

# Nordea

## Afkastrapport

Faxe Kommune 31-12-2021





# Indhold

1. Porteføljeoverblik	2
2. Obligationer	4
3. Aktier	5
4. Afkastopgørelse	7
5. Handelstransaktioner	8
6. Andre transaktioner	10
Appendiks 1 - Nøgletal for porteføljen	11
Appendiks 2 - Vedhængende rente	12
Appendiks 3 - Produktinformation	13
Appendiks 4 - Yderligere information	14
Appendiks 5 - Definitioner	16

## Ansvarsfraskrivelse

Nordea er en fælles betegnelse på enhederne i Nordea Bank Abp og bankens respektive filialer i henholdsvis Norge, Sverige og Danmark.

Oplysningerne i dette materiale er udelukkende ment som generel information og henvender sig alene til de modtagere, som materialet er rettet mod. Vurderinger samt øvrige oplysninger i materialet er gældende pr udgivelsesdatoen og kan ændres uden varsel.

Dette er ikke en udtømmende beskrivelse af det omtalte produkt eller de dermed forbundne risici, og der gives ingen garanti for, at oplysningerne er nøjagtige eller komplette. Materialet er gennemgået omhyggeligt, og

vurderingerne er foretaget efter vores bedste skøn.

Oplysningerne i dette materiale er ikke investeringsrådgivning og skal ej heller ses som et tilbud om eller en opfordring til køb eller salg af finansielle instrumenter. Oplysningerne heri tager ikke højde for bestemte modtageres investeringsformål, finansielle situation eller behov. Det tilrådes altid at indhente relevant og konkret professionel rådgivning, inden der træffes investerings eller kreditbeslutninger. Det bemærkes, at historiske afkast ikke er nogen garanti for fremtidige afkast.

Nordea er ikke ansvarlig for rigtigheden eller fuldstændigheden af informationen i rapporten og som følge heraf heller ikke for eventuelle tab som

følge af fejl eller mangler.

Nordea er ikke rådgiver for så vidt angår juridiske, skattemæssige, regnskabsmæssige eller lovgivningsmæssige forhold. Dette dokument må ikke gengives, distribueres eller offentliggøres uden forudgående skriftligt tilsagn fra Nordea.

Nordea Bank Abp  
Satamaradankatu 5  
FI-00020 NORDEA, Finland, domicil Helsinki  
Virksomhedsnummer 2858394-9  
Yderligere information om Nordea er tilgængelig på [www.nordea.com](http://www.nordea.com)

# 1. Porteføljeoverblik

## Gevinst/tab (DKK)

	ÅTD (2021)	QTD (DECEMBER)
Markedsværdi ved periodens start	175.077.324	174.031.012
Markedsværdi på rapporteringsdato	174.061.277	174.061.277
Netto cashflow	3.069.652	1.524.278

## GEVINST OG TAB

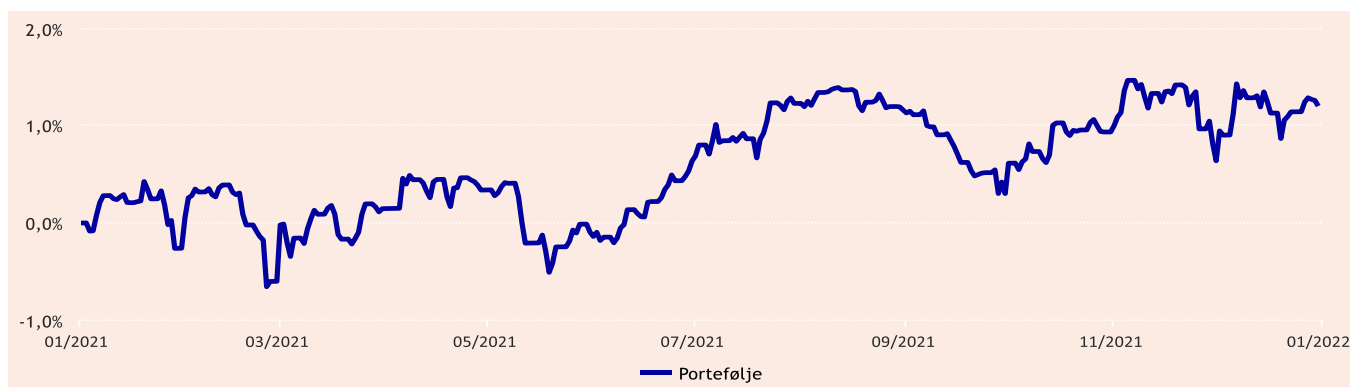
2.053.605

1.554.543

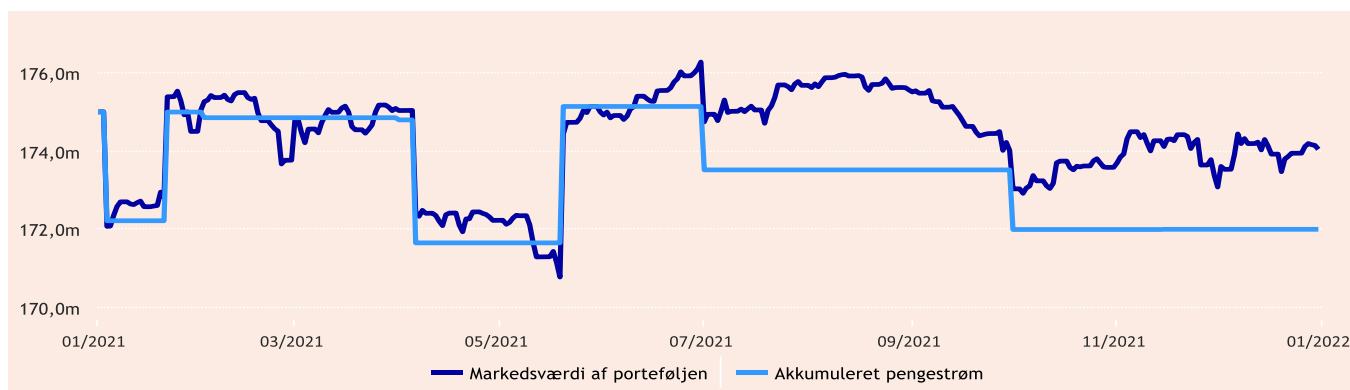
## Performance (%)

