

# Jyske Capital

OKTOBER 2021

---

 JYSKE BANK

Roskilde Stift  
Stændertorvet 3A  
4000  
Roskilde  
Danmark

Jyske Capital Clients  
Jyske Bank A/S  
Vestergade 8-16  
DK 8600 Silkeborg  
+45 89 89 70 43  
[cm.clientservice@jyskebank.dk](mailto:cm.clientservice@jyskebank.dk)  
SWIFT: JYBADKKK  
CVR: 17616617

## Rapportering af kapitalforvaltning



## **Roskilde Stift**

Periode: 01.01.2021 - 31.10.2021

### **Rapportering på kapitalforvaltningsaftale med Roskilde Stift**

Hermed fremsendes rapportering på aftalen for perioden 01.01.2021 til 31.10.2021  
Perioden har resulteret i et tidsvægtet afkast på -2,45% efter omkostninger.

### **Rapporten**

Rapporten arkiveres i netbanken, og historiske versioner vil altid kunne findes her. Der findes forskellige tilvalgsmuligheder på rapporten og leveranceformen, blandt andet er der mulighed for at få rapporten i Excel.

Hvis I har ønsker om dette, eller andre forespørgsler, kan I kontakte undertegnede eller Client Service på 8989 7043 / [cm.clientservice@jyskebank.dk](mailto:cm.clientservice@jyskebank.dk).

Med venlig hilsen

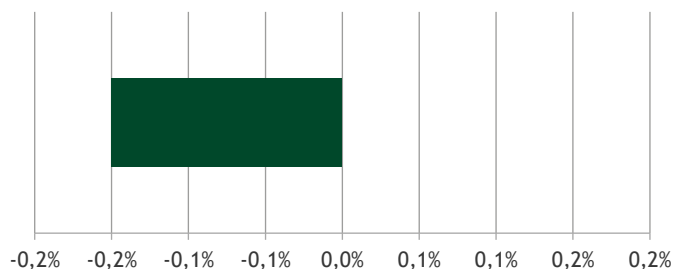
Indhold	Side
Porteføljeoverblik.....	4
Afkastoversigt.....	5
Tidsvægtet afkast.....	6
Resultatspecifikation.....	7
Beholdningsoversigt.....	8
Beholdningsspecifikation.....	9
Transaktionsliste.....	10
Forklaringer til rapporten.....	13
Ansvarsfraskrivelse.....	15

---

## PORTEFØLJEØVERBLIK

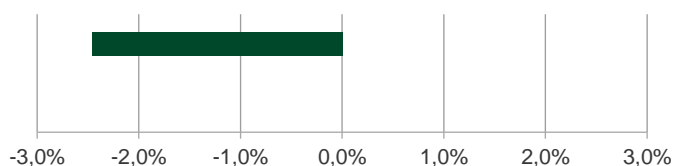
### Afkast seneste måned pr. aktivklasse (01.10.2021 - 31.10.2021)

Aktivtype	Afkast	Afkast (%)
■ Obligationer Danmark	-412.042,36	-0,15
<b>Total</b>	<b>-412.042,36</b>	<b>-0,15</b>



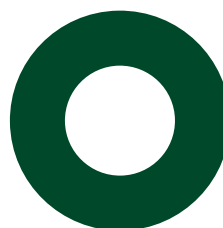
### Afkast år til dato pr. aktivklasse (01.01.2021 - 31.10.2021)

Aktivtype	Afkast	Afkast (%)
■ Obligationer Danmark	-7.049.533,90	-2,46
■ Kontanter / Gebyr	-222,60	
<b>Total</b>	<b>-7.049.756,50</b>	<b>-2,45</b>



### Beholdningsoversigt pr. aktivklasse (31.10.2021)

Aktivtype	Markedsværdi	Andel (%)
■ Obligationer Danmark	275.098.180,64	100,00
<b>Total</b>	<b>275.098.180,64</b>	<b>100,00</b>



