

Halvårsrapport beholdning

Maj Invest Afdeling Danske Obligationer

Urevideret specifikation af børsnoterede finansielle instrumenter jvf. §42 stk. 2 i Bekendtgørelse om finansielle rapporter for investeringsforeninger og specialforeninger m.v.

Værdipapir	Valuta	31-12-2011				30-06-2012			
		Antal/nom	Valutakurs	Kurs	Kursværdi	Antal/nom	Valutakurs	Kurs	Kursværdi
Noterede obligationer fra danske udstedere									
2% RD 10T 2017	DKK	27.000.000	100,000	101,570	27.423.900				0
2% RD SDO 1 1-2013	DKK	10.000.000	100,000	101,250	10.125.000				0
2,00 BRFKREDIT 321 B.RTL 1 1-2013	DKK	3.000.000	100,000	100,850	3.025.500	3.000.000	1,000	100,860	3.025.800
2,00 DLR ST.L INK B 2015	DKK	15.000.000	100,000	102,250	15.337.500	15.000.000	1,000	102,650	15.397.500
2,00 NYKREDIT 12E B OK NC 2015	DKK	7.000.000	100,000	102,800	7.196.000	7.000.000	1,000	103,530	7.247.100
2,00 NYKREDIT 12H B AP NC 2013	DKK				0	10.000.000	1,000	101,250	10.125.000
2,75 REALKREDIT DANMARK T SRFIX OKT 2015	DKK				0	25.000.000	1,000	101,530	25.382.500
3,00 DANSK STATSLÅN ST LÅN (INK) 2021	DKK				0	10.000.000	1,000	113,500	11.350.000
3,00 NORDEA ANNUITETSLÅN 2034	DKK				0	12.000.000	1,000	98,050	11.766.000
3,00 REALKREDIT DANMARK 21S.S 2029	DKK				0	27.537.492	1,000	100,100	27.565.030
3,00 REALKREDIT DANMARK 22S.SA 2034	DKK				0	14.000.000	1,000	98,150	13.741.000
3,72% Roskilde Bank 10 6-13	DKK	1.000.000	100,000	0,000	0				0
4,00 BRFKREDIT 321.E 2014	DKK	20.000.000	100,000	105,800	21.160.000	20.000.000	1,000	105,350	21.070.000
4,00 DANSK STATSLÅN ST LÅN (INK) 2012	DKK	100.000	100,000	103,540	103.540	100.000	1,000	101,580	101.580
4,00 DANSK STATSLÅN ST.LÅN (INK) 2015	DKK	100.000	100,000	113,660	113.660	100.000	1,000	112,810	112.810
4,00 NORDEA ANNUITETSLÅN 2041	DKK	60.475.602	100,000	101,575	61.428.092	25.000.000	1,000	102,350	25.587.500
4,00 NYKREDIT 01E A 2031	DKK				0	22.000.000	1,000	103,060	22.673.200
4,00 NYKREDIT 01E A 2041	DKK				0	30.000.000	1,000	102,050	30.615.000
4,00 NYKREDIT 01E A 2044	DKK				0	17.863.313	1,000	101,550	18.140.195
4,00 REALKREDIT DANMARK 22S.S 2031	DKK	18.753.732	100,000	102,925	19.302.278	16.747.228	1,000	103,650	17.358.501
4,00 REALKREDIT DANMARK 23S.SA 2044	DKK				0	19.500.000	1,000	101,550	19.802.250
4,00 REALKREDIT DANMARK 27S.S.OA 2044	DKK	19.992.426	100,000	99,525	19.897.462	466.332	1,000	100,850	470.296
5% Nykredit 73D OA 2038	DKK	36.577.682	100,000	104,275	38.141.378				0
5% Real.Danmark 2038	DKK	21.852.586	100,000	103,875	22.699.374				0
5,00 BRFKREDIT 111.E.41 2041	DKK	10.876.137	100,000	103,750	11.283.992	5.309.993	1,000	103,400	5.490.533
5,00 BRFKREDIT 411.E.OA 2041	DKK	4.460.055	100,000	103,400	4.611.697	28.047.721	1,000	103,200	28.945.248
5,00 BRFKREDIT 411B OA 2038	DKK				0	17.430.437	1,000	104,000	18.127.654
5,00 DANSK STATSLÅN ST LÅN (INK) 2013	DKK	100.000	100,000	109,320	109.320	100.000	1,000	107,070	107.070
5,00 KOMMUNEKREDIT 200 S A (Æ2032) 2031	DKK	1.016.245	100,000	101,750	1.034.029	420.109	1,000	101,500	426.410
5,00 LANDBRUGS REALKREDITFOND 43 S OA 20	DKK	6.436.572	100,000	103,900	6.687.598	4.288.973	1,000	103,950	4.458.387
5,00 NORDEA ANNUITETSLÅN 2038	DKK	2.785.948	100,000	104,650	2.915.494	1.903.703	1,000	104,675	1.992.701
5,00 NORDEA ANNUITETSLÅN 2041	DKK	34.824.482	100,000	103,675	36.104.282	5.370.482	1,000	103,710	5.569.727
5,00 NORDEA OA30 2041	DKK				0	15.000.000	1,000	103,250	15.487.500
5,00 REALKREDIT DANMARK 27S.S.OA 2041	DKK	8.813.374	100,000	103,500	9.121.842	3.920.468	1,000	103,200	4.045.923
5,50 BRFKREDIT 6 S 2014	DKK	10.519.249	100,000	103,500	10.887.423	7.800.475	1,000	103,000	8.034.489
6,00 NORDEA ANNUITETSLÅN OA10 2041	DKK	3.853.754	100,000	106,400	4.100.395	2.236.595	1,000	106,150	2.374.146
7,00 DANSK STATSLÅN ST LÅN (INK) 2024	DKK	100.000	100,000	158,150	158.150	100.000	1,000	158,632	158.632
7,00 NORDEA ANNUITETSLÅN 2041	DKK	572.111	100,000	111,025	635.186	298.204	1,000	110,600	329.814