	ÅTD (2021)	QTD (DECEMBER)
Afkast	1,20	0,90
Volatilitet	1,91	2,15

## Historisk performance (%)



## Historisk performance (kr)



# 1. Porteføljeoverblik

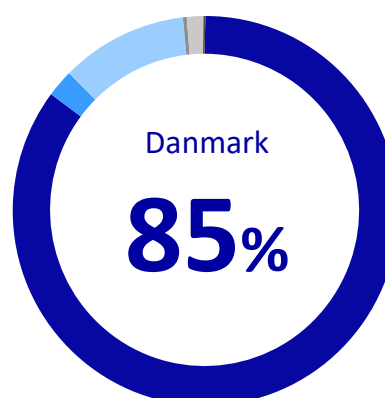
## Fordeling mellem aktivklasser

AKTIVTYPE	VÆGT
● Aktier	15%
● Realkreditobligationer	85%
● Statsobligationer	0%
● Virksomhedsobligationer IG	0%
● Virksomhedsobligationer højrente	0%
● Emerging Markets obligationer	0%
● Uden rating	0%
● Kontant/pengemarked	0%
● Alternative investeringer	0%



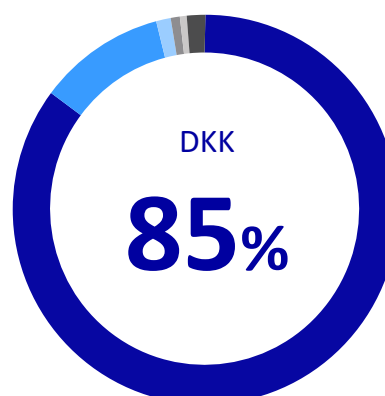
## Geografisk fordeling

REGION	VÆGT
● Danmark	85%
● Vesteuropa	2%
● Nordamerika	11%
● Japan	0%
● Emerging Markets	1%
● Øvrige udviklede lande	0%



## Fordeling på valuta

VALUTA	VÆGT
● DKK	85%
● USD	11%
● EUR	1%
● GBP	1%
● HKD	1%
● Øvrige	2%



## 2. Obligationer

### Nøgletal

Markedsværdi (kr)	148.261.061
Effektiv rente (%)	0,01
Varighed (korrig.)	2,58
Spreadrisiko	3,06

# 85%

Vægt i porteføljen

### Performance (%)

	ÅTD (2021)	QTD (DECEMBER)
Afkast	-1,72	0,18
Volatilitet	1,18	1,33

### Nøgletal for realkreditobligationer

PAPIRNAVN	VÆGT (%)	VALUTA	NOMINELT	KURS	MARKEDSVÆRDI (KR)	VARIGHED (KORRIG.)	EFFEKTIV RENTE (%)
Nyk Frn 01Oct22 A lo (G)	24,0	DKK	41.741.587,20	100,15	41.795.411	0,25	-0,57
Nyk .5 01Oct43 (E)	18,1	DKK	33.724.220,36	93,53	31.582.274	8,18	1,16
Jykre Frn 01Jul24 lo (E)	12,1	DKK	20.834.422,77	100,81	20.998.742	0,25	-0,29
Nyk -.5 01Oct30 (E)	6,8	DKK	12.433.967,07	95,85	11.902.584	3,94	0,51
Rd 1 01Jan26 Blt A (T)	6,4	DKK	10.635.663,00	103,74	11.139.502	3,94	0,01
Dlr Frn 01Jul25 A lo (B)	5,9	DKK	10.173.671,74	100,97	10.270.692	0,49	-0,13
Rd Frn 01Jul23 Cita-6M A lo (T)	5,7	DKK	9.915.802,02	100,33	9.945.634	0,49	-0,46
Nyk 1 01Jul22 Blt (H)	5,2	DKK	9.000.000,00	100,63	9.101.761	0,49	-0,59
<b>TOTAL</b>	<b>84,3</b>				<b>146.736.600</b>	<b>2,58</b>	<b>0,01</b>

### Nøgletal for udtrukneobligationer

UDTRUKNE OBLIGATIONER	VÆGT (%)	VALUTA	NOMINELT	KURS	MARKEDS- VÆRDI (KR)	UDTRUKKET PR.
Nyk Frn 01Oct22 A lo (G)	0,3	DKK	535.394,89	100,00	535.288	03-01-2022
Nyk .5 01Oct43 (E)	0,3	DKK	434.845,25	100,00	435.383	03-01-2022
Nyk -.5 01Oct30 (E)	0,2	DKK	425.538,74	100,00	425.013	03-01-2022
Dlr Frn 01Jul25 A lo (B)	0,0	DKK	64.468,64	100,00	64.461	03-01-2022
Rd Frn 01Jul23 Cita-6M A lo (T)	0,0	DKK	34.154,69	100,00	34.144	03-01-2022
Jykre Frn 01Jul24 lo (E)	0,0	DKK	30.179,44	100,00	30.174	03-01-2022
<b>TOTAL</b>	<b>0,9</b>				<b>1.524.462</b>	



