

Jyske Capital

AUGUST 2020

 JYSKE BANK

Aarhus Stift
Dalgas Avenue 46
8000
Aarhus C
Danmark

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

Rapportering af kapitalforvaltning



Aarhus Stift

Periode: 01.01.2020 - 31.08.2020

Rapportering på kapitalforvaltningsaftale med Aarhus Stift

Hermed fremsendes rapportering på aftalen for perioden 01.01.2020 til 31.08.2020

Perioden har resulteret i et tidsvægtet afkast på 0,65% 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.

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.....	14
Ansvarsfraskrivelse.....	16

PORTEFØLJEØVERBLIK

Afkast seneste måned pr. aktivklasse (01.08.2020 - 31.08.2020)

Aktivtype	Afkast	Afkast (%)
■ Obligationer Danmark	-500.678,95	-0,09
■ Kontanter / Gebyr	-135,39	
Total	-500.814,34	-0,09

Afkast år til dato pr. aktivklasse (01.01.2020 - 31.08.2020)

Aktivtype	Afkast	Afkast (%)
■ Obligationer Danmark	3.156.432,04	0,66
■ Kontanter / Gebyr	-456,76	
Total	3.155.975,28	0,65

Beholdningsoversigt pr. aktivklasse (31.08.2020)

Aktivtype	Markedsværdi	Andel (%)
■ Obligationer Danmark	569.782.503,58	100,00
■ Kontanter	136,79	0,00
Total	569.782.640,37	100,00



AFKASTOVERSIGT

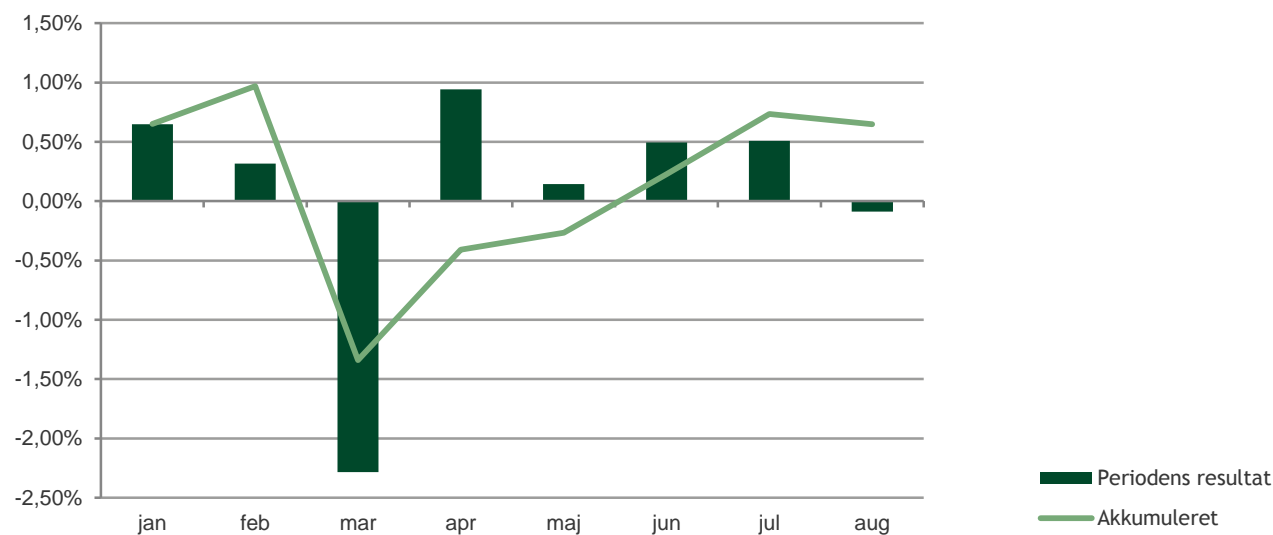
Afkastopgørelse

Formueværdi 01.01.2020		614.180.960,71
Gevinst/tab	-5.713.538,26	
Rente	-456,76	
Udbytte	8.869.970,30	
Refunderede gebyrer	0,00	
Udbytteomkostninger	0,00	
Gebyrer	0,00	
Resultat efter gebyrer		3.155.975,28
Hævet/indsat	-47.554.295,62	
Udbytteskat	0,00	
Depotflyt	0,00	
Formueværdi pr. 31.08.2020		569.782.640,37
Periodens afkast (tidsvægtet)		0,65%

