

Årsrapport beholdning

MAJ INVEST AFDELING OBLIGATIONER

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

Værdipapir	31-12-2010					31-12-2011				
	Valuta	Antal/nom	Valutakurs	Kurs	Kursværdi	Antal/nom	Valutakurs	Kurs	Kursværdi	
Noterede obligationer fra danske udstedere										
2% BRF 1 10-12	DKK				0	15.000.000	100,000	100,835	15.125.250	
2% DLR Kredit 1 1 2015	DKK				0	5.000.000	100,000	102,250	5.112.500	
2% Nykredit 1 4 2013 SDO	DKK				0	18.000.000	100,000	101,360	18.244.800	
2% RD SDO 1 1-2013	DKK				0	15.000.000	100,000	101,250	15.187.500	
4% BRF 321 E 2014	DKK	4.200.000	100,000	105,050	4.412.100				0	
4% Danske Stat st.l. 15 11-19	DKK	22.000.000	100,000	107,740	23.702.800				0	
4% Nykredit O1 01-16	DKK				0	4.000.000	100,000	109,150	4.366.000	
4% Real Danmark SDR0 1 10-44	DKK				0	14.994.319	100,000	99,525	14.923.096	
5% DLR 43SOA 2038	DKK	3.457.413	100,000	100,970	3.490.950	2.822.190	100,000	103,900	2.932.255	
5% Danske Stat St. lån 2013	DKK	150.000	100,000	110,225	165.338	150.000	100,000	109,320	163.980	
5% Nordea 2038	DKK	3.985.726	100,000	102,050	4.067.433	3.333.709	100,000	104,650	3.488.726	
5% Nordea 2038	DKK	4.865.767	100,000	101,550	4.941.187	4.063.372	100,000	104,000	4.225.907	
5% Nykredit 1 10-41 SDO	DKK				0	15.205.731	100,000	104,000	15.813.961	
5% Nykredit 73D 0A 2038	DKK	4.766.105	100,000	101,330	4.829.494	3.775.176	100,000	104,275	3.936.565	
5% Real.Danmark 1 10-41 SDO	DKK				0	3.560.538	100,000	104,150	3.708.301	
5% Real.Danmark 2038	DKK	6.504.608	100,000	101,650	6.611.934	5.307.057	100,000	103,875	5.512.705	
5% Real.Danmark 44.s. 2014	DKK	3.640.669	100,000	103,500	3.768.092	2.318.175	100,000	102,250	2.370.334	
6% Danske Stat St. lån 2011	DKK	100.000	100,000	104,540	104.540				0	
6% Nordea OA 10.41	DKK	640.829	100,000	104,425	669.186	411.600	100,000	106,400	437.942	
6% Nykredit O1E DA 2041	DKK	1.712.207	100,000	105,000	1.797.817	1.033.778	100,000	105,450	1.090.119	
7% Danske Stat St. lån 2024	DKK	150.000	100,000	141,000	211.500	150.000	100,000	158,150	237.225	
7% Nordea Kredit 1 10-41	DKK	124.762	100,000	106,140	132.423	63.133	100,000	110,150	69.541	
7% RD 23S. SA 2041 SDO	DKK	447.537	100,000	106,225	475.396	283.421	100,000	110,500	313.181	
7% Realkredit Danmark 2041	DKK	209.651	100,000	106,225	222.702	136.771	100,000	110,600	151.269	
FRN Totalkredit 2038	DKK	1	100,000	98,100	1	1	100,000	100,900	1	
Udtrukne	DKK				6.606.748				5.909.030	
I alt i DKK					66.209.640				123.320.188	
4,25% Danske Bank 20 6-16	EUR	400.000	745,245	95,750	2.854.290				0	
4,5% Tryg Forsikring 2025	EUR	800.000	745,245	89,445	5.332.678	800.000	743,235	91,028	5.412.416	
7,75% Dong Energy 1 6-3010	EUR				0	600.000	743,235	104,322	4.652.137	
FRN Danske Bank 20 3-2016	EUR				0	553.000	743,235	98,438	4.045.890	
FRN FIH 26 3-13	EUR	800.000	745,245	96,000	5.723.485	800.000	743,235	94,586	5.623.970	
FRN Jyske Bank 2013	EUR				0	500.000	743,235	97,457	3.621.673	
FRN Sydbank 2049	EUR	1.100.000	745,245	65,000	5.328.505	1.100.000	743,235	53,000	4.333.060	
I alt i EUR					19.238.957				27.689.145	
FRN Danske Bank 15 2-17	GBP	500.000	869,731	84,700	3.683.310	500.000	889,775	71,478	3.179.967	
I alt i GBP					3.683.310				3.179.967	
I alt for noterede obligationer fra danske udstedere					89.131.907				154.189.300	

Noterede obligationer fra udenlandske udstedere

3,5% E.I.B. 28 1-14	CHF	1.500.000	595,955	108,018	9.656.087					0
I alt i CHF					9.656.087					0
2% Kalvebod S. 01 11-14	DKK	2.900.000	100,000	76,220	2.210.380	2.490.967	100,000	45,000		1.120.935
2% Citigroup 2015	DKK	2.000.000	100,000	87,050	1.741.000	2.000.000	100,000	91,250		1.825.000
I alt i DKK					3.951.380					2.945.935
3,5% Bundesrep. Deut. 4 7-19	EUR				0	1.000.000	743,235	114,586		8.516.433
FRN Mare Baltic 1 11-15	EUR	246.789	745,245	59,000	1.085.117	232.687	743,235	30,680		530.583
FRN Mare Baltic 17 11-14	EUR				0	119.709	743,235	76,330		679.122
10% ASR Nederland 26 10-49	EUR				0	500.000	743,235	100,500		3.734.756
6,875% Rabobank 19 3-20	EUR	600.000	745,245	94,560	4.228.224	600.000	743,235	85,482		3.811.993
9% Srlev 15 4-41	EUR				0	700.000	743,235	65,296		3.397.114
FRN ABN AMRO 03 49	EUR	600.000	745,245	69,060	3.087.999					0
2,5% Sparebank Vest Bol 9 6-15	EUR	750.000	745,245	98,920	5.528.976					0
2,5% Sparebk 1 Blkrdt23 6-15SDO	EUR	800.000	745,245	98,980	5.901.151					0
2,5% Skandinav Ensk 17 6-15SDO	EUR	750.000	745,245	99,462	5.559.259					0
I alt i EUR					25.390.726					20.670.000
8% Mexico 17 12-15	MXN				0	15.000.000	41,026	109,378		6.731.021
I alt i MXN					0					6.731.021
6% Stadshypotek 16 12-15 SDO	SEK	9.000.000	82,627	109,022	8.107.296	9.000.000	83,517	112,700		8.471.143
I alt i SEK					8.107.296					8.471.143
0,50% US Treasury 30 11-12	USD				0	2.000.000	572,535	100,316		11.486.931
3,875% US Treasury 15 8 2040	USD	800.000	555,490	92,266	4.100.209					0
I alt i USD					4.100.209					11.486.931
I alt for noterede obligationer fra udenlandske udstedere					51.205.697					50.305.031
I alt i afdelingen					140.337.604					204.494.330