## AFKASTOVERSIGT

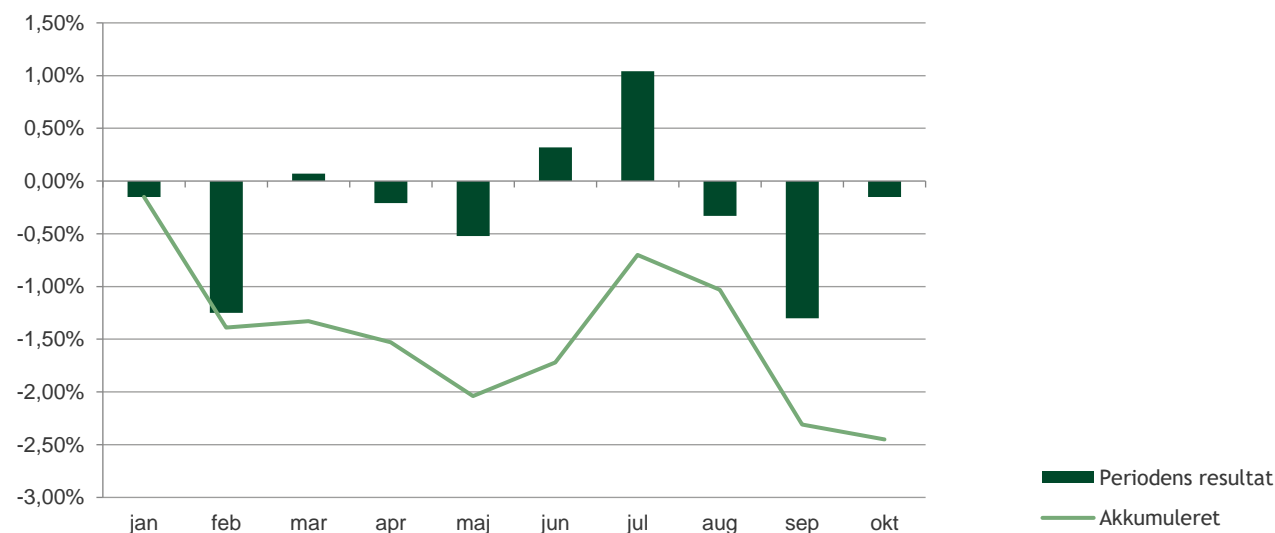
### Afkastopgørelse

<b>Formueværdi 01.01.2021</b>		<b>272.345.312,03</b>
Gevinst/tab	-9.517.271,50	
Rente	-62,10	
Udbytte	2.467.737,60	
Refunderede gebyrer	0,00	
Udbytteomkostninger	0,00	
Gebyrer	-160,50	
<b>Resultat efter gebyrer</b>		<b>-7.049.756,50</b>
Hævet/indsat	10.271.226,31	
Udbytteskat	-468.601,20	
Depotflyt	0,00	
<b>Formueværdi pr. 31.10.2021</b>		<b>275.098.180,64</b>
<b>Periodens afkast (tidsvægtet)</b>		<b>-2,45%</b>

Det totale porteføljeafkast inkluderer et gebyr på 160,50. Handelsomkostninger 0,00 er indregnet i resultatet. De samlede omkostninger i rapporteringsperioden er 160,50.

Ønsker du at få omkostningerne uddybet så kontakt gerne din rådgiver i Jyske Bank.

### Tidsvægtet afkast



## TIDSVÆGTET AFKAST (%)

<b>Periode</b>	<b>Depot</b>
01.01.2021 til 31.01.2021	-0,15
01.02.2021 til 28.02.2021	-1,25
01.03.2021 til 31.03.2021	0,07
01.04.2021 til 30.04.2021	-0,21
01.05.2021 til 31.05.2021	-0,52
01.06.2021 til 30.06.2021	0,32
01.07.2021 til 31.07.2021	1,04
01.08.2021 til 31.08.2021	-0,33
01.09.2021 til 30.09.2021	-1,30
01.10.2021 til 31.10.2021	-0,15
<b>01.01.2021 til 31.10.2021</b>	<b>-2,45</b>

---

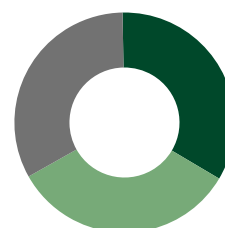
## RESULTATSPECIFIKATION (01.01.2021 - 31.10.2021)

Værdipapir	Realiseret kursgevinst	Realiseret valutagevinst	Urealiseret kursgevinst	Urealiseret valutagevinst	Rente / udbytte	Refusion / gebyr	Samlet resultat	Afkast (%)
<b>OBLIGATIONER DANMARK</b>								
<i>Danske kroner</i>								
Kap. JI Inst. Stifternes Kapitaler (1) Oms.beg	-234.765,62	0,00	-2.187.358,25	0,00	729.093,60	0,00	-1.693.030,27	-1,77
Kap.JI Inst. Stifternes Kapitaler (2) Oms.beg	-278.470,40	0,00	-3.497.268,04	0,00	819.293,00	0,00	-2.956.445,44	-3,13
Kap JI Inst. Stifternes Kapitaler (3) Oms.beg	-237.764,07	0,00	-3.081.645,12	0,00	919.351,00	0,00	-2.400.058,19	-2,47
<i>Danske kroner total</i>	-751.000,09	0,00	-8.766.271,41	0,00	2.467.737,60	0,00	-7.049.533,90	-2,46
<b>OBLIGATIONER DANMARK TOTAL</b>	<b>-751.000,09</b>	<b>0,00</b>	<b>-8.766.271,41</b>	<b>0,00</b>	<b>2.467.737,60</b>	<b>0,00</b>	<b>-7.049.533,90</b>	<b>-2,46</b>
<b>KONTANTER</b>								
<i>Danske kroner</i>								
DANSKE KRONER Transaktionskonti	0,00	0,00	0,00	0,00	-62,10	-160,50	-222,60	
<i>Danske kroner total</i>	0,00	0,00	0,00	0,00	-62,10	-160,50	-222,60	
<b>KONTANTER TOTAL</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>-62,10</b>	<b>-160,50</b>	<b>-222,60</b>	
<b>PORTEFØLJE TOTAL</b>	<b>-751.000,09</b>	<b>0,00</b>	<b>-8.766.271,41</b>	<b>0,00</b>	<b>2.467.675,50</b>	<b>-160,50</b>	<b>-7.049.756,50</b>	<b>-2,45</b>