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

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

Tidsvægtet afkast



TIDSVÆGTET AFKAST (%)

Periode	Depot
01.01.2020 til 31.01.2020	0,65
01.02.2020 til 29.02.2020	0,32
01.03.2020 til 31.03.2020	-2,28
01.04.2020 til 30.04.2020	0,94
01.05.2020 til 31.05.2020	0,14
01.06.2020 til 30.06.2020	0,49
01.07.2020 til 31.07.2020	0,51
01.08.2020 til 31.08.2020	-0,09
01.01.2020 til 31.08.2020	0,65

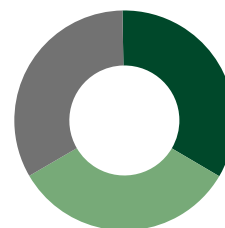
RESULTATSPECIFIKATION (01.01.2020 - 31.08.2020)

Værdipapir	Realiseret kursgevinst	Realiseret valutagevinst	Urealiseret kursgevinst	Urealiseret valutagevinst	Rente / udbytte	Refusion / gebyr	Samlet resultat	Afkast (%)
OBLIGATIONER DANMARK								
<i>Danske kroner</i>								
Kap. JI Inst. Stifternes Kapitaler (1) Oms.beg	-516.031,96	0,00	-2.253.333,69	0,00	3.746.493,90	0,00	977.128,25	0,66
Kap. JI Inst. Stifternes Kapitaler (2) Oms.beg	-193.954,61	0,00	-197.236,89	0,00	1.572.398,80	0,00	1.181.207,30	0,68
Kap JI Inst. Stifternes Kapitaler (3) Oms.beg	-453.108,68	0,00	-2.099.872,43	0,00	3.551.077,60	0,00	998.096,49	0,65
<i>Danske kroner total</i>	-1.163.095,25	0,00	-4.550.443,01	0,00	8.869.970,30	0,00	3.156.432,04	0,66
OBLIGATIONER DANMARK TOTAL	-1.163.095,25	0,00	-4.550.443,01	0,00	8.869.970,30	0,00	3.156.432,04	0,66
KONTANTER								
<i>Danske kroner</i>								
DANSKE KRONER Interest Transaktionskonti	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	
DANSKE KRONER Transaktionskonti	0,00	0,00	0,00	0,00	-456,76	0,00	-456,76	
<i>Danske kroner total</i>	0,00	0,00	0,00	0,00	-456,76	0,00	-456,76	
KONTANTER TOTAL	0,00	0,00	0,00	0,00	-456,76	0,00	-456,76	
PORTEFØLJE TOTAL	-1.163.095,25	0,00	-4.550.443,01	0,00	8.869.513,54	0,00	3.155.975,28	0,65