## 3. Aktier

### Nøgletal for porteføljen

Markedsværdi (kr) 25.800.215

# 15%

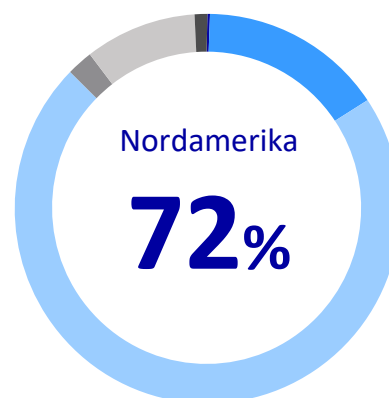
Vægt i porteføljen

### Performance (%)

	ÅTD (2021)	QTD (DECEMBER)
Afkast	23,00	5,25
Volatilitet	12,11	13,64

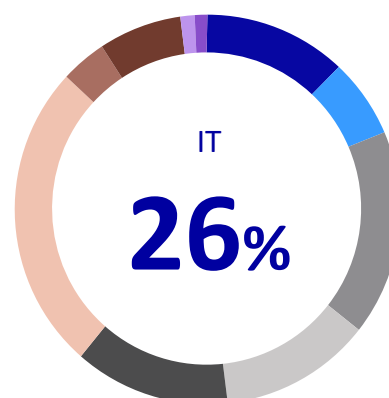
### Geografisk fordeling

REGION	VÆGT
● Danmark	0%
● Vesteuropa	15%
● Nordamerika	72%
● Japan	2%
● Emerging Markets	9%
● Øvrige udviklede lande	1%



### Sektorfordeling

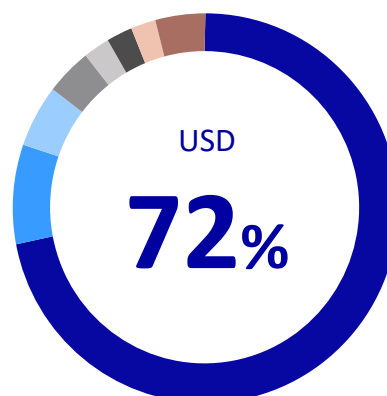
SEKTOR	VÆGT
● Cyklisk forbrug	12%
● Stabilt forbrug	7%
● Energi	0%
● Finans	17%
● Medicinal	13%
● Industri	13%
● IT	26%
● Råvarer	4%
● Kommunikationservice	7%
● Ejendomme	1%
● Forsyning	1%
● Øvrige	0%



## 3. Aktier

### Fordeling på valuta

VALUTA	VÆGT
● USD	72%
● EUR	8%
● GBP	5%
● HKD	4%
● KRW	2%
● JPY	2%
● TWD	2%
● Øvrige	4%



### Nøgletal for investeringsforeninger

PAPIRNAVN	VÆGT (%)	VALUTA	ANTAL	KURS	MARKEDSVÆRDI (KR)
Nordea Invest Global Stars KI2	14,8	DKK	160.958,00	160,29	25.800.215
<b>TOTAL</b>	<b>14,8</b>				<b>25.800.215</b>



## 4. Afkastopgørelse

### Obligationer

PAPIRNAVN	REALISERET KURSGEVINST/TAB	UREALISERET KURSGEVINST/TAB	RENTE/KUPON	OMK.	AFKAST I ALT	IRR (%)
Jykre Frn 01Jul24 lo (E)	-630,81	27.298,03	-15.173,50	0,00	11.493,72	0,05
Dlr Frn 01Jul25 A lo (B)	-1.641,09	11.253,48	-5.144,80	0,00	4.467,59	0,04
Rd Frn 01Jul23 Cita-6M A lo (T)	-386,53	-4.690,72	-12.507,82	0,00	-17.585,06	-0,18
Nyk Frn 01Oct22 A lo (G)	-4.552,13	-78.026,94	-30.735,88	7.039,28	-120.354,23	-0,32
Nyk .5 01Oct40 (E)	-121.484,68	-	9.895,78	0,00	-111.588,90	-0,34
Nyk 1 01Jul22 Blt (H)	-29.032,52	-124.470,00	109.204,09	0,00	-44.298,44	-0,40
RD 1.5 01Oct37 (S)	-155.839,33	-	66.695,27	0,00	-89.144,06	-0,74
Rd 1 01Jan26 Blt A (T)	-	-209.522,57	87.707,80	5.621,48	-127.436,25	-1,13
Nyk -.5 01Oct30 (E)	28.889,91	-226.670,75	-67.525,75	0,00	-265.306,59	-2,01
Nyk .5 01Oct43 (E)	6.109,77	-2.006.016,13	163.081,12	17.575,14	-1.854.400,39	-5,37
<b>TOTAL</b>	<b>-278.567,41</b>	<b>-2.610.845,60</b>	<b>305.496,30</b>	<b>30.235,90</b>	<b>-2.614.152,61</b>	<b>-1,72</b>

### Aktier

PAPIRNAVN	REALISERET KURSGEVINST/TAB	UREALISERET KURSGEVINST/TAB	UDBYTTE	OMK.	AFKAST I ALT	IRR (%)
Nordea Invest Global Stars KI2	3.253.733,78	1.274.368,87	144.862,20	0,00	4.672.964,85	-
<b>TOTAL</b>	<b>3.253.733,78</b>	<b>1.274.368,87</b>	<b>144.862,20</b>	<b>0,00</b>	<b>4.672.964,85</b>	<b>22,10</b>

### Andre

PAPIRNAVN	REALISERET KURSGEVINST/TAB	UREALISERET KURSGEVINST/TAB	RENTE/KUPON	OMK.	AFKAST I ALT	IRR (%)
Honorar for invest. rådgivning	-	-	-	5.207,62	-5.207,62	-
<b>TOTAL</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>5.207,62</b>	<b>-5.207,62</b>	<b>0,00</b>

<b>PORTEFØLJE I ALT</b>	<b>2.975.166</b>	<b>-1.336.477</b>	<b>450.358</b>	<b>35.444</b>	<b>2.053.605</b>	<b>1,18</b>
-------------------------	------------------	-------------------	----------------	---------------	------------------	-------------

