

Roskilde Stift
Stændertorvet 3A
4000 Roskilde

Jyske Capital Clients
Vestergade 8-16
DK 8600 Silkeborg
+45 89 89 70 43
cm.clientservice@jyskebank.dk
SWIFT: JYBADKKK
CVR: 17616617

Rapportering af kapitalforvaltning



Rapportering på kapitalforvaltningsaftale med Roskilde Stift

Hermed fremsendes rapportering på aftalen for perioden 31.12.2016 til 30.09.2017

Perioden har resulteret i et tidsvægtet afkast på 1,93% efter omkostninger.

Nyt format giver nye muligheder

Det er nu muligt, at modtage dele af den normale afkastrapport i excel, i forbindelse med den månedlige rapport.

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

Med venlig hilsen

Jan Andersen

Indhold	Side
Porteføljeoverblik.....	4
Afkastoversigt.....	5
Tidsvægtet afkast.....	6
Resultatspecifikation.....	7
Beholdningsoversigt.....	8
Beholdningsspecifikation.....	9
Transaktionsliste.....	10
Forklaringer til rapporten.....	11
Ansvarsfraskrivelse.....	12

Roskilde Stift

Periode: 31.12.2016 - 30.09.2017

PORTEFØLJEØVERBLIK

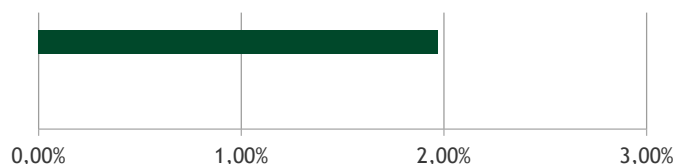
Afkast seneste måned pr. aktivklasse (31.08.2017 - 30.09.2017)

Aktivtype	Afkast (DKK)	Afkast (%)
■ Obligationer Danmark	489.125,55	0,18
Total	489.125,55	0,18



Afkast år til dato pr. aktivklasse (31.12.2016 - 30.09.2017)

Aktivtype	Afkast (DKK)	Afkast (%)
■ Obligationer Danmark	5.241.240,74	1,97
■ Kontanter / Gebyr	-35,00	
Total	5.241.205,74	1,98



Beholdningsoversigt pr. aktivklasse (30.09.2017)

Aktivtype	Markedsværdi	Andel (%)
■ Obligationer Danmark	267.644.641,40	100,00
Total	267.644.641,40	100,00