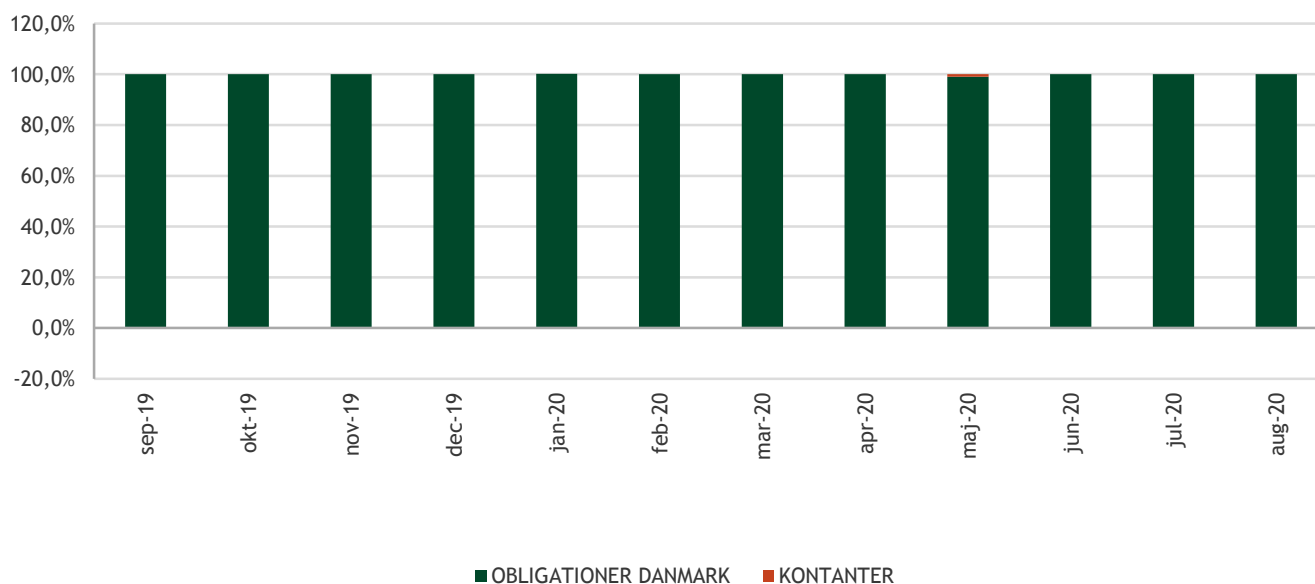
BEHOLDNINGSOVERSIGT

Top 5 beholdninger (31.08.2020)

Aktivnavn	Markedsværdi	Andel (%)
Kap JI Inst. Stifternes Kapitaler (3) Oms.beg	192.277.999	33,74
Kap.JI Inst. Stifternes Kapitaler (2) Oms.beg	188.805.244	33,14
Kap. JI Inst. Stifternes Kapitaler (1) Oms.beg	188.699.261	33,12
DANSKE KRONER Interest Transaktionskonti	-135	0,00
DANSKE KRONER Transaktionskonti	272	0,00
Total	569.782.640	100,00



Allokering seneste år (30.09.2019 - 31.08.2020)



Primo Kontanter (01.01.2020)

Valuta	Beløb
DANSKE KRONER	0,00
KONTANTER TOTAL	0,00

BEHOLDNINGSSPECIFIKATION

Værdipapir	ISIN	Beholdning	Gns. købskurs	Kurs	Markedsværdi	Vedhængende rente	Markedsværdi inkl. vedhængende rente	Portefølje andel (%)
OBLIGATIONER DANMARK								
<i>Danske kroner</i>								
Kap JI Inst. Stifternes Kapitaler (3) Oms.beg	DK0060774396	1.886.410,00	100,45	101,9280	192.277.998,50		192.277.998,50	33,74
Kap. JI Inst. Stifternes Kapitaler (1) Oms.beg	DK0060231421	1.873.124,00	101,59	100,7404	188.699.261,01		188.699.261,01	33,12
Kap. JI Inst. Stifternes Kapitaler (2) Oms.beg	DK0060231504	1.867.098,00	101,35	101,1223	188.805.244,07		188.805.244,07	33,14
<i>Danske kroner total</i>					<i>569.782.503,58</i>		<i>569.782.503,58</i>	<i>100,00</i>
OBLIGATIONER DANMARK TOTAL					569.782.503,58		569.782.503,58	100,00
KONTANTER								
<i>Danske kroner</i>								
DANSKE KRONER Interest Transaktionskonti		-135,39	1,00	1,0000	0,00	-135,39	-135,39	0,00
DANSKE KRONER Transaktionskonti		272,18	1,00	1,0000	272,18		272,18	0,00
<i>Danske kroner total</i>					<i>272,18</i>	<i>-135,39</i>	<i>136,79</i>	<i>0,00</i>
KONTANTER TOTAL					272,18	-135,39	136,79	0,00
PORTEFØLJE TOTAL					569.782.775,76	-135,39	569.782.640,37	100,00