## 5. Handelstransaktioner

### Obligationer

PAPIRNAVN	ISIN	VALUTA	TRANSAKTIONER	VALØRDATO	NOMINELT/ ANTAL	HANDELS- KURS	BELØB (KR)
Rd Frn 01Jul23 Cita-6M A lo (T)	DK0004612108	DKK	Udtrukket	01-10-2021	34.135	100,00	34.135
Dlr Frn 01Jul25 A lo (B)	DK0006349998	DKK	Udtrukket	01-10-2021	63.773	100,00	63.773
Jykre Frn 01Jul24 lo (E)	DK0009403560	DKK	Udtrukket	01-10-2021	31.073	100,00	31.073
Nyk Frn 01Oct22 A lo (G)	DK0009518979	DKK	Udtrukket	01-10-2021	546.175	100,00	546.175
Nyk -.5 01Oct30 (E)	DK0009525164	DKK	Udtrukket	01-10-2021	425.181	100,00	425.181
Nyk .5 01Oct43 (E)	DK0009527103	DKK	Udtrukket	01-10-2021	419.404	100,00	419.404
Rd Frn 01Jul23 Cita-6M A lo (T)	DK0004612108	DKK	Udtrukket	01-07-2021	32.596	100,00	32.596
Dlr Frn 01Jul25 A lo (B)	DK0006349998	DKK	Udtrukket	01-07-2021	64.930	100,00	64.930
Jykre Frn 01Jul24 lo (E)	DK0009403560	DKK	Udtrukket	01-07-2021	30.908	100,00	30.908
Nyk Frn 01Oct22 A lo (G)	DK0009518979	DKK	Udtrukket	01-07-2021	538.927	100,00	538.927
Nyk -.5 01Oct30 (E)	DK0009525164	DKK	Udtrukket	01-07-2021	429.611	100,00	429.611
Nyk .5 01Oct43 (E)	DK0009527103	DKK	Udtrukket	01-07-2021	430.766	100,00	430.766
RD 1.5 01Oct37 (S)	DK0009297277	DKK	Salg	20-05-2021	10.227.992	103,28	10.584.123
Nyk Frn 01Oct22 A lo (G)	DK0009518979	DKK	Køb	20-05-2021	14.011.300	100,48	-14.084.126
Rd Frn 01Jul23 Cita-6M A lo (T)	DK0004612108	DKK	Udtrukket	06-04-2021	35.255	100,00	35.255
Dlr Frn 01Jul25 A lo (B)	DK0006349998	DKK	Udtrukket	06-04-2021	64.366	100,00	64.366
RD 1.5 01Oct37 (S)	DK0009297277	DKK	Udtrukket	06-04-2021	1.903.303	100,00	1.903.303
Jykre Frn 01Jul24 lo (E)	DK0009403560	DKK	Udtrukket	06-04-2021	31.612	100,00	31.612
Nyk Frn 01Oct22 A lo (G)	DK0009518979	DKK	Udtrukket	06-04-2021	366.587	100,00	366.587
Nyk -.5 01Oct30 (E)	DK0009525164	DKK	Udtrukket	06-04-2021	429.204	100,00	429.204
Nyk .5 01Oct43 (E)	DK0009527103	DKK	Udtrukket	06-04-2021	324.786	100,00	324.786
Rd 1 01Jan26 Blt A (T)	DK0009296543	DKK	Køb	05-03-2021	10.635.663	105,71	-11.266.938
Nyk 1 01Jul22 Blt (H)	DK0009513079	DKK	Salg	05-03-2021	11.000.000	101,75	11.266.938
Nyk .5 01Oct40 (E)	DK0009524357	DKK	Salg	22-01-2021	32.395.915	99,95	32.389.165
Nyk .5 01Oct43 (E)	DK0009527103	DKK	Køb	22-01-2021	35.334.021	99,48	-35.178.165
Rd Frn 01Jul23 Cita-6M A lo (T)	DK0004612108	DKK	Udtrukket	04-01-2021	25.880	100,00	25.880
Dlr Frn 01Jul25 A lo (B)	DK0006349998	DKK	Udtrukket	04-01-2021	63.014	100,00	63.014
RD 1.5 01Oct37 (S)	DK0009297277	DKK	Udtrukket	04-01-2021	1.367.646	100,00	1.367.646
Jykre Frn 01Jul24 lo (E)	DK0009403560	DKK	Udtrukket	04-01-2021	37.362	100,00	37.362
Nyk Frn 01Oct22 A lo (G)	DK0009518979	DKK	Udtrukket	04-01-2021	368.975	100,00	368.975
Nyk .5 01Oct40 (E)	DK0009524357	DKK	Udtrukket	04-01-2021	501.004	100,00	501.004
Nyk -.5 01Oct30 (E)	DK0009525164	DKK	Udtrukket	04-01-2021	427.808	100,00	427.808
<b>TOTAL</b>							<b>2.705.279</b>

### Aktier

PAPIRNAVN	ISIN	VALUTA	TRANSAKTIONER	VALØRDATO	NOMINELT/ ANTAL	HANDELS- KURS	BELØB (KR)
Nordea Invest Global Stars	DK0010301324	DKK	Fusion	07-10-2021	160.958	0,00	0
Nordea Invest Global Stars KI2	DK0061544178	DKK	Fusion	07-10-2021	160.958	0,00	0

## 5. Handelstransaktioner

PAPIRNAVN	ISIN	VALUTA	TRANSAK- TIONER	VALØRDATA	NOMINELT/ ANTAL	HANDELS- KURS	BELØB (KR)
Nordea Invest Global Stars	DK0010301324	DKK	Overført ud	28-09-2021	160.958	-	-
Nordea Invest Global Stars	DK0010301324	DKK	Overført ind	28-09-2021	160.958	-	-
<b>TOTAL</b>							<b>0</b>