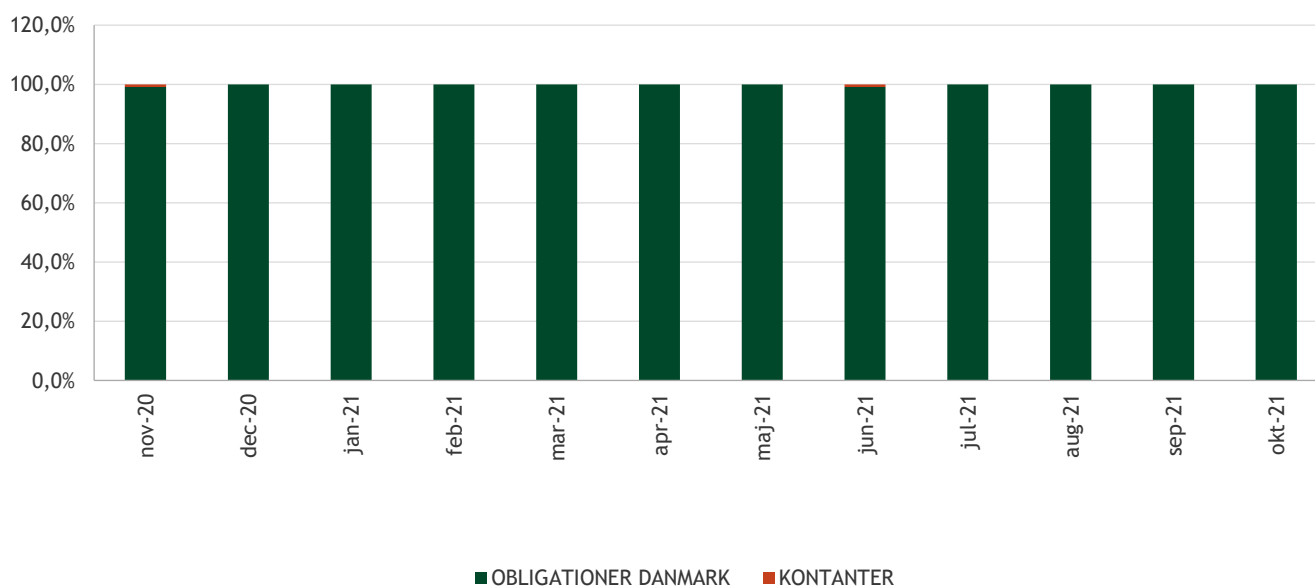
## BEHOLDNINGSOVERSIGT

### Top 5 beholdninger (31.10.2021)

Aktivnavn	Markedsværdi	Andel (%)
Kap.JI Inst. Stifternes Kapitaler (3) Oms.beg	92.958.229	33,79
Kap. JI Inst. Stifternes Kapitaler (1) Oms.beg	91.650.687	33,32
Kap.JI Inst. Stifternes Kapitaler (2) Oms.beg	90.489.264	32,89
<b>Total</b>	<b>275.098.181</b>	<b>100,00</b>



### Allokering seneste år (30.11.2020 - 31.10.2021)



### Primo Kontanter (01.01.2021)

Valuta	Beløb
DANSKE KRONER	-53,25
<b>KONTANTER TOTAL</b>	<b>-53,25</b>



## BEHOLDNINGSSPECIFIKATION

Værdipapir	ISIN	Beholdning	Gns. købskurs	Kurs	Markedsværdi	Vedhængende rente	Markedsværdi inkl. vedhængende rente	Portefølje andel (%)
<b>OBLIGATIONER DANMARK</b>								
<i>Danske kroner</i>								
Kap JI Inst. Stifternes Kapitaler (3) Oms.beg	DK0060774396	935.569,00	100,95	99,3601	92.958.229,42		92.958.229,42	33,79
Kap. JI Inst. Stifternes Kapitaler (1) Oms.beg	DK0060231421	925.700,00	79,15	99,0069	91.650.687,34		91.650.687,34	33,32
Kap.JI Inst. Stifternes Kapitaler (2) Oms.beg	DK0060231504	926.161,00	78,83	97,7036	90.489.263,88		90.489.263,88	32,89
<i>Danske kroner total</i>					<i>275.098.180,64</i>		<i>275.098.180,64</i>	<i>100,00</i>
<b>OBLIGATIONER DANMARK TOTAL</b>					<b>275.098.180,64</b>		<b>275.098.180,64</b>	<b>100,00</b>
<b>PORTEFØLJE TOTAL</b>					<b>275.098.180,64</b>		<b>275.098.180,64</b>	<b>100,00</b>

