

Årsrapport 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				31-12-2012			
		Antal/nom	Valutakurs	Kurs	Kursværdi	Antal/nom	Valutakurs	Kurs	Kursværdi
Noterede obligationer fra danske udstedere									
2% BRF 321.B St.L. 1 1-13	DKK	3.000.000	100,000	100,850	3.025.500				0
2% DLR Kredit 1 1 2015	DKK	15.000.000	100,000	102,250	15.337.500				0
2% Nykredit SDO 1 10-15	DKK	7.000.000	100,000	102,800	7.196.000				0
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 OK 1 10-2015	DKK				0	30.000.000	100,000	103,570	31.071.000
2,00 DLR ST L INK B 2017	DKK				0	7.000.000	100,000	103,660	7.256.200
2,00 NORDEA (INK) OKT 2017	DKK				0	10.000.000	100,000	104,434	10.443.400
2,00 NYKREDIT 01E A 2034	DKK				0	13.615.849	100,000	95,450	12.996.328
2,00 REALKREDIT DANMARK 10T JA (INK) 201	DKK				0	15.000.000	100,000	101,715	15.257.250
2,00 REALKREDIT DANMARK 21S.S 2029	DKK				0	9.824.174	100,000	98,975	9.723.477
2,75 REALKREDIT DANMARK T SRFIX OKT 2015	DKK				0	25.000.000	100,000	103,360	25.840.000
3,00 BRFKREDIT 111.E 2034	DKK				0	4.885.466	100,000	100,505	4.910.138
3,00 DANSK STATSLÅN ST LÅN (INK) 2021	DKK				0	100.000	100,000	116,440	116.440
3,00 NORDEA ANNUITETSLÅN 2034	DKK				0	11.822.350	100,000	101,625	12.014.463
3,00 REALKREDIT DANMARK 21S.S 2029	DKK				0	25.947.699	100,000	102,750	26.661.261
3,00 REALKREDIT DANMARK 22S.SA 2034	DKK				0	13.787.015	100,000	101,525	13.997.267
3,50 REALKREDIT DANMARK 23S.SA 2044	DKK				0	17.225.011	100,000	101,600	17.500.612
3,72% Roskilde Bank 10 6-13	DKK	1.000.000	100,000	0,000	0				0
4% BRF 321 E 2014	DKK	20.000.000	100,000	105,800	21.160.000				0
4% Danske Stat 15 11 2012	DKK	100.000	100,000	103,540	103.540				0
4,00 BRFKREDIT 321.E 2018	DKK				0	3.000.000	100,000	113,360	3.400.800
4,00 DANSK STATSLÅN ST.LÅN (INK) 2015	DKK	100.000	100,000	113,660	113.660	100.000	100,000	111,680	111.680
4,00 NORDEA ANNUITETSLÅN 2041	DKK	60.475.602	100,000	101,575	61.428.092	12.177.816	100,000	104,225	12.692.328
4,00 NYKREDIT 01E A 2026	DKK				0	22.342.932	100,000	105,900	23.661.165
4,00 NYKREDIT 01E A 2031	DKK				0	18.573.461	100,000	105,200	19.539.281
4,00 NYKREDIT 01E A 2041	DKK				0	2.806.485	100,000	104,100	2.921.551
4,00 NYKREDIT 01E A 2044	DKK				0	16.488.522	100,000	104,050	17.156.307
4,00 NYKREDIT 12H B JA NC 2018	DKK				0	8.000.000	100,000	114,310	9.144.800
4,00 REALKREDIT DANMARK 21S.S 2026	DKK				0	1.206.533	100,000	106,350	1.283.148
4,00 REALKREDIT DANMARK 22S.S 2031	DKK	18.753.732	100,000	102,925	19.302.278	12.486.704	100,000	105,500	13.173.473
4,00 REALKREDIT DANMARK 27S.S.OA 2044	DKK	19.992.426	100,000	99,525	19.897.462	447.997	100,000	104,050	466.141
4,00 TOTALKREDIT 111 C S 2035	DKK				0	12.194.062	100,000	105,600	12.876.929
5% Nordea 1 10-41	DKK	34.824.482	100,000	103,675	36.104.282				0