## 6. Andre transaktioner

### Pengestrømme

PAPIRNAVN	ISIN	VALUTA	TYPE	DATO	BEHOLDNING	BELØB (KR)
Nyk .5 01Oct43 (E)	DK0009527103	DKK	Rente	01-10-2021	34.578.469	43.223
Dlr Frn 01Jul25 A lo (B)	DK0006349998	DKK	Rente	01-10-2021	10.301.914	-1.288
Rd Frn 01Jul23 Cita-6M A lo (T)	DK0004612108	DKK	Rente	01-10-2021	9.984.092	-3.245
Jykre Frn 01Jul24 lo (E)	DK0009403560	DKK	Rente	01-10-2021	20.895.675	-3.657
Nyk Frn 01Oct22 A lo (G)	DK0009518979	DKK	Rente	01-10-2021	42.823.157	-8.682
Nyk -.5 01Oct30 (E)	DK0009525164	DKK	Rente	01-10-2021	13.284.687	-16.606
Nyk 1 01Jul22 Blt (H)	DK0009513079	DKK	Rente	01-07-2021	9.000.000	89.876
Nyk .5 01Oct43 (E)	DK0009527103	DKK	Rente	01-07-2021	35.009.236	43.762
Dlr Frn 01Jul25 A lo (B)	DK0006349998	DKK	Rente	01-07-2021	10.366.844	-1.296
Rd Frn 01Jul23 Cita-6M A lo (T)	DK0004612108	DKK	Rente	01-07-2021	10.016.688	-3.005
Jykre Frn 01Jul24 lo (E)	DK0009403560	DKK	Rente	01-07-2021	20.926.583	-3.662
Nyk Frn 01Oct22 A lo (G)	DK0009518979	DKK	Rente	01-07-2021	43.362.084	-8.434
Nyk -.5 01Oct30 (E)	DK0009525164	DKK	Rente	01-07-2021	13.714.298	-17.143
RD 1.5 01Oct37 (S)	DK0009297277	DKK	Rente	01-04-2021	12.131.296	45.492
Nyk .5 01Oct43 (E)	DK0009527103	DKK	Rente	01-04-2021	35.334.021	44.168
Dlr Frn 01Jul25 A lo (B)	DK0006349998	DKK	Rente	01-04-2021	10.431.209	-1.304
Rd Frn 01Jul23 Cita-6M A lo (T)	DK0004612108	DKK	Rente	01-04-2021	10.051.943	-3.016
Jykre Frn 01Jul24 lo (E)	DK0009403560	DKK	Rente	01-04-2021	20.958.194	-4.192
Nyk Frn 01Oct22 A lo (G)	DK0009518979	DKK	Rente	01-04-2021	29.717.371	-6.783
Nyk -.5 01Oct30 (E)	DK0009525164	DKK	Rente	01-04-2021	14.143.502	-17.679
Nordea Invest Global Stars	DK0010301324	DKK	Udbytte	02-02-2021	160.958	144.862
RD 1.5 01Oct37 (S)	DK0009297277	DKK	Rente	01-01-2021	13.498.942	50.621
Nyk .5 01Oct40 (E)	DK0009524357	DKK	Rente	01-01-2021	32.896.918	41.121
Dlr Frn 01Jul25 A lo (B)	DK0006349998	DKK	Rente	01-01-2021	10.494.224	787
Rd Frn 01Jul23 Cita-6M A lo (T)	DK0004612108	DKK	Rente	01-01-2021	10.077.822	-4.031
Jykre Frn 01Jul24 lo (E)	DK0009403560	DKK	Rente	01-01-2021	20.995.557	-4.724
Nyk Frn 01Oct22 A lo (G)	DK0009518979	DKK	Rente	01-01-2021	30.086.346	-7.371
Nyk -.5 01Oct30 (E)	DK0009525164	DKK	Rente	01-01-2021	14.571.310	-18.214
<b>TOTAL</b>						<b>369.581</b>

### Forvaltningsomkostninger

	DEPOTNUMMER	DATO	VALUTA	BELØB (KR)
Honorar for invest. rådgivning	1010398812	15-11-2021	DKK	5.208
<b>TOTAL</b>				<b>5.208</b>

# Appendiks 1 - Nøgletal for porteføljen

## Gevinst og tab (kr)

	ÅTD (2021)	QTD (DECEMBER)
Markedsværdi ved periodens start	175.077.324	174.031.012
Markedsværdi på rapporteringsdato	174.061.277	174.061.277
<b>ÆNDRING I MARKEDSVÆRDI</b>	<b>-1.016.048</b>	<b>30.265</b>
	ÅTD (2021)	QTD (DECEMBER)
Investeringer - solgt eller udløbet	87.760.355	1.519.740
Investeringer - købt	-85.055.076	0
Udbytte	144.862	0
Rente	224.719	9.746
Forvaltningsomkostninger	-5.208	-5.208
<b>NETTO CASHFLOW</b>	<b>3.069.652</b>	<b>1.524.278</b>
<b>GEVINST OG TAB</b>	<b>2.053.605</b>	<b>1.554.543</b>

## Performance

	ÅTD (2021)		QTD (DECEMBER)	
	PORTEFØLJE	BENCHMARK	PORTEFØLJE	BENCHMARK
Afkast	1,20%	-	0,90%	-
Volatilitet	1,91%	-	2,15%	-
Sharpe ratio	0,97	-	0,93	-
Intern rente (IRR)	1,18%	-	0,90%	-