## TRANSAKTIONSLISTE

Handels dato	Valør dato	Værdipapir	ISIN	Transaktion	Antal	Kurs	Valuta kurs	Handelsbeløb	Kurtage	Andre omk.	Rente / udbytte	Total i valuta	Valuta	Total beløb
04.01.2021	04.01.2021	DANSKE KRONER		Indskud	53,25		100,00					53,25	DKK	53,25
04.01.2021	06.01.2021	Kap. JI Inst. Stifternes Kapitaler (1) O	DK0060231421	Køb	30.000,00	101,7300	100,00	3.051.900,00				3.051.900,00	DKK	3.051.900,00
04.01.2021	06.01.2021	Kap.JI Inst. Stifternes Kapitaler (2) O	DK0060231504	Køb	30.000,00	101,9800	100,00	3.059.400,00				3.059.400,00	DKK	3.059.400,00
04.01.2021	06.01.2021	Kap JI Inst. Stifternes Kapitaler (3) Om	DK0060774396	Køb	30.000,00	103,0700	100,00	3.092.100,00				3.092.100,00	DKK	3.092.100,00
06.01.2021	06.01.2021	DANSKE KRONER		Indskud	9.203.400,00		100,00					9.203.400,00	DKK	9.203.400,00
06.01.2021	08.01.2021	Kap. JI Inst. Stifternes Kapitaler (1) O	DK0060231421	Køb	13.000,00	101,7000	100,00	1.322.100,00				1.322.100,00	DKK	1.322.100,00
06.01.2021	08.01.2021	Kap.JI Inst. Stifternes Kapitaler (2) O	DK0060231504	Køb	13.000,00	101,9000	100,00	1.324.700,00				1.324.700,00	DKK	1.324.700,00
06.01.2021	08.01.2021	Kap JI Inst. Stifternes Kapitaler (3) Om	DK0060774396	Køb	13.000,00	103,0100	100,00	1.339.130,00				1.339.130,00	DKK	1.339.130,00
08.01.2021	08.01.2021	DANSKE KRONER		Indskud	3.985.930,00		100,00					3.985.930,00	DKK	3.985.930,00
21.01.2021	25.01.2021	Kap. JI Inst. Stifternes Kapitaler (1) O	DK0060231421	Køb	7.000,00	101,6900	100,00	711.830,00				711.830,00	DKK	711.830,00
21.01.2021	25.01.2021	Kap.JI Inst. Stifternes Kapitaler (2) O	DK0060231504	Køb	7.000,00	101,7300	100,00	712.110,00				712.110,00	DKK	712.110,00
21.01.2021	25.01.2021	Kap JI Inst. Stifternes Kapitaler (3) Om	DK0060774396	Køb	7.000,00	102,9100	100,00	720.370,00				720.370,00	DKK	720.370,00
25.01.2021	25.01.2021	DANSKE KRONER		Indskud	2.144.310,00		100,00					2.144.310,00	DKK	2.144.310,00
09.02.2021	11.02.2021	Kap. JI Inst. Stifternes Kapitaler (1) O	DK0060231421	Køb	7.000,00	101,4900	100,00	710.430,00				710.430,00	DKK	710.430,00
09.02.2021	11.02.2021	Kap.JI Inst. Stifternes Kapitaler (2) O	DK0060231504	Køb	7.000,00	101,3800	100,00	709.660,00				709.660,00	DKK	709.660,00
09.02.2021	11.02.2021	Kap JI Inst. Stifternes Kapitaler (3) Om	DK0060774396	Køb	7.000,00	102,6400	100,00	718.480,00				718.480,00	DKK	718.480,00
11.02.2021	11.02.2021	DANSKE KRONER		Indskud	2.138.570,00		100,00					2.138.570,00	DKK	2.138.570,00
04.03.2021	08.03.2021	Kap. JI Inst. Stifternes Kapitaler (1) O	DK0060231421	Køb	17.000,00	100,7800	100,00	1.713.260,00				1.713.260,00	DKK	1.713.260,00
04.03.2021	08.03.2021	Kap.JI Inst. Stifternes Kapitaler (2) O	DK0060231504	Køb	17.000,00	100,7100	100,00	1.712.070,00				1.712.070,00	DKK	1.712.070,00
04.03.2021	08.03.2021	Kap JI Inst. Stifternes Kapitaler (3) Om	DK0060774396	Køb	17.000,00	101,9700	100,00	1.733.490,00				1.733.490,00	DKK	1.733.490,00
08.03.2021	08.03.2021	DANSKE KRONER		Indskud	5.158.820,00		100,00					5.158.820,00	DKK	5.158.820,00
23.03.2021	25.03.2021	Kap. JI Inst. Stifternes Kapitaler (1) O	DK0060231421	Salg	-50.000,00	100,3800	100,00	5.019.000,00				5.019.000,00	DKK	5.019.000,00
23.03.2021	25.03.2021	Kap.JI Inst. Stifternes Kapitaler (2) O	DK0060231504	Salg	-50.000,00	100,2800	100,00	5.014.000,00				5.014.000,00	DKK	5.014.000,00
23.03.2021	25.03.2021	Kap JI Inst. Stifternes Kapitaler (3) Om	DK0060774396	Salg	-50.000,00	101,6300	100,00	5.081.500,00				5.081.500,00	DKK	5.081.500,00
25.03.2021	29.03.2021	Kap. JI Inst. Stifternes Kapitaler (1) O	DK0060231421	Udbytte			100,00			729.093,60		729.093,60	DKK	729.093,60
25.03.2021	29.03.2021	Kap.JI Inst. Stifternes Kapitaler (2) O	DK0060231504	Udbytte			100,00			455.091,00		455.091,00	DKK	455.091,00
25.03.2021	29.03.2021	Kap JI Inst. Stifternes Kapitaler (3) Om	DK0060774396	Udbytte			100,00			551.375,40		551.375,40	DKK	551.375,40
25.03.2021	29.03.2021	Kap. JI Inst. Stifternes Kapitaler (1) O	DK0060231421	Udbytteskat			100,00				-196.855,27	-196.855,27	DKK	-196.855,27
25.03.2021	29.03.2021	Kap.JI Inst. Stifternes Kapitaler (2) O	DK0060231504	Udbytteskat			100,00				-122.874,57	-122.874,57	DKK	-122.874,57
25.03.2021	29.03.2021	Kap JI Inst. Stifternes Kapitaler (3) Om	DK0060774396	Udbytteskat			100,00				-148.871,36	-148.871,36	DKK	-148.871,36
25.03.2021	25.03.2021	DANSKE KRONER		Udtræk	-15.114.500,00		100,00					-15.114.500,00	DKK	-15.114.500,00
26.03.2021	26.03.2021	Kap. JI Inst. Stifternes Kapitaler (1) O	DK0060231421	Geninv. udbytte	5.333,00	99,7828	100,00	532.141,67				532.141,67	DKK	532.141,67
26.03.2021	26.03.2021	Kap.JI Inst. Stifternes Kapitaler (2) O	DK0060231504	Geninv. udbytte	3.323,00	99,9490	100,00	332.130,53				332.130,53	DKK	332.130,53
26.03.2021	26.03.2021	Kap JI Inst. Stifternes Kapitaler (3) Om	DK0060774396	Geninv. udbytte	3.980,00	101,1173	100,00	402.446,85				402.446,85	DKK	402.446,85
31.03.2021	31.03.2021	DANSKE KRONER		Gebyr			100,00					-54,00	DKK	-54,00
06.04.2021	06.04.2021	DANSKE KRONER		Udtræk	-185,75		100,00					-185,75	DKK	-185,75