TRANSAKTIONSLISTE

Handels dato	Valør dato	Værdipapir	ISIN	Transaktion	Antal	Kurs	Valuta kurs	Handelsbeløb	Kurtage	Andre omk.	Rente / udbytte	Total i valuta	Valuta	Total beløb
14.01.2020	16.01.2020	Kap. JI Inst. Stifternes Kapitaler (1) O	DK0060231421	Salg	-11.000,00	102,2100	100,00	1.124.310,00				1.124.310,00	DKK	1.124.310,00
14.01.2020	16.01.2020	Kap.JI Inst. Stifternes Kapitaler (2) O	DK0060231504	Salg	-11.000,00	101,2400	100,00	1.113.640,00				1.113.640,00	DKK	1.113.640,00
14.01.2020	16.01.2020	Kap JI Inst. Stifternes Kapitaler (3) Om	DK0060774396	Salg	-11.000,00	103,1600	100,00	1.134.760,00				1.134.760,00	DKK	1.134.760,00
17.01.2020	17.01.2020	DANSKE KRONER		Udtræk	-3.372.710,00		100,00					-3.372.710,00	DKK	-3.372.710,00
22.01.2020	24.01.2020	Kap. JI Inst. Stifternes Kapitaler (1) O	DK0060231421	Udbytte			100,00			3.372.611,30		3.372.611,30	DKK	3.372.611,30
22.01.2020	24.01.2020	Kap.JI Inst. Stifternes Kapitaler (2) O	DK0060231504	Udbytte			100,00			1.199.715,60		1.199.715,60	DKK	1.199.715,60
22.01.2020	24.01.2020	Kap JI Inst. Stifternes Kapitaler (3) Om	DK0060774396	Udbytte			100,00			2.799.462,40		2.799.462,40	DKK	2.799.462,40
23.01.2020	23.01.2020	Kap. JI Inst. Stifternes Kapitaler (1) O	DK0060231421	Geninv. udbytte	33.524,00	100,6010	100,00	3.372.547,92				3.372.547,92	DKK	3.372.547,92
23.01.2020	23.01.2020	Kap.JI Inst. Stifternes Kapitaler (2) O	DK0060231504	Geninv. udbytte	11.890,00	100,8942	100,00	1.199.632,04				1.199.632,04	DKK	1.199.632,04
23.01.2020	23.01.2020	Kap JI Inst. Stifternes Kapitaler (3) Om	DK0060774396	Geninv. udbytte	27.422,00	102,0852	100,00	2.799.380,35				2.799.380,35	DKK	2.799.380,35
28.01.2020	28.01.2020	DANSKE KRONER		Udtræk	-228,99		100,00					-228,99	DKK	-228,99
31.01.2020	04.02.2020	Kap. JI Inst. Stifternes Kapitaler (1) O	DK0060231421	Køb	3.000,00	100,9900	100,00	302.970,00				302.970,00	DKK	302.970,00
31.01.2020	04.02.2020	Kap.JI Inst. Stifternes Kapitaler (2) O	DK0060231504	Køb	3.000,00	101,3600	100,00	304.080,00				304.080,00	DKK	304.080,00
31.01.2020	04.02.2020	Kap JI Inst. Stifternes Kapitaler (3) Om	DK0060774396	Køb	3.000,00	102,5500	100,00	307.650,00				307.650,00	DKK	307.650,00
04.02.2020	04.02.2020	DANSKE KRONER		Indskud	914.700,00		100,00					914.700,00	DKK	914.700,00
25.02.2020	27.02.2020	Kap. JI Inst. Stifternes Kapitaler (1) O	DK0060231421	Salg	-10.000,00	101,0100	100,00	1.010.100,00				1.010.100,00	DKK	1.010.100,00
25.02.2020	27.02.2020	Kap.JI Inst. Stifternes Kapitaler (2) O	DK0060231504	Salg	-10.000,00	101,5300	100,00	1.015.300,00				1.015.300,00	DKK	1.015.300,00
25.02.2020	27.02.2020	Kap JI Inst. Stifternes Kapitaler (3) Om	DK0060774396	Salg	-10.000,00	102,7800	100,00	1.027.800,00				1.027.800,00	DKK	1.027.800,00
27.02.2020	27.02.2020	DANSKE KRONER		Udtræk	-3.053.200,00		100,00					-3.053.200,00	DKK	-3.053.200,00
04.03.2020	06.03.2020	Kap. JI Inst. Stifternes Kapitaler (1) O	DK0060231421	Køb	5.000,00	101,0400	100,00	505.200,00				505.200,00	DKK	505.200,00
04.03.2020	06.03.2020	Kap.JI Inst. Stifternes Kapitaler (2) O	DK0060231504	Køb	5.000,00	101,8000	100,00	509.000,00				509.000,00	DKK	509.000,00
04.03.2020	06.03.2020	Kap JI Inst. Stifternes Kapitaler (3) Om	DK0060774396	Køb	5.000,00	102,9000	100,00	514.500,00				514.500,00	DKK	514.500,00
06.03.2020	06.03.2020	DANSKE KRONER		Indskud	1.528.700,00		100,00					1.528.700,00	DKK	1.528.700,00