Roskilde Stift

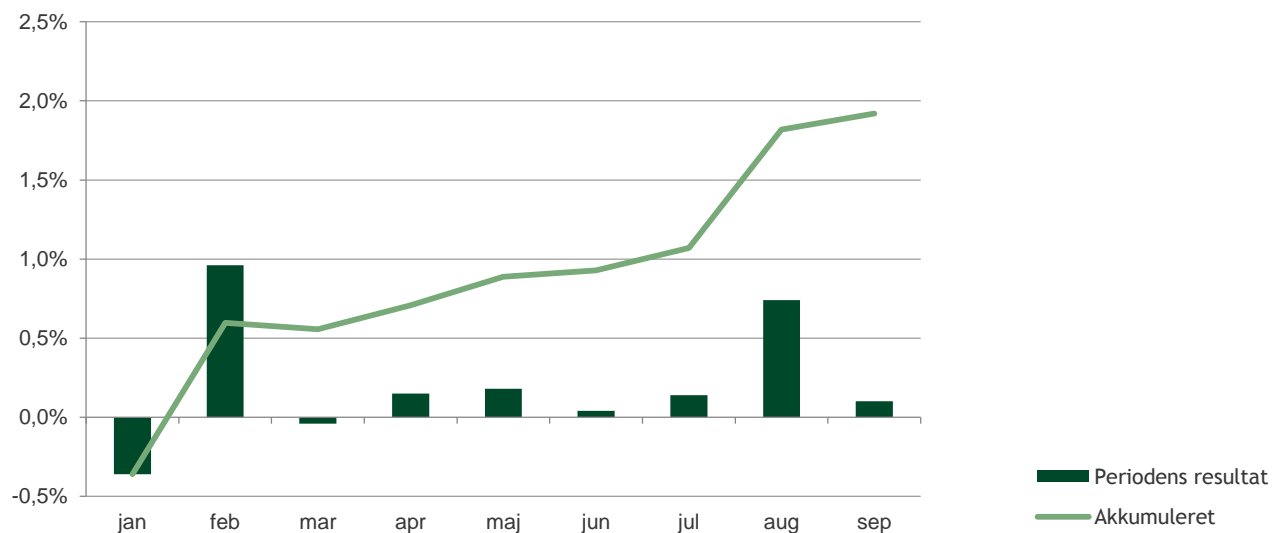
Periode: 31.12.2016 - 30.09.2017

AFKASTOVERSIGT

Afkastopgørelse

Formueværdi 31.12.2016		254.939.450,20
Realiseret gevinst/tab	-91.952,68	
Urealiseret gevinst/tab	1.750.395,41	
Rente	0,00	
Ændring i vedhængende rente	0,00	
Udbytte	3.582.798,00	
Gebyrer	-35,00	
Resultat efter gebyrer		5.241.205,74
Hævet/indsat/udbytteskat	7.463.985,46	
Formueværdi pr. 30.09.2017		267.644.641,40
Periodens afkast (pengevægtet)		1,98%

Tidsvægtet Afkast



Roskilde Stift

Periode: 31.12.2016 - 30.09.2017

TIDSVÆGTET AFKAST (%)

Periode	Depot
31.12.2016 til 31.01.2017	-0,36
31.01.2017 til 28.02.2017	0,96
28.02.2017 til 31.03.2017	-0,04
31.03.2017 til 30.04.2017	0,15
30.04.2017 til 31.05.2017	0,18
31.05.2017 til 30.06.2017	0,04
30.06.2017 til 31.07.2017	0,14
31.07.2017 til 31.08.2017	0,74
31.08.2017 til 30.09.2017	0,10
31.12.2016 til 30.09.2017	1,93

Roskilde Stift

Periode: 31.12.2016 - 30.09.2017

RESULTATSPECIFIKATION

Værdipapir	Realiseret kursgevinst	Realiseret valutagevinst	Urealiseret kursgevinst	Urealiseret valutagevinst	Rente / udbytte	Samlet resultat	Afkast (%)
OBLIGATIONER DANMARK							
<i>Danske kroner</i>							
Kap. JI Inst. Stifternes Kapitaler (3) Oms.	43.400,00	0,00	1.092.202,60	0,00	533.148,00	1.668.750,60	
Kap. JI Inst. Stifternes Kapitaler (1) Oms	-56.178,86	0,00	792.751,76	0,00	1.393.440,00	2.130.012,90	
Kap. JI Inst. Stifternes Kapitaler (2) Oms	-79.173,81	0,00	-134.558,95	0,00	1.656.210,00	1.442.477,24	
<i>Danske kroner total</i>	-91.952,68	0,00	1.750.395,41	0,00	3.582.798,00	5.241.240,74	1,97
OBLIGATIONER DANMARK TOTAL	-91.952,68	0,00	1.750.395,41	0,00	3.582.798,00	5.241.240,74	1,97
KONTANTER							
<i>Danske kroner</i>							
Transaktionskonto (DKK)		<i>Gebyr</i> -35,00			0,00	-35,00	
<i>Danske kroner total</i>		-35,00			0,00	-35,00	-0,02
KONTANTER TOTAL		-35,00			0,00	-35,00	-0,02
PORTEFØLJE TOTAL	-91.987,68	0,00	1.750.395,41	0,00	3.582.798,00	5.241.205,74	1,98

Det totale portefølje afkast inkluderer et gebyr på DKK 35,00

Handelsomkostninger DKK 0,00 er indregnet i resultatet. Ønsker du at få omkostningerne uddybet, så kontakt din rådgiver i Jyske Bank.