8,00 SPARBANK FRN 2010 2020	DKK	8.000.000	100,000	100,000	8.000.000	8.000.000	1,000	100,000	8.000.000
BANKNORDIK HYBRID FRN PERP CALL	DKK	15.000.000	100,000	91,000	13.650.000	15.000.000	1,000	91,000	13.650.000
FRN Vestjysk Bank 17 5-13 Stat	DKK	25.000.000	100,000	100,055	25.013.750				0
NYKREDIT VAR. 21E 500CF6DA 2021	DKK	22.964.694	100,000	95,910	22.025.438	456.919	1,000	98,370	449.472
SPAREKASSEN VENDSYSSEL ANSV.KAP FRN 2022	DKK				0	4.000.000	1,000	100,000	4.000.000
TOPDANMARK ANSV.KAP. 2019	DKK	13.000.000	100,000	106,500	13.845.000	13.000.000	1,000	108,750	14.137.500
Udtrukne	DKK				23.116.233				27.516.800
I alt i DKK					439.253.514				444.833.268
I alt for noterede obligationer fra danske udstedere					439.253.514				444.833.268
Noterede obligationer fra udenlandske udstedere									
2,00 CITIGROUP FUNDING INC. 2005 2015	DKK	24.800.000	100,000	91,250	22.630.000	24.800.000	1,000	96,000	23.808.000
2,00 KALVEBOD PLC S.2 1 5-2006 2106	DKK	1.162.353	100,000	32,250	374.859	856.471	1,000	53,240	455.985
KALVEBOD PLC S.3 FRN 1 11-2006 2014	DKK	13.936.209	100,000	45,000	6.271.294	10.189.916	1,000	53,530	5.454.662
I alt i DKK					29.276.153				29.718.647
I alt for noterede obligationer fra udenlandske udstedere					29.276.153				29.718.647
I alt i afdelingen					468.529.667				474.551.915