693,50	-216.854,78	0,00	-19.702.343,37
4 00 Realkredit Danmark 2016 S	DK0000278987	18-11-2015	20-11-2015	4.120.000.0000	100.51230	1.0000	4.141.108,76	-27,00	0,00	-805.721,10
1 00 Realkredit Danmark 2021-Jan RT	DK0000295818	18-11-2015	20-11-2015	4.120.000.0000	101.58450	1.0000	4.185.281,40	-38.459,18	0,00	-4.221.740,58
FRN CIBOR3M+15 Nykredit 2018-07-01	DK0006507188	19-10-2015	21-10-2015	0.460.000.0000	99.57500	1.0000	0.432.545,00	-587,37	0,00	-0.433.132,37
1 00 Realkredit Danmark 2021-Jan RT	DK0000295818	20-11-2015	24-11-2015	3.800.000.0000	101.50900	1.0000	3.860.791,92	-34.043,84	0,00	-3.804.805,76
<b>Total Fondssalg</b>										
4 00 Realkredit Danmark, 2016 S	DK0000278987	18-11-2015	20-11-2015	-4.120.000.0000	100.51230	1.0000	-4.141.108,76	145.830,71	0,00	4.288.943,47
2 00 Nykredit 2017-Apr H	DK0000786550	18-11-2015	20-11-2015	-4.190.000.0000	102.82000	1.0000	-4.308.158,00	53.348,00	0,00	4.301.506,00
2 00 Nykredit 2016-H IT	DK0000787872	18-10-2015	21-10-2015	-6.490.000.0000	100.45000	1.0000	-6.480.070,00	103.713,07	0,00	6.592.783,07
<b>Total Renter</b>										
4 00 Nordea Kredit 2041	DK0002023200	01-10-2015	01-10-2015	0.0000	0.00000	1.0000	0,00	178.361,46	0,00	168.563,36
3 50 Nordea Kredit 2044	DK0002027465	01-10-2015	01-10-2015	0.0000	0.00000	1.0000	0,00	8.078,95	0,00	8.078,95
3 00 Nordea Kredit 2044	DK0002028000	01-10-2015	01-10-2015	0.0000	0.00000	1.0000	0,00	10.440,21	0,00	10.440,21
2 50 Nordea Kredit 2047	DK0002030683	01-10-2015	01-10-2015	0.0000	0.00000	1.0000	0,00	4.393,82	0,00	4.393,82
5 CF Realkredit Danmark 2038 IO	DK0000273862	01-10-2015	01-10-2015	0.0000	0.00000	1.0000	0,00	48.789,19	0,00	48.789,19
6 00 Realkredit Danmark 2038	DK0000278210	01-10-2015	01-10-2015	0.0000	0.00000	1.0000	0,00	10.750,00	0,00	10.750,00
4 00 Realkredit Danmark 2041	DK0000282320	01-10-2015	01-10-2015	0.0000	0.00000	1.0000	0,00	205,58	0,00	205,58
2 50 Realkredit Danmark 2047	DK0000282550	01-10-2015	01-10-2015	0.0000	0.00000	1.0000	0,00	3.808,00	0,00	3.808,00
2 00 Nykredit 2047	DK00009504189	01-10-2015	01-10-2015	0.0000	0.00000	1.0000	0,00	10.383,23	0,00	18.383,23
1 50 Nykredit 2037	DK00006504326	01-10-2015	01-10-2015	0.0000	0.00000	1.0000	0,00	20.251,34	0,00	26.251,34
FRN CITA+35 Nykredit 2018-07-01	DK0000950896	01-10-2015	01-10-2015	0.0000	0.00000	1.0000	0,00	14.808,38	0,00	14.808,38
7 00 Nykredit 2041 IO	DK0000273410	01-10-2015	01-10-2015	0.0000	0.00000	1.0000	0,00	399,02	0,00	-399,02
3 50 Nykredit 2044	DK0000787368	01-10-2015	01-10-2015	0.0000	0.00000	1.0000	0,00	232,85	0,00	232,85
<b>Total Udtrækninger</b>										
FRN CITA+35 Nykredit 2018-07-01	DK0000950896	01-10-2015	01-10-2015	-399.0200	100.04511	1.0000	-399,20	0,00	0,00	638.844,26
4 00 Nordea Kredit 2041	DK0002023200	29-12-2015	04-01-2016	-47.870.9800	100.00000	1.0000	-47.870,98	0,00	0,00	399,20
3 50 Nordea Kredit 2044	DK0002027465	29-12-2015	04-01-2016	-41.183.3600	100.00000	1.0000	-41.183,39	0,00	0,00	47.870,98
3 00 Nordea Kredit 2044	DK0002028000	29-12-2015	04-01-2016	-10.454.8500	100.00000	1.0000	-10.454,85	0,00	0,00	41.183,39
2 50 Nordea Kredit 2047	DK0002030683	29-12-2015	04-01-2016	-49.313.7000	100.00000	1.0000	-49.313,70	0,00	0,00	10.454,85
5 CF Realkredit Danmark 2038 IO	DK0000273862	29-12-2015	04-01-2016	-261.018.5700	104.57000	1.0000	-273.572,45	0,00	0,00	49.313,70
6 00 Realkredit Danmark 2038	DK0000278210	29-12-2015	04-01-2016	-1.143.0800	100.00000	1.0000	-1.143,08	0,00	0,00	273.572,45