## Appendiks 2 - Vedhængende rente

### Obligationer

PAPIRNAVN	VALUTA	NOMINELT	KURS	VEDH. RENTE	KURS, INKL. VEDH. RT.	MARKEDS- VÆRDI, (KR)	VEDH. RENTE (KR)	MARKEDS- VÆRDI, INKL. VEDH. RT. (KR)
Dlr Frn 01Jul25 A lo (B)	DKK	10.173.672	100,97	-0,01	100,95	10.271.949	-1.258	10.270.692
Dlr Frn 01Jul25 A lo (B)	DKK	64.469	100,00	-0,01	99,99	64.469	-8	64.461
Jykre Frn 01Jul24 lo (E)	DKK	20.834.423	100,81	-0,02	100,79	21.002.348	-3.606	20.998.742
Jykre Frn 01Jul24 lo (E)	DKK	30.179	100,00	-0,02	99,98	30.179	-5	30.174
Nyk -.5 01Oct30 (E)	DKK	12.433.967	95,85	-0,12	95,73	11.917.957	-15.374	11.902.584
Nyk -.5 01Oct30 (E)	DKK	425.539	100,00	-0,12	99,88	425.539	-526	425.013
Nyk .5 01Oct43 (E)	DKK	33.724.220	93,53	0,12	93,65	31.540.577	41.697	31.582.274
Nyk .5 01Oct43 (E)	DKK	434.845	100,00	0,12	100,12	434.845	538	435.383
Nyk 1 01Jul22 Blt (H)	DKK	9.000.000	100,63	0,50	101,13	9.056.700	45.061	9.101.761
Nyk Frn 01Oct22 A lo (G)	DKK	41.741.587	100,15	-0,02	100,13	41.803.782	-8.371	41.795.411
Nyk Frn 01Oct22 A lo (G)	DKK	535.395	100,00	-0,02	99,98	535.395	-107	535.288
Rd 1 01Jan26 Blt A (T)	DKK	10.635.663	103,74	1,00	104,74	11.033.437	106.065	11.139.502
Rd Frn 01Jul23 Cita-6M A lo (T)	DKK	9.915.802	100,33	-0,03	100,30	9.948.822	-3.188	9.945.634
Rd Frn 01Jul23 Cita-6M A lo (T)	DKK	34.155	100,00	-0,03	99,97	34.155	-11	34.144
<b>TOTAL</b>						<b>148.100.154</b>	<b>160.907</b>	<b>148.261.061</b>

## Appendiks 3 - Produktinformation

### Nøgletal for obligationer

PAPIRNAVN	ISIN	UDLØBSDATO	NÆSTE CALL/ESTIMERET UDLØB	PRIORITETS- RÆKKEFØLGE	KUPON	VALUTA
Nyk Frn 01Oct22 A lo (G)	DK0009518979	01-10-2022	01-10-2022	Sikret	CIBOR03M+0,13	DKK
Nyk .5 01Oct43 (E)	DK0009527103	01-10-2043	01-10-2043	Sikret	0,500	DKK
Jykre Frn 01Jul24 lo (E)	DK0009403560	01-07-2024	01-07-2024	Sikret	CIBOR03M+0,14	DKK
Nyk -.5 01Oct30 (E)	DK0009525164	01-10-2030	01-10-2030	Sikret	-0,500	DKK
Rd 1 01Jan26 Blt A (T)	DK0009296543	01-01-2026	01-01-2026	Sikret	1,000	DKK
Dlr Frn 01Jul25 A lo (B)	DK0006349998	01-07-2025	01-07-2025	Sikret	CIBOR06M+0,06	DKK
Rd Frn 01Jul23 Cita-6M A lo (T)	DK0004612108	01-07-2023	01-07-2023	Sikret	CITF06M+0,28	DKK
Nyk 1 01Jul22 Blt (H)	DK0009513079	01-07-2022	01-07-2022	Sikret	1,000	DKK

### Nøgletal for investeringsforeninger

PAPIRNAVN	ISIN	AKTIVTYPE	TYPE	ÅOP	VALUTA
Nordea Invest Global Stars KI2	DK0061544178	Aktier	Udloddende	0,86%	DKK



## Appendiks 4 - Yderligere information

### Kunde

Faxe Kommune

### Rapporteringsmetodik

---

Startdato	01-01-2021
Rapporteringsdato	31-12-2021
Beregningsgrundlag	ÅTD
Regnskabskonvention	Valørdato

---

### Anvendte valutakurser

---

	EUR
DKK	7,4364

---

### Depoter

1010213879

1010398812

## Appendiks 4 - Yderligere information

### Beregningsdetaljer

Alle tal og beregninger er baseret på Nordeas information om kundens beholdninger opbevaret i de depoter, som indgår i rapporten. Beholdninger rapporteres kun, når offentlig information er tilgængelig. For investeringer udstedt af Nordea samt danske realkreditobligationer er informationer baseret på Nordeas systemer. For investeringer, som ikke er udstedt af Nordea, er informationer baseret på offentligt tilgængelige kilder hovedsagelig Bloomberg.

Markedsværdien er som udgangspunkt opgjort som den værdi, værdipapirerne kan sælges til i markedet. Hvis der ikke findes en budkurs anvendes seneste lukkekurs. Markedsværdien indeholder vedhængende renter. Udtrukne obligationer opgøres til den udtrukne kurs på publiceringsdatoen. Markedsværdien er opgjort i danske kroner (DKK) med mindre andet er angivet.

Alle investeringer i udenlandsk valuta er omregnet til danske kroner med Den Europæiske Centralbanks (ECB) officielle valutakurser. Pengestrømme (kuponbetalinger, dividender og renter) er beregnet ved hjælp af offentligt tilgængelig information og er ikke baseret på de faktiske betalinger. De faktiske pengestrømme kan derfor afvige fra de pengestrømme, som vises i rapporten.

Allokeringer vises på instrument niveau. Det indebærer, at fonde og strukturerede produkter er vist fordelt på de underliggende aktiver og kan indeholde flere aktivklasser.

På porteføljeniveau er afkastet beregnet efter den tidsvægtede afkastberegningmetode (TWR), som måler det gennemsnitlige afkast på en investeret krone. Det er den metode, der bedst illustrerer værdien af investeringsbeslutningerne, idet den er uafhængig af eventuelle indskud til og udtræk fra porteføljen. Med den tidsvægtede metode er det muligt at sammenligne det procentuelle afkast med afkast i tidligere år, afkast på indeks eller andre porteføljer. På fondskodeniveau beregnes afkastet efter intern rente metoden (IRR). IRR defineres som den diskonteringsrente, der for en given periode medfører, at den diskonterede værdi af cashflow i perioden og ultimo værdi matcher startværdien for perioden. IRR beregnes også på porteføljeniveau.