Handels dato	Valør dato	Værdipapir	ISIN	Transaktion	Antal	Kurs	Valuta kurs	Handelsbeløb	Kurtage Andre omk.	Rente / udbytte	Total i valuta	Valuta	Total beløb
07.04.2021	09.04.2021	Kap. JI Inst. Stifternes Kapitaler (1) O	DK0060231421	Køb	5.000,00	100,0000	100,00	500.000,00			500.000,00	DKK	500.000,00
07.04.2021	09.04.2021	Kap.JI Inst. Stifternes Kapitaler (2) O	DK0060231504	Køb	5.000,00	100,1500	100,00	500.750,00			500.750,00	DKK	500.750,00
07.04.2021	09.04.2021	Kap JI Inst. Stifternes Kapitaler (3) Om	DK0060774396	Køb	5.000,00	101,3600	100,00	506.800,00			506.800,00	DKK	506.800,00
09.04.2021	09.04.2021	DANSKE KRONER		Indskud	1.507.550,00		100,00				1.507.550,00	DKK	1.507.550,00
23.04.2021	27.04.2021	Kap. JI Inst. Stifternes Kapitaler (1) O	DK0060231421	Salg	-39.000,00	99,5000	100,00	3.880.500,00			3.880.500,00	DKK	3.880.500,00
23.04.2021	27.04.2021	Kap.JI Inst. Stifternes Kapitaler (2) O	DK0060231504	Salg	-39.000,00	99,4900	100,00	3.880.110,00			3.880.110,00	DKK	3.880.110,00
23.04.2021	27.04.2021	Kap JI Inst. Stifternes Kapitaler (3) Om	DK0060774396	Salg	-39.000,00	100,8400	100,00	3.932.760,00			3.932.760,00	DKK	3.932.760,00
27.04.2021	27.04.2021	DANSKE KRONER		Udtræk	-11.693.370,00		100,00				-11.693.370,00	DKK	-11.693.370,00
07.05.2021	11.05.2021	Kap. JI Inst. Stifternes Kapitaler (1) O	DK0060231421	Køb	5.000,00	99,6800	100,00	498.400,00			498.400,00	DKK	498.400,00
07.05.2021	11.05.2021	Kap.JI Inst. Stifternes Kapitaler (2) O	DK0060231504	Køb	5.000,00	99,5800	100,00	497.900,00			497.900,00	DKK	497.900,00
07.05.2021	11.05.2021	Kap JI Inst. Stifternes Kapitaler (3) Om	DK0060774396	Køb	5.000,00	100,9100	100,00	504.550,00			504.550,00	DKK	504.550,00
11.05.2021	11.05.2021	DANSKE KRONER		Indskud	1.500.850,00		100,00				1.500.850,00	DKK	1.500.850,00
26.05.2021	28.05.2021	Kap. JI Inst. Stifternes Kapitaler (1) O	DK0060231421	Køb	4.000,00	99,0700	100,00	396.280,00			396.280,00	DKK	396.280,00
26.05.2021	28.05.2021	Kap.JI Inst. Stifternes Kapitaler (2) O	DK0060231504	Køb	4.000,00	99,0500	100,00	396.200,00			396.200,00	DKK	396.200,00
26.05.2021	28.05.2021	Kap JI Inst. Stifternes Kapitaler (3) Om	DK0060774396	Køb	4.000,00	100,5300	100,00	402.120,00			402.120,00	DKK	402.120,00
28.05.2021	28.05.2021	DANSKE KRONER		Indskud	1.194.600,00		100,00				1.194.600,00	DKK	1.194.600,00
07.06.2021	09.06.2021	Kap. JI Inst. Stifternes Kapitaler (1) O	DK0060231421	Salg	-13.000,00	98,3300	100,00	1.278.290,00			1.278.290,00	DKK	1.278.290,00
07.06.2021	09.06.2021	Kap.JI Inst. Stifternes Kapitaler (2) O	DK0060231504	Salg	-13.000,00	98,2800	100,00	1.277.640,00			1.277.640,00	DKK	1.277.640,00
07.06.2021	09.06.2021	Kap JI Inst. Stifternes Kapitaler (3) Om	DK0060774396	Salg	-13.000,00	99,9200	100,00	1.298.960,00			1.298.960,00	DKK	1.298.960,00