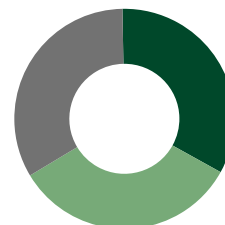
Roskilde Stift

Periode: 30.09.2017

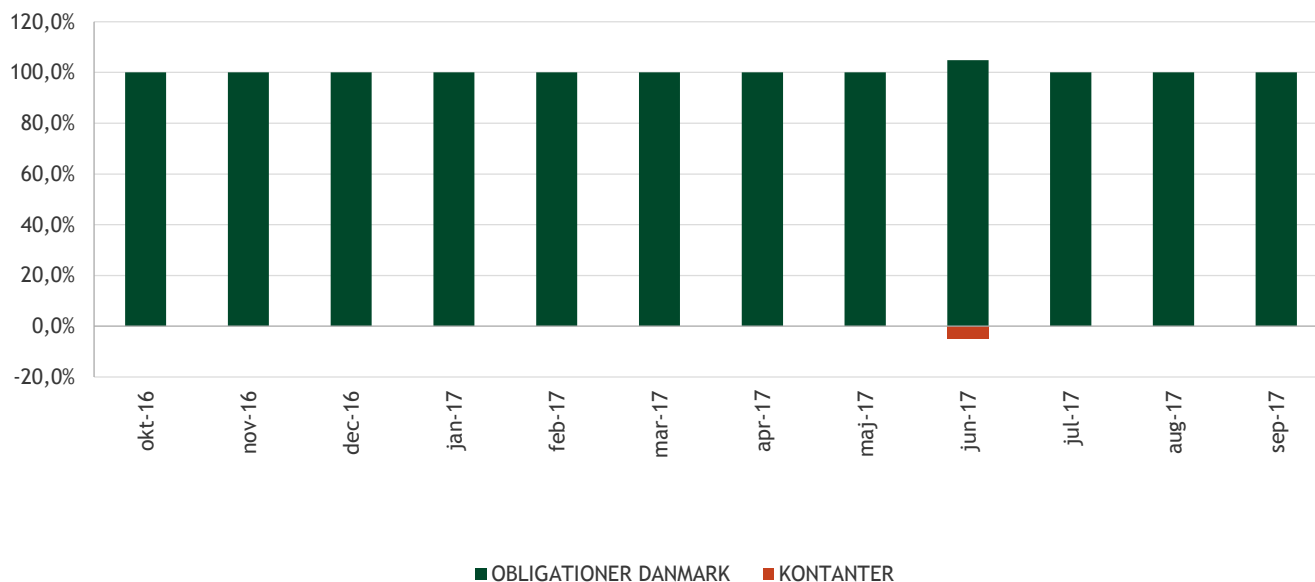
BEHOLDNINGSOVERSIGT

Top 5 beholdninger (30.09.2017)

Aktivtype	Markedsværdi	Andel (%)
Kap JI Inst. Stifternes Kapitaler (3) Oms.	90.014.665	33,63
Kap. JI Inst. Stifternes Kapitaler (1) Oms	89.106.208	33,29
Kap.JI Inst. Stifternes Kapitaler (2) Oms	88.523.768	33,08
Total	267.644.641	100,00



Allokering seneste år (31.10.2016 - 30.09.2017)



Roskilde Stift

Periode: 30.09.2017

BEHOLDNINGSSPECIFIKATION

Værdipapir	Beholdning	Gns. købskurs	Kurs	Markedsværdi	Vedhængende rente	Markedsværdi inkl. vedhængende rente	Portefølje andel (%)	Horisont afkast (%)	Mod. varighed	Varighed
OBLIGATIONER DANMARK										
<i>Danske kroner</i>										
Kap JI Inst. Stifternes Kapitaler (3) Oms.	888.580,00	100,07	101,3017	90.014.664,59		90.014.664,59	33,63			
Kap. JI Inst. Stifternes Kapitaler (1) Oms	855.900,00	102,86	104,1082	89.106.208,38		89.106.208,38	33,29			
Kap. JI Inst. Stifternes Kapitaler (2) Oms	855.900,00	102,66	103,4277	88.523.768,43		88.523.768,43	33,08			
<i>Danske kroner total</i>				<i>267.644.641,40</i>		<i>267.644.641,40</i>	<i>100,00</i>			
OBLIGATIONER DANMARK TOTAL				267.644.641,40		267.644.641,40	100,00			
PORTEFØLJE TOTAL				267.644.641,40	0,00	267.644.641,40	100,00	0,00	0,00	0,00