Såfremt Nordea ikke har de korrekte oplysninger om anskaffelsesværdien, kan dette give fejl i beregningen af kursgevinst/tab.

Omkostningsfelterne indeholder ikke oplysninger om investeringsfondes omkostninger til eksempelvis administration, handel, depotbank og porteføljepleje. Information om disse omkostninger (ÅOP) kan ses i Appendiks under Produktinformation eller findes på foreningens hjemmeside.

Nordea er ikke ansvarlig for, at den leverede information er korrekt og fuldstændig og derfor heller ikke ansvarlig for tab, som måtte opstå som følge af fejl eller mangler i rapporten. Der er ikke taget højde for skattemæssige implikationer.

# Appendiks 5 - Definitioner

## Markedsværdi (kr)

Markedsværdien er den opgjorte værdi af porteføljen på rapporteringsdatoen. Markedsværdien er som udgangspunkt opgjort som den værdi, værdipapirerne kan sælges til i markedet. Hvis der ikke findes en budkurs anvendes seneste lukkekurs. Markedsværdien indeholder vedhængende renter. Udtrukne obligationer opgøres til den udtrukne kurs. Markedsværdien er opgjort i danske kroner med mindre andet er angivet.

## ÅTD / QTD / MTD

ÅTD (år-til-dato) er perioden fra starten af det aktuelle kalenderår til rapporteringsdato. QTD (kvarartal-til-dato) er de seneste 3 måneder fra rapporteringsdatoen. MTD (måned-til-dato) er den seneste måned fra rapporteringsdatoen.

## Netto cashflow (kr)

De beløb, som er tilgået porteføljen som følge af salg, udløb eller udtrækning af værdipapirer, udbytte og kuponbetaling (positiv cashflow) eller fragået som følge af køb af værdipapirer (negativ cashflow) i rapporteringsperioden.

## Gevinst/tab (kr)

Forskellen mellem porteføljens markedsværdi på rapporteringsdatoen og ved starten af rapporteringsperioden plus netto cashflow i perioden.

## Afkast (%)

På porteføljniveau er afkastet beregnet efter den tidsvægtede afkastberegning metode (TWR), som måler det gennemsnitlige afkast på en investeret krone. Det er den metode, der bedst illustrerer værdien af investeringsbeslutningerne, idet den er uafhængig af eventuelle indskud til og udtræk fra porteføljen. Med den tidsvægtede metode er det muligt at sammenligne det procentuelle afkast med afkast i tidligere år, afkast på indeks og afkast på andre porteføljer. På fondskodeniveau beregnes afkastet efter intern rente metoden (IRR). IRR defineres som den diskonteringsrente, der for en given periode medfører, at den diskonterede værdi af cashflow i perioden og ultimo værdi matcher startværdien for perioden.

## Volatilitet (%)

Volatilitet anvendes som et mål for porteføljens risiko. Jo højere volatilitet, jo større er sandsynligheden for, at porteføljens værdi vil ændre sig i den ene eller anden retning.

## Markedskurs

Den viste markedskurs vil som udgangspunkt være den kurs, som et givent værdipapir kan sælges til på rapporteringsdagen. Hvis der ikke findes en offentliggjort budkurs, anvendes den senest handlede kurs.

## Handelskurs

Handelskursen er den kurs, som et værdipapir er købt eller solgt til. Handelskursen vises i den valuta, som værdipapiret er udstedt i, mens markedsværdien af en beholdning er vist i danske kroner.

## Købskurs

Købskursen er den pris, et aktiv er købt til. Købskursen angives i den valuta, som værdipapiret er udstedt i, mens købsværdien er omregnet til danske kroner (eller anden rapporteringsvaluta). I beregning af gevinst/tab vil købskursen i tilfælde af, at der har været flere handler, være et vægtet gennemsnit.

## Appendiks 5 - Definitioner

### Varighed (korrig.)

Varigheden er et udtryk for renterisikoen, idet den viser, hvor følsom obligationens kurs er over for udsving i det generelle renteniveau (rentekurven). Konkret viser varigheden, hvor meget kursen kan forventes at falde/stige (i procent), hvis det generelle renteniveau stiger/falder med 1 procentpoint (100 bp). Hvis varigheden fx er 5, så vil en generel rentestigning på 50 bp alt andet lige medføre et kursfald på ca. 2,5%. Bemærk, at varigheden kun er retvisende ved forholdsvis små renteudsving. NB: For konverterbare obligationer er varigheden korrigeret for risikoen/muligheden for førtidige indfrielse. Det er ikke tilfældet for "kursliste-varighed", og derfor kan den korrigerede varighed være betydeligt lavere end den varighed, som fremgår af officielle kurslister.

### Effektiv rente (%)

Den effektive rente udtrykker, hvilket afkast (pr. år) man kan opnå, hvis man køber obligationen til den aktuelle kurs og holder den til udløb. Det antages, at alle renter og afdrag undervejs kan geninvesteres til den effektive rente. Effektiv rente siger ikke noget om, hvilket afkast, man kan forvente på kortere sigt, hvor renteudsving kan påvirke kursudviklingen betydeligt. For konverterbare obligationer har den almindelige effektive rente den betydelige ulempe, at der ikke tages højde for risikoen for førtidige indfrielse. Derfor er den et misvisende afkastmål for især højtforrentede konverterbare realkreditobligationer med en kurs tæt på eller over 100. Derfor bør man fokusere på korrigeret effektiv rente, som er det nøgletal, der vises i rapporten.