09.06.2021	09.06.2021	DANSKE KRONER		Udtræk	-3.854.890,00		100,00				-3.854.890,00	DKK	-3.854.890,00
25.06.2021	29.06.2021	Kap. JI Inst. Stifternes Kapitaler (1) O	DK0060231421	Salg	-8.000,00	99,1000	100,00	792.800,00			792.800,00	DKK	792.800,00
25.06.2021	29.06.2021	Kap.JI Inst. Stifternes Kapitaler (2) O	DK0060231504	Salg	-8.000,00	98,8700	100,00	790.960,00			790.960,00	DKK	790.960,00
25.06.2021	29.06.2021	Kap JI Inst. Stifternes Kapitaler (3) Om	DK0060774396	Salg	-8.000,00	100,5200	100,00	804.160,00			804.160,00	DKK	804.160,00
28.06.2021	30.06.2021	Kap. JI Inst. Stifternes Kapitaler (1) O	DK0060231421	Salg	-8.000,00	99,0100	100,00	792.080,00			792.080,00	DKK	792.080,00
28.06.2021	30.06.2021	Kap.JI Inst. Stifternes Kapitaler (2) O	DK0060231504	Salg	-8.000,00	98,7800	100,00	790.240,00			790.240,00	DKK	790.240,00
28.06.2021	30.06.2021	Kap JI Inst. Stifternes Kapitaler (3) Om	DK0060774396	Salg	-8.000,00	100,4500	100,00	803.600,00			803.600,00	DKK	803.600,00
29.06.2021	29.06.2021	DANSKE KRONER		Udtræk	-2.387.920,00		100,00				-2.387.920,00	DKK	-2.387.920,00
30.06.2021	30.06.2021	DANSKE KRONER		Gebyr			100,00				-51,75	DKK	-51,75
01.07.2021	01.07.2021	DANSKE KRONER		Udtræk	-2.385.868,25		100,00				-2.385.868,25	DKK	-2.385.868,25
02.07.2021	06.07.2021	Kap. JI Inst. Stifternes Kapitaler (1) O	DK0060231421	Køb	45.000,00	99,4200	100,00	4.473.900,00			4.473.900,00	DKK	4.473.900,00
02.07.2021	06.07.2021	Kap.JI Inst. Stifternes Kapitaler (2) O	DK0060231504	Køb	45.000,00	99,1600	100,00	4.462.200,00			4.462.200,00	DKK	4.462.200,00
02.07.2021	06.07.2021	Kap JI Inst. Stifternes Kapitaler (3) Om	DK0060774396	Køb	45.000,00	100,7900	100,00	4.535.550,00			4.535.550,00	DKK	4.535.550,00
06.07.2021	06.07.2021	DANSKE KRONER		Indskud	13.471.650,00		100,00				13.471.650,00	DKK	13.471.650,00
10.08.2021	12.08.2021	Kap. JI Inst. Stifternes Kapitaler (1) O	DK0060231421	Køb	6.000,00	100,5800	100,00	603.480,00			603.480,00	DKK	603.480,00
10.08.2021	12.08.2021	Kap.JI Inst. Stifternes Kapitaler (2) O	DK0060231504	Køb	6.000,00	100,1500	100,00	600.900,00			600.900,00	DKK	600.900,00
10.08.2021	12.08.2021	Kap JI Inst. Stifternes Kapitaler (3) Om	DK0060774396	Køb	6.000,00	101,8900	100,00	611.340,00			611.340,00	DKK	611.340,00
12.08.2021	12.08.2021	DANSKE KRONER		Indskud	1.815.720,00		100,00				1.815.720,00	DKK	1.815.720,00
25.08.2021	27.08.2021	Kap. JI Inst. Stifternes Kapitaler (1) O	DK0060231421	Køb	7.000,00	100,5500	100,00	703.850,00			703.850,00	DKK	703.850,00
25.08.2021	27.08.2021	Kap.JI Inst. Stifternes Kapitaler (2) O	DK0060231504	Køb	7.000,00	99,6100	100,00	697.270,00			697.270,00	DKK	697.270,00
25.08.2021	27.08.2021	Kap JI Inst. Stifternes Kapitaler (3) Om	DK0060774396	Køb	7.000,00	101,3100	100,00	709.170,00			709.170,00	DKK	709.170,00