Jyske Capital

TRANSAKTIONSLISTE • AUGUST 2020

Handels dato	Valør dato	Værdipapir	ISIN	Transaktion	Antal	Kurs	Valuta kurs	Handelsbeløb	Kurtage	Andre omk.	Rente / udbytte	Total i valuta	Valuta	Total beløb
24.03.2020	26.03.2020	Kap. JI Inst. Stifternes Kapitaler (1) O	DK0060231421	Salg	-35.000,00	96,6456	100,00	3.382.596,00				3.382.596,00	DKK	3.382.596,00
24.03.2020	26.03.2020	Kap. JI Inst. Stifternes Kapitaler (2) O	DK0060231504	Salg	-35.000,00	98,5179	100,00	3.448.126,50				3.448.126,50	DKK	3.448.126,50
24.03.2020	26.03.2020	Kap JI Inst. Stifternes Kapitaler (3) Om	DK0060774396	Salg	-35.000,00	98,0489	100,00	3.431.711,50				3.431.711,50	DKK	3.431.711,50
26.03.2020	26.03.2020	DANSKE KRONER		Udtræk	-10.262.434,00		100,00					-10.262.434,00	DKK	-10.262.434,00
31.03.2020	31.03.2020	DANSKE KRONER		Rente			100,00				-69,13	-69,13	DKK	-69,13
01.04.2020	01.04.2020	DANSKE KRONER		Indskud	69,13		100,00					69,13	DKK	69,13
20.04.2020	22.04.2020	Kap. JI Inst. Stifternes Kapitaler (1) O	DK0060231421	Salg	-12.000,00	98,9700	100,00	1.187.640,00				1.187.640,00	DKK	1.187.640,00
20.04.2020	22.04.2020	Kap. JI Inst. Stifternes Kapitaler (2) O	DK0060231504	Salg	-12.000,00	99,9100	100,00	1.198.920,00				1.198.920,00	DKK	1.198.920,00
20.04.2020	22.04.2020	Kap JI Inst. Stifternes Kapitaler (3) Om	DK0060774396	Salg	-12.000,00	100,3400	100,00	1.204.080,00				1.204.080,00	DKK	1.204.080,00
22.04.2020	24.04.2020	Kap. JI Inst. Stifternes Kapitaler (1) O	DK0060231421	Salg	-43.000,00	99,0400	100,00	4.258.720,00				4.258.720,00	DKK	4.258.720,00
22.04.2020	24.04.2020	Kap. JI Inst. Stifternes Kapitaler (2) O	DK0060231504	Salg	-43.000,00	99,9300	100,00	4.296.990,00				4.296.990,00	DKK	4.296.990,00
22.04.2020	24.04.2020	Kap JI Inst. Stifternes Kapitaler (3) Om	DK0060774396	Salg	-43.000,00	100,3900	100,00	4.316.770,00				4.316.770,00	DKK	4.316.770,00
22.04.2020	22.04.2020	DANSKE KRONER		Udtræk	-3.590.640,00		100,00					-3.590.640,00	DKK	-3.590.640,00
24.04.2020	28.04.2020	Kap. JI Inst. Stifternes Kapitaler (1) O	DK0060231421	Salg	-7.000,00	98,9900	100,00	692.930,00				692.930,00	DKK	692.930,00
24.04.2020	28.04.2020	Kap. JI Inst. Stifternes Kapitaler (2) O	DK0060231504	Salg	-7.000,00	99,9400	100,00	699.580,00				699.580,00	DKK	699.580,00
24.04.2020	28.04.2020	Kap JI Inst. Stifternes Kapitaler (3) Om	DK0060774396	Salg	-7.000,00	100,3500	100,00	702.450,00				702.450,00	DKK	702.450,00
24.04.2020	24.04.2020	DANSKE KRONER		Udtræk	-12.872.480,00		100,00					-12.872.480,00	DKK	-12.872.480,00
28.04.2020	28.04.2020	DANSKE KRONER		Udtræk	-2.094.960,00		100,00					-2.094.960,00	DKK	-2.094.960,00
29.05.2020	03.06.2020	Kap. JI Inst. Stifternes Kapitaler (1) O	DK0060231421	Salg	-18.000,00	99,8300	100,00	1.796.940,00				1.796.940,00	DKK	1.796.940,00
29.05.2020	03.06.2020	Kap. JI Inst. Stifternes Kapitaler (2) O	DK0060231504	Salg	-18.000,00	100,8200	100,00	1.814.760,00				1.814.760,00	DKK	1.814.760,00
29.05.2020	03.06.2020	Kap JI Inst. Stifternes Kapitaler (3) Om	DK0060774396	Salg	-18.000,00	101,2900	100,00	1.823.220,00				1.823.220,00	DKK	1.823.220,00
03.06.2020	03.06.2020	DANSKE KRONER		Udtræk	-5.434.920,00		100,00					-5.434.920,00	DKK	-5.434.920,00
10.06.2020	12.06.2020	Kap. JI Inst. Stifternes Kapitaler (1) O	DK0060231421	Salg	-17.000,00	99,8000	100,00	1.696.600,00				1.696.600,00	DKK	1.696.600,00
10.06.2020	12.06.2020	Kap. JI Inst. Stifternes Kapitaler (2) O	DK0060231504	Salg	-17.000,00	100,6200	100,00	1.710.540,00				1.710.540,00	DKK	1.710.540,00