### Afkast (%)

Afkast i rapporteringsperioden som dækker realiseret og urealiseret gevinst/tab samt pengestrømme i form af renter, udbytter og omkostninger. På porteføljeniveau er afkastet beregnet efter den tidsvægtede afkastberegningss metode (TWR), som måler det gennemsnitlige afkast på en investeret krone. Det er den metode, der bedst illustrerer værdien af investeringsbeslutningerne, idet den er uafhængig af eventuelle indskud til og udtræk fra porteføljen anvendes. Med den tidsvægtede metode er det muligt at sammenligne det procentuelle afkast med afkast i tidligere år, afkast på indeks eller andre porteføljer. På fondskodeniveau beregnes afkastet efter intern rente metoden (IRR). IRR defineres som den diskonteringsrente, der for en given periode medfører, at den diskonterede værdi af pengestrømme i perioden og ultimoværdien matcher startværdien for perioden.

### ÅOP

For bedre at kunne sammenligne omkostningerne i de enkelte investeringsforeninger, benytter branchen det fælles omkostningsnøgletal, Årlige Omkostninger i Procent (ÅOP). ÅOP beregnes ud fra en investeringshorisont på syv år og afspejler således de årlige omkostninger i procent ved at eje et givet investeringsbevis i syv år. ÅOP samler følgende fire omkostningselementer i ét nøgletal: administrationsomkostninger (herunder formidlingsprovision), afdelingens handelsomkostninger, maksimalt emissionstillæg (engangsomkostning) fordelt over 7 år samt maksimalt indløsningsfradrag (engangsomkostning) fordelt over 7 år.

### Sharpe ratio

Et mål for det risikøvejede afkast. Sharpe ratio opgøres som afkastet på porteføljen minus den risikofrie rente divideret med standardafvigelsen. Sharpe ratio er dermed et mål for, hvor godt man bliver belønnet for en påtaget risiko. Den risikofrie rente er udtrykt ved en 3 mdr. Cibor rente.

# Appendiks 5 - Definitioner

## Intern rente (IRR) (%)

IRR er et pengevægtet afkastmål og defineres som den diskonteringsrente, der for en given periode medfører, at den diskonterede værdi af pengestrømme i perioden og ultimoværdien matcher startværdien for perioden. IRR tager højde for ind- og udbetalinger til porteføljen samt tidspunktet for og størrelsen af disse. Med andre ord siger det noget om det afkast, investor har opnået af det investerede beløb.

## Merafkast (%)

Merafkastet udtrykker differencen mellem porteføljens afkast og afkastet på det valgte benchmark.

## Tracking error (%)

Et mål for hvor tæt porteføljen følger det tilknyttede benchmark. Det beregnes som standardafvigelsen af forskellen mellem afkastet på porteføljen og på benchmark.

## Information ratio

Et mål for det risiko-justerede afkast. Det beregnes som merafkastet i forhold til det valgte benchmark divideret med tracking error. Det anvendes som et mål for evnen til at skabe afkast ved en given risiko.

## Næste call/estimeret udløb

For obligationer indeholdende en call-option er "Næste call" den første mulige dato, hvor udsteder kan indfri obligationen. Estimeret udløb er den dato, som udfra prisningen i markedet anses som den mest sandsynlige udløbsdato (call dato eller udløbsdato). På danske konverterbare realkreditobligationer vises oprindelig udløbsdato, selvom der kan forekomme ekstraordinære indfrielse.

## Prioritetsrækkefølge

Definerer hvor i kapitalstrukturen en obligationsudstedelse har fundet sted og rækkefølgen for tilbagebetaling til kreditorerne i tilfælde af manglende betalingsevne hos udsteder.

**Kunde**  
Faxe Kommune

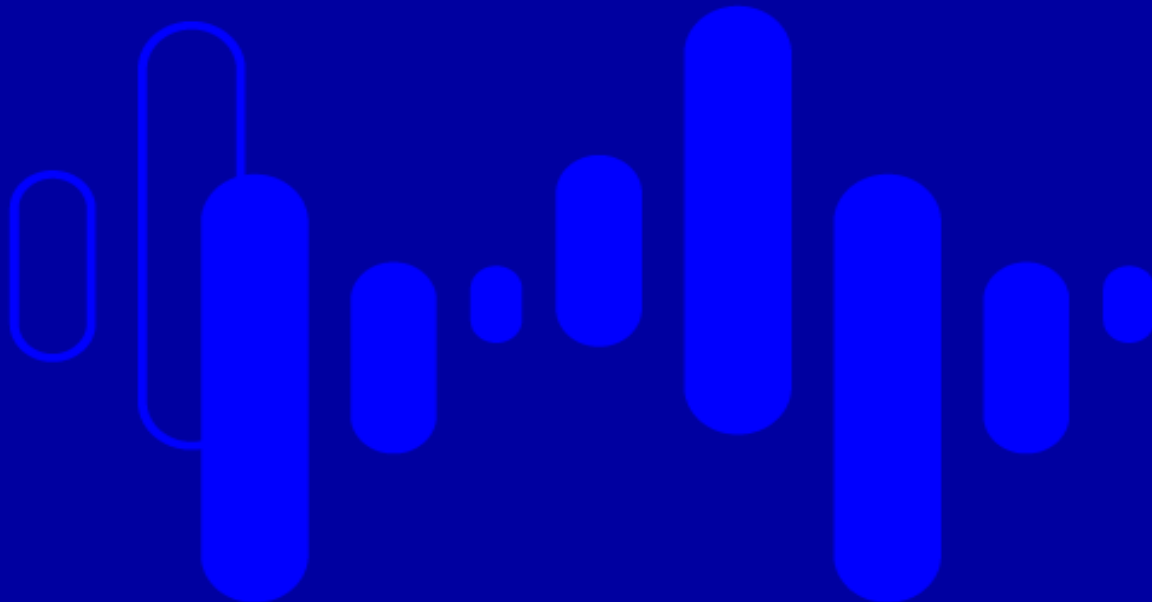
**Rådgiver**  
Henrik Lindegaard Thomsen

**Kontaktperson**  
Lillian Fløjgaard

**E-mail**  
henrik.lindegaard.thomsen@nordea.com

**Rapporteringsdato**  
31-12-2021

**Telefon**  
33 33 17 08



**Nordea**