Handels dato	Valør dato	Værdipapir	ISIN	Transaktion	Antal	Kurs	Valuta kurs	Handelsbeløb	Kurtage	Andre omk.	Rente / udbytte	Total i valuta	Valuta	Total beløb
25.08.2021	27.08.2021	Kap.JI Inst. Stifternes Kapitaler (2) O	DK0060231504	Udbytte			100,00				364.202,00	364.202,00	DKK	364.202,00
25.08.2021	27.08.2021	Kap JI Inst. Stifternes Kapitaler (3) Om	DK0060774396	Udbytte			100,00				367.975,60	367.975,60	DKK	367.975,60
26.08.2021	26.08.2021	Kap.JI Inst. Stifternes Kapitaler (2) O	DK0060231504	Geninv. udbytte	3.656,00	99,6015	100,00	364.143,08				364.143,08	DKK	364.143,08
26.08.2021	26.08.2021	Kap JI Inst. Stifternes Kapitaler (3) Om	DK0060774396	Geninv. udbytte	3.630,00	101,3429	100,00	367.874,73				367.874,73	DKK	367.874,73
27.08.2021	27.08.2021	DANSKE KRONER		Indskud	2.110.290,00		100,00					2.110.290,00	DKK	2.110.290,00
27.08.2021	27.08.2021	DANSKE KRONER		Udtræk	-159,79		100,00					-159,79	DKK	-159,79
21.09.2021	23.09.2021	Kap. JI Inst. Stifternes Kapitaler (1) O	DK0060231421	Salg	-5.000,00	99,7200	100,00	498.600,00				498.600,00	DKK	498.600,00
21.09.2021	23.09.2021	Kap.JI Inst. Stifternes Kapitaler (2) O	DK0060231504	Salg	-5.000,00	98,3900	100,00	491.950,00				491.950,00	DKK	491.950,00
21.09.2021	23.09.2021	Kap JI Inst. Stifternes Kapitaler (3) Om	DK0060774396	Salg	-5.000,00	100,1700	100,00	500.850,00				500.850,00	DKK	500.850,00
22.09.2021	24.09.2021	Kap. JI Inst. Stifternes Kapitaler (1) O	DK0060231421	Salg	-4.000,00	99,6000	100,00	398.400,00				398.400,00	DKK	398.400,00
22.09.2021	24.09.2021	Kap.JI Inst. Stifternes Kapitaler (2) O	DK0060231504	Salg	-4.000,00	98,2100	100,00	392.840,00				392.840,00	DKK	392.840,00
22.09.2021	24.09.2021	Kap JI Inst. Stifternes Kapitaler (3) Om	DK0060774396	Salg	-4.000,00	100,0200	100,00	400.080,00				400.080,00	DKK	400.080,00
23.09.2021	23.09.2021	DANSKE KRONER		Udtræk	-1.491.400,00		100,00					-1.491.400,00	DKK	-1.491.400,00
24.09.2021	24.09.2021	DANSKE KRONER		Udtræk	-1.191.320,00		100,00					-1.191.320,00	DKK	-1.191.320,00
30.09.2021	30.09.2021	DANSKE KRONER		Gebyr			100,00					-54,75	DKK	-54,75
30.09.2021	30.09.2021	DANSKE KRONER		Indskud	116,85		100,00					116,85	DKK	116,85
30.09.2021	30.09.2021	DANSKE KRONER		Rente			100,00				-62,10	-62,10	DKK	-62,10
25.10.2021	27.10.2021	Kap. JI Inst. Stifternes Kapitaler (1) O	DK0060231421	Køb	14.000,00	99,3500	100,00	1.390.900,00				1.390.900,00	DKK	1.390.900,00
25.10.2021	27.10.2021	Kap.JI Inst. Stifternes Kapitaler (2) O	DK0060231504	Køb	14.000,00	98,0000	100,00	1.372.000,00				1.372.000,00	DKK	1.372.000,00
25.10.2021	27.10.2021	Kap JI Inst. Stifternes Kapitaler (3) Om	DK0060774396	Køb	14.000,00	99,7200	100,00	1.396.080,00				1.396.080,00	DKK	1.396.080,00
27.10.2021	27.10.2021	DANSKE KRONER		Indskud	4.158.980,00		100,00					4.158.980,00	DKK	4.158.980,00