Jyske Capital

TRANSAKTIONSLISTE • AUGUST 2020

Handels dato	Valør dato	Værdipapir	ISIN	Transaktion	Antal	Kurs	Valuta kurs	Handelsbeløb	Kurtage	Andre omk.	Rente / udbytte	Total i valuta	Valuta	Total beløb
10.06.2020	12.06.2020	Kap JI Inst. Stifternes Kapitaler (3) Om	DK0060774396	Salg	-17.000,00	101,2800	100,00	1.721.760,00				1.721.760,00	DKK	1.721.760,00
15.06.2020	15.06.2020	DANSKE KRONER		Udtræk	-5.128.900,00		100,00					-5.128.900,00	DKK	-5.128.900,00
24.06.2020	26.06.2020	Kap. JI Inst. Stifternes Kapitaler (1) O	DK0060231421	Salg	-7.000,00	100,1800	100,00	701.260,00				701.260,00	DKK	701.260,00
24.06.2020	26.06.2020	Kap. JI Inst. Stifternes Kapitaler (2) O	DK0060231504	Salg	-7.000,00	101,0300	100,00	707.210,00				707.210,00	DKK	707.210,00
24.06.2020	26.06.2020	Kap JI Inst. Stifternes Kapitaler (3) Om	DK0060774396	Salg	-7.000,00	101,7600	100,00	712.320,00				712.320,00	DKK	712.320,00
26.06.2020	26.06.2020	DANSKE KRONER		Udtræk	-2.120.790,00		100,00					-2.120.790,00	DKK	-2.120.790,00
30.06.2020	30.06.2020	DANSKE KRONER		Rente			100,00				-252,24	-252,24	DKK	-252,24
01.07.2020	01.07.2020	DANSKE KRONER		Indskud	252,24		100,00					252,24	DKK	252,24
02.07.2020	06.07.2020	Kap. JI Inst. Stifternes Kapitaler (1) O	DK0060231421	Salg	-27.000,00	100,2300	100,00	2.706.210,00				2.706.210,00	DKK	2.706.210,00
02.07.2020	06.07.2020	Kap. JI Inst. Stifternes Kapitaler (2) O	DK0060231504	Salg	-27.000,00	101,0400	100,00	2.728.080,00				2.728.080,00	DKK	2.728.080,00
02.07.2020	06.07.2020	Kap JI Inst. Stifternes Kapitaler (3) Om	DK0060774396	Salg	-27.000,00	101,7400	100,00	2.746.980,00				2.746.980,00	DKK	2.746.980,00
06.07.2020	06.07.2020	DANSKE KRONER		Udtræk	-8.181.270,00		100,00					-8.181.270,00	DKK	-8.181.270,00
07.08.2020	11.08.2020	Kap. JI Inst. Stifternes Kapitaler (1) O	DK0060231421	Køb	7.000,00	101,1400	100,00	707.980,00				707.980,00	DKK	707.980,00
07.08.2020	11.08.2020	Kap. JI Inst. Stifternes Kapitaler (2) O	DK0060231504	Køb	7.000,00	101,7000	100,00	711.900,00				711.900,00	DKK	711.900,00
07.08.2020	11.08.2020	Kap JI Inst. Stifternes Kapitaler (3) Om	DK0060774396	Køb	7.000,00	102,6000	100,00	718.200,00				718.200,00	DKK	718.200,00
10.08.2020	10.08.2020	DANSKE KRONER		Indskud	2.138.780,00		100,00					2.138.780,00	DKK	2.138.780,00
24.08.2020	26.08.2020	Kap. JI Inst. Stifternes Kapitaler (1) O	DK0060231421	Køb	20.000,00	101,1462	100,00	2.022.924,00				2.022.924,00	DKK	2.022.924,00
24.08.2020	26.08.2020	Kap. JI Inst. Stifternes Kapitaler (2) O	DK0060231504	Køb	20.000,00	101,6797	100,00	2.033.594,00				2.033.594,00	DKK	2.033.594,00
24.08.2020	26.08.2020	Kap JI Inst. Stifternes Kapitaler (3) Om	DK0060774396	Køb	20.000,00	102,6759	100,00	2.053.518,00				2.053.518,00	DKK	2.053.518,00
25.08.2020	25.08.2020	DANSKE KRONER		Indskud	6.110.036,00		100,00					6.110.036,00	DKK	6.110.036,00
25.08.2020	27.08.2020	Kap. JI Inst. Stifternes Kapitaler (1) O	DK0060231421	Salg	-7.000,00	100,9500	100,00	706.650,00				706.650,00	DKK	706.650,00
25.08.2020	27.08.2020	Kap. JI Inst. Stifternes Kapitaler (2) O	DK0060231504	Salg	-7.000,00	101,4100	100,00	709.870,00				709.870,00	DKK	709.870,00
25.08.2020	27.08.2020	Kap JI Inst. Stifternes Kapitaler (3) Om	DK0060774396	Salg	-7.000,00	102,4400	100,00	717.080,00				717.080,00	DKK	717.080,00
25.08.2020	25.08.2020	DANSKE KRONER		Udtræk	-700,00		100,00					-700,00	DKK	-700,00