Papir	ISIN	Handels- dato	Afhjælps- dato	Nominal	Handelskurs	Valutakurs	Kursværdi ekskl. renteskdb.	Vedh. rente/ inf.	Handelskonk.	Afregningsbetegnelse
4.00 Realkredit Danmark, 2041	DK0000282320	29-12-2015	04-01-2016	-10 482 1500	100 00000	1 0000	-10 482 15	0,00	0,00	10 482 15
2.50 Realkredit Danmark, 2047	DK0000282550	29-12-2015	04-01-2016	-15 377 0500	100 00000	1 0000	-15 377 05	0,00	0,00	15 377 05
2.00 Nykredit 2047	DK0000504100	29-12-2015	04-01-2016	-33 250 2400	100 00000	1 0000	-33 250 24	0,00	0,00	33 250 24
1.50 Nykredit 2037	DK0000504320	29-12-2015	04-01-2016	-44 393 2000	100 00000	1 0000	-44 393 20	0,00	0,00	44 393 20
FRN CITI+35 Nykredit 2018-07-01	DK0000506900	29-12-2015	04-01-2016	-5 385 9000	100 00000	1 0000	-5 385 90	0,00	0,00	5 385 90
FRN CIBOR3M+15 Nykredit 2018-07-01	DK0000507150	29-12-2015	04-01-2016	-10 382 8000	100 00000	1 0000	-10 382 80	0,00	0,00	10 382 80
7.00 Nykredit 2041 IO	DK0000772410	29-12-2015	04-01-2016	-894 4800	100 00000	1 0000	-894 48	0,00	0,00	894 48
3.50 Nykredit 2044	DK0000787368	29-12-2015	04-01-2016	-89 079 6800	100 00000	1 0000	-89 079 68	0,00	0,00	89 079 68
<b>Pengemarkedskonto</b>										
<b>Total Indtækt / Udtræk fra konstantkonto</b>										
Nordea Bank Danmark A/S - DKK - 8074309260		30-10-2015	30-10-2015	-15 0000	1 00000	1 0000	-15 00	0,00	0,00	-15 00

10/31/2015 11:45:00

## Ansvarsfraskrivelse og vigtige oplysninger

Nordea Investment Management (NIM) modtager visse oplysninger i rapporteringsmaterialet (fx værdiansættelse af værdipapirer, ratings og information om masterdata) fra eksterne informationsudbydere. Selvom oplysningerne indhentes fra kilder, der anses for at være pålidelige, er hverken NIM eller informationsudbydere ansvarlige for fejl, forsinkelser, afbrydelser eller udeladelser i forbindelse med oplysningerne. NIM og de eksterne informationsudbydere kan ikke garantere, at oplysningerne er nøjagtige, fuldstændige eller helt opdaterede. Informationsudbydere har ophavsret eller andre immaterielle rettigheder til oplysningerne. Selvom NIM har søgt at sikre, at oplysningerne afgivet i den daglige rapportering er nøjagtige, fuldstændige og pålidelige (herunder, men ikke begrænset til, værdiansættelse og opgørelser over transaktioner og beholdninger), påtager NIM sig intet ansvar herfor. Brugere af oplysningerne accepterer, at oplysningerne kan ændres uden varsel.

Visse informationsudbydere kræver en direkte relation med kunden for at tillade, at NIM udsender fx ratingmeddelelser. NIM giver kun disse oplysninger til kunden, hvis en sådan relation etableres, og kunden skal orientere NIM, hvis en sådan relation med informationsudbyderen ophører.

Oplysningerne i rapporteringen må hverken helt eller delvist videregives til andre eller anvendes til andre formål.

Henvisninger til eller bemærkninger om bestemte værdipapirer på listen skal ikke ses som informationsudbydernes anbefaling om at købe, sælge eller eje de pågældende værdipapirer eller træffe andre investeringsbeslutninger. Informationsudbydere har ingen kontrol over eller indflydelse på, hvem der modtager oplysningerne, og er ikke ansvarlige for oplysningernes levering, modtagelse eller indhold. Informationsudbydere er under ingen omstændigheder ansvarlige for direkte, indirekte, særlige skader eller følgeskader i forbindelse med anvendelsen af data eller oplysninger i rapporten.