Roskilde Stift

Periode: 31.12.2016 - 30.09.2017

TRANSAKTIONSLISTE

Handelsdato	Valørdato	Værdipapir	ISIN	Transaktion	Antal	Kurs	Valuta kurs	Handelsbeløb	Kurtage	Andre omk.	Rente / udbytte	Total beløb
02.01.2017	04.01.2017	Kap. JI Inst. Stifternes Kapitaler (1) Oms	DK0060231421	Køb	97.500,00	103,2508	100,00	10.066.953,00				10.066.953,00
02.01.2017	04.01.2017	Kap. JI Inst. Stifternes Kapitaler (2) Oms	DK0060231504	Køb	97.500,00	103,6752	100,00	10.108.332,00				10.108.332,00
16.01.2017	18.01.2017	Kap JI Inst. Stifternes Kapitaler (3) Oms.	DK0060774396	Køb	457.970,00	100,0900	100,00	45.838.217,30				45.838.217,30
16.01.2017	18.01.2017	Kap. JI Inst. Stifternes Kapitaler (1) Oms	DK0060231421	Salg	444.850,00	103,0500	100,00	45.841.792,50				45.841.792,50
25.01.2017	27.01.2017	Kap JI Inst. Stifternes Kapitaler (3) Oms.	DK0060774396	Køb	460.610,00	99,9585	100,00	46.041.884,69				46.041.884,69
25.01.2017	27.01.2017	Kap. JI Inst. Stifternes Kapitaler (2) Oms	DK0060231504	Salg	444.850,00	103,4998	100,00	46.041.886,03				46.041.886,03
28.03.2017	28.03.2017	Kap. JI Inst. Stifternes Kapitaler (1) Oms	DK0060231421	Udbytte			100,00				708.720,00	708.720,00
28.03.2017	28.03.2017	Kap. JI Inst. Stifternes Kapitaler (2) Oms	DK0060231504	Udbytte			100,00				885.900,00	885.900,00
25.04.2017	27.04.2017	Kap. JI Inst. Stifternes Kapitaler (1) Oms	DK0060231421	Salg	70.000,00	102,9700	100,00	7.207.900,00				7.207.900,00
25.04.2017	27.04.2017	Kap. JI Inst. Stifternes Kapitaler (2) Oms	DK0060231504	Salg	70.000,00	102,9100	100,00	7.203.700,00				7.203.700,00
25.04.2017	27.04.2017	Kap JI Inst. Stifternes Kapitaler (3) Oms.	DK0060774396	Salg	70.000,00	100,7100	100,00	7.049.700,00				7.049.700,00
30.06.2017	04.07.2017	Kap. JI Inst. Stifternes Kapitaler (1) Oms	DK0060231421	Køb	40.000,00	103,6202	100,00	4.144.808,00				4.144.808,00
30.06.2017	04.07.2017	Kap. JI Inst. Stifternes Kapitaler (2) Oms	DK0060231504	Køb	40.000,00	103,5718	100,00	4.142.872,00				4.142.872,00
30.06.2017	04.07.2017	Kap JI Inst. Stifternes Kapitaler (3) Oms.	DK0060774396	Køb	40.000,00	101,2165	100,00	4.048.660,00				4.048.660,00
30.08.2017	30.08.2017	Kap. JI Inst. Stifternes Kapitaler (1) Oms	DK0060231421	Udbytte			100,00				684.720,00	684.720,00
30.08.2017	30.08.2017	Kap. JI Inst. Stifternes Kapitaler (2) Oms	DK0060231504	Udbytte			100,00				770.310,00	770.310,00
30.08.2017	30.08.2017	Kap JI Inst. Stifternes Kapitaler (3) Oms.	DK0060774396	Udbytte			100,00				533.148,00	533.148,00

FORKLARINGER TIL RAPPORTEN

Afkastprocent

Afkastprocenten angives som periodens afkast. Afkastet er opgjort som pengevægtet, med mindre andet fremgår af tabellen/teksten. Et pengevægtet afkast betyder, at afkastprocenten påvirkes, hvis der foretages nye indskud til aftalen eller der er trukket midler ud af aftalen i den givne periode. Ændringer i allokering mellem de forskellige aktivklasser kan også påvirke afkastprocenten på aktivklasse niveau.

Tidsvægtet afkastprocent

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.

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 sammenlagt 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.

Gennemsnitlig købskurs

Kursen er opgjort efter FIFO metoden. For køb der ligger før 31.12.2001 eller startdato for depotet vises ikke den reelle anskaffelsessum, men kursen pr. 31.12.2001 eller pr. startdatoen.

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.