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	3.307.104	100,000	106,400	3.518.759
5,00 BRFKREDIT 411.E.OA 2041	DKK	4.460.055	100,000	103,400	4.611.697	26.337.300	100,000	106,450	28.036.056

5,00 BRFKREDIT 411B OA 2038	DKK				0	11.222.339	100,000	106,550	11.957.402
5,00 DANSK STATSLÅN ST LÅN (INK) 2013	DKK	100.000	100,000	109,320	109.320	100.000	100,000	104,470	104.470
5,00 KOMMUNEKREDIT 200 S A (Æ2032) 2031	DKK	1.016.245	100,000	101,750	1.034.029	404.535	100,000	103,000	416.671
5,00 LANDBRUGS REALKREDITFOND 43 S OA 20	DKK	6.436.572	100,000	103,900	6.687.598	2.720.825	100,000	105,340	2.866.117
5,00 NORDEA ANNUITETSLÅN 2038	DKK	2.785.948	100,000	104,650	2.915.494	1.167.062	100,000	106,525	1.243.213
5,00 NORDEA OA30 2041	DKK				0	10.105.636	100,000	106,600	10.772.608
5,00 NYKREDIT 01E A 2041	DKK				0	3.627.590	100,000	106,550	3.865.198
5,00 REALKREDIT DANMARK 27S.S.OA 2041	DKK	8.813.374	100,000	103,500	9.121.842	1.938.593	100,000	106,375	2.062.178
5,50 BRFKREDIT 6 S 2014	DKK	10.519.249	100,000	103,500	10.887.423	5.559.444	100,000	103,250	5.740.126
6% Nordea OA 10.41	DKK	3.853.754	100,000	106,400	4.100.395				0
7,00 DANSK STATSLÅN ST LÅN (INK) 2024	DKK	100.000	100,000	158,150	158.150	100.000	100,000	162,780	162.780
7,00 NORDEA ANNUITETSLÅN 2041	DKK	572.111	100,000	111,025	635.186	217.353	100,000	112,750	245.065
8,00 SPARBANK FRN 2010 2020	DKK	8.000.000	100,000	100,000	8.000.000	8.000.000	100,000	100,000	8.000.000
BANKNORDIK HYBRID FRN PERP CALL	DKK	15.000.000	100,000	91,000	13.650.000	15.000.000	100,000	102,000	15.300.000
BIG 6 PLUS BONUSRENTE 2006 2013	DKK				0	15.000.000	100,000	100,100	15.015.000
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	456.588	100,000	99,250	453.164
SPAREKASSEN VENDSYSSEL ANSV.KAP FRN 2022	DKK				0	4.000.000	100,000	100,000	4.000.000
TOPDANMARK ANSV.KAP. 2019	DKK	13.000.000	100,000	106,500	13.845.000	13.000.000	100,000	110,500	14.365.000
Udtrukne	DKK				23.116.233				22.839.979
I alt i DKK					439.253.514				455.179.222
9,00 NYKREDIT REALKREDIT FRN PERP CALL	EUR				0	1.600.000	746,095	108,028	12.895.864
I alt i EUR					0				12.895.864
I alt for noterede obligationer fra danske udstedere					439.253.514				468.075.086
Noterede obligationer fra udenlandske udstedere									
2% Citigroup 2015	DKK	24.800.000	100,000	91,250	22.630.000				0
2,00 KALVEBOD PLC S.2 1 5-2006 2106	DKK	1.162.353	100,000	32,250	374.859	856.471	100,000	42,130	360.831
KALVEBOD PLC S.3 FRN 1 11-2006 2014	DKK	13.936.209	100,000	45,000	6.271.294	8.691.399	100,000	66,000	5.736.323
I alt i DKK					29.276.153				6.097.154
3,875 CZECH (REPUBLIC) 24 5-12 2022	EUR				0	1.300.000	746,095	114,560	11.111.424
I alt i EUR					0				11.111.424
I alt for noterede obligationer fra udenlandske udstedere					29.276.153				17.208.579
I alt i afdelingen					468.529.667				485.283.664