Jyske Capital

TRANSAKTIONSLISTE • AUGUST 2020

Handels dato	Valør dato	Værdipapir	ISIN	Transaktion	Antal	Kurs	Valuta kurs	Handelsbeløb	Kurtage	Andre omk.	Rente / udbytte	Total i valuta	Valuta	Total beløb
26.08.2020	28.08.2020	Kap. JI Inst. Stifternes Kapitaler (1) O	DK0060231421	Geninv. udbytte	3.711,00	100,7281	100,00	373.801,98				373.801,98	DKK	373.801,98
26.08.2020	28.08.2020	Kap. JI Inst. Stifternes Kapitaler (2) O	DK0060231504	Geninv. udbytte	3.682,00	101,1916	100,00	372.587,47				372.587,47	DKK	372.587,47
26.08.2020	28.08.2020	Kap JI Inst. Stifternes Kapitaler (3) Om	DK0060774396	Geninv. udbytte	7.372,00	101,9424	100,00	751.519,37				751.519,37	DKK	751.519,37
27.08.2020	31.08.2020	Kap. JI Inst. Stifternes Kapitaler (1) O	DK0060231421	Udbytte			100,00				373.882,60	373.882,60	DKK	373.882,60
27.08.2020	31.08.2020	Kap. JI Inst. Stifternes Kapitaler (2) O	DK0060231504	Udbytte			100,00				372.683,20	372.683,20	DKK	372.683,20
27.08.2020	31.08.2020	Kap JI Inst. Stifternes Kapitaler (3) Om	DK0060774396	Udbytte			100,00				751.615,20	751.615,20	DKK	751.615,20
27.08.2020	27.08.2020	DANSKE KRONER		Udtræk	-2.133.600,00		100,00					-2.133.600,00	DKK	-2.133.600,00

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.