## FORKLARINGER TIL RAPPORTEN

### Afkastprocent

Afkastprocenten angives som periodens afkast. Afkastet er opgjort som tidsvægtet igennem hele rapporten. Tidsvægtede afkast viser periodens afkast uden hensyntagen til hvor stor andel af porteføljen, der har været investeret på forskellige tidspunkter. Det tidsvægtede afkast er derfor uafhængigt af udtræk eller indskud i aftalen, og derfor den mest retvisende afkastprocent i forhold til investeringsbeslutninger truffet af Jyske Capital. Tidsvægtede afkast er derfor det mest anvendelige i sammenligninger med benchmark og på tværs af kapitalforvaltere.

### Markedsværdi

Markedsværdien er opgjort på grundlag af seneste officielle lukkekurs, med mindre denne kurs er misvisende eller beregnet på grundlag af en atypisk omsætning. Markedsværdier pr. 31.12 er opgjort på grundlag af skattekurser fra VP. Ved Valutakurs anvendes Jyske Banks referencekurs, som er leveret af SIX Financial Information og er fastsat kl. 14:15. Den er angivet i "Beholdningsspecifikationen" i kolonnen "Værdipapir" i parentes efter valutabetegnelsen.

### Vedhængende rente

Vedhængende rente for obligationer henviser til de renter, som porteføljen har optjent, men endnu ikke fået udbetalt.

### Horisontafkast

Horisontafkast viser det forventede annualiserede afkast for en given obligation de næste seks måneder.

### Varighed

Varighed er den officielle varighed, som fremgår af kurslisterne. Varigheden måles i antal år og angiver, hvornår investor har fået sin investering igen. Varigheden er også et risikomål, der angiver, hvor kursfølsom en obligation er over for ændringer i renten. Den officielle varighed tager ikke hensyn til optionselementet i konverterbare obligationer, hvorfor den ikke afspejler den korrekte risiko.

### Modificeret varighed

Modificeret varighed beregnes ved, at dividere varigheden for den pågældende obligation med 1 plus den effektive rente på instrumentet. For konverterbare obligationer anvendes Jyske Banks model til beregning af modificeret varighed. Den modificerede varighed er også et risikomål, der angiver hvor kursfølsom en obligation er over for ændringer i renten.

### Konveksitet

Kurskonveksiteten angiver ændring i kursrisikoen pr. nominel 100 kr. ved en parallelforskydning af rentekurven med 1%. Obligationer med negativ kurskonveksitet giver typisk et højere afkast end sammenlignelige obligationer ved uændret rente. Ved renteændringer i både op- og nedadgående retning vil afkastet typisk være lavere end på obligationer med højere (mindre negativ eller positiv) konveksitet.

### OAS

Rentespænd til swapkurven. OAS (option adjusted spread) for konverterbare obligationer er modelafhængigt og siger derfor ikke noget i sig selv. Udviklingen i OAS over tid kan derimod bruges til at vurdere om en obligation er relativ dyr eller billig. Et voksende OAS tyder på, at obligationen er blevet billigere.

### Benchmark

Benchmark er det sammenligningsgrundlag, der er defineret i "Aftalen om Kapitalforvaltning". Benchmarks repræsenterer de enkelte aktivklasser og viser markedsafkastet. Der er ingen investeringsomkostninger i et benchmark.

### Udbytte

Udbytte indgår kun netto i kontantbeholdninger, mens afkastberegninger sker på baggrund af bruttoudbytte. Udbytteskat fremgår af afkastoversigten i rapporten sammen med hævede og indsatte beløb.

### Kurs- og valutagevinst

Realiseret og urealiseret kurs- og valutagevinst er opgjort i forhold til værdien primo rapporteringsperioden eller værdien af køb foretaget i rapporteringsperioden. Eventuelle handelsomkostninger er indregnet.

## Total i valuta

Afregningsbeløb i den valuta som transaktionen er afregnet i (Transaktionsliste).

## Valuta

Afregningskontoens valuta (Transaktionsliste).

## Total beløb

Afregningsbeløb i rapporteringsvaluta. Hvis afregningskontoens valuta er den samme som rapporteringsvalutaen, svarer beløbet til Total i valuta. Hvis afregningen er sket over en konto i anden valuta, er beløbet omregnet til valutakursen på afregningsdagen (Transaktionsliste).

## ANSVARFRASKRIVELSE

Denne afkastrapport bør ikke anvendes som bogføringsmateriale. Til dette formål bør fondsnotaer, kontoudtog og depotudtog benyttes.

Rapporten er baseret på informationer, som Jyske Bank finder pålidelige, men Jyske Bank påtager sig ikke ansvar for materialets rigtighed eller for dispositioner foretaget på baggrund af dettes informationer eller vurderinger.

Der kan være manglende eller fejlagtige beregninger, hvis depotet indeholder værdipapirer, hvor der indgår ikke afsluttede corporate actions.

Investering i finansielle instrumenter er behæftet med risiko og man kan risikere at miste hele eller en del af sin investering.

Historiske afkast og kursudvikling kan ikke anvendes som pålidelig indikator for fremtidige afkast og kursudvikling. Afkast og/eller kursudvikling kan blive negativ

Materialet er til personligt brug for Jyske Banks kunder og må ikke kopieres.