

Obligaties

Peildatum	28 sep 2012					
<i>Obligaties Stamrecht BV</i>	<i>ISIN</i>	<i>Gekocht</i>	<i>Verkocht</i>	<i>Percentage</i>	<i>Maanden in bezit</i>	<i>Koers</i>
TNT 5.375% 2007-2017 14/11 (NL0006133175)	NL0006133175	102,80%	108,00%		11,7	
4,625% SNS Bank 2004-2014 18/02 (XS0185887576)	XS0185887576	100,70%	101,35%		16,9	
4,75% ING Groep 2007-17 31/05 (XS0303396062)	XS0303396062	101,20%	105,75%		11,5	
3.625% AAB 2010-17 06/10 (XS0546218925)	XS0546218925	94,50%	100,80%		10,5	
Var. Nederlandse Waterschapsbank 05-45 (XS0222962564)	XS0222962564	67,00%	74,00%		9,6	
NWB Inflatie Protectie Plus Obl. 2008-18 (NL0006258485)	NL0006258485	103,79%	108,00%		9,6	
5% RBS Royal Vast Obligatie 2010-20 (NL0009336684) Vaste rente, maar wel dirty pricing.	NL0009336684	89,47%	112,46%		10,8	
7% BNG 2007-37 (XS0284967881). Vanaf 2014 5*(CMS10-CMS2), Maximaal 9% Aflosbaar vanaf 2014	XS0284967881	99,70%		6,8%	12,9	104,50%
8% ING Perpetual Securities IV (XS0356687219) Aflosbaar vanaf 2013	XS0356687219	87,50%		6,6%	12,5	100,50%
NIB Capital Bank FX Rate 2005-40 4.592% (XS0210781828) 4*(CMS10-CMS2), Minimaal 2.85%, maximaal 8.5%. Aflosbaar 2035.	XS0210781828	51,40%		5,6%	11,9	56,94%
7.25% ASR NL 2009-99 (NL0009213552) Cumulatief. Aflosbaar vanaf 2019	NL0009213552	82,50%		6,4%	11,7	97,50%
3% USG People 2005-12 (XS0230850389) Convertible, maar gezien de koers lijkt conversie uitgesloten.	XS0230850389	97,50%		6,6%	11,0	99,94%
SRLEV 9% 2011-41 (XS0616936372) Tot 2021 9%, daarna 12Mnd Euribor plus 6.165%	XS0616936372	78,80%		7,0%	7,2	85,10%
6.875% Wolters Kluwer Perpetual 2001 (NL0000119105) Inmiddels aflosbaar. Cumulatief en achtergesteld	NL0000119105	99,20%		6,7%	7,1	102,00%
8.375% Achmea Perp. Capital Securities (XS0362173246) Aflosbaar vanaf 2013, achtergesteld cumulatief	XS0362173246	97,60%		6,6%	6,0	100,50%
7.125% Friesland Campina (NL0000113504). Inmiddels aflosbaar.	NL0000113504	104,00%		6,9%	4,2	105,50%
6.655% TenneT Holding (XS0484213268) Rente vast tot 2017, daarna 3.6% plus 5yr Swap (tot 2022). Na 2022 4.6% plus 6mnd Euribor	XS0484213268	102,50%		6,9%	4,1	105,40%
5.125% Achmea (NL0000117224) Cumulatief, aflosbaar 2015	NL0000117224	74,00%		14,5%	3,8	88,20%
9% Delta Lloyd (XS0821168423) Rente vanaf 2022 kwartaalbases. 8.12+3mnd Euribor Cumulatief, aflosbaar 2022	XS0821168423	99,30%		6,7%	0,8	102,20%
SNS FFR 6.258 (XS0310904155) 6.258% tot 2017. Daarna 3maand Euribor + 2.29% Cumulatief Call vanaf 2017	XS0310904155	51,50%		5,8%	0,2	50,54%
7.125% ABN 2012-22 (XS0802995166)	XS0802995166	106,90%		7,0%	0,0	106,90%
<i>Obligaties Prive</i>	<i>ISIN</i>	<i>Gekocht</i>	<i>Verkocht</i>	<i>Percentage</i>	<i>Maanden in bezit</i>	<i>Koers</i>
TNT 5.375% 2007-2017 14/11 (NL0006133175)	NL0006133175	103,15%	108,75%		12,6	
Var. Nederlandse Waterschapsbank 05-45 (XS0222962564)	XS0222962564	66,90%	74,00%		9,1	
SNS FFR 6.258 (XS0310904155)	XS0310904155	44,50%		14,5%	10,6	50,54%
NIB Capital Bank FX Rate 2005-40 4.592% (XS0210781828) 4*(CMS10-CMS2), Minimaal 2.85%, maximaal 8.5%. Aflosbaar 2035.	XS0210781828	56,00%		16,3%	6,9	56,94%
6.994%RBS Royal 8% - 3M Euribor 2010-20 (NL0009336783)	NL0009336783	107,15%		17,0%	4,8	118,83%
2.908% ING Perpetual Securities II (NL0000113587)	NL0000113587	59,10%		11,8%	4,7	55,00%
6% Aegon Capital Sec Perpetual 2006 (NL0000168466)	NL0000168466	80,00%		13,1%	4,4	91,30%
7.25% ASR NL 2009-99 (NL0009213552) Cumulatief. Aflosbaar vanaf 2019	NL0009213552	96,85%		13,9%	0,3	97,50%
4.50886% AXA Acht.g.Float Rate 2004 (XS0188935174) 4%+0.22*CMS10	XS0188935174	61,75%		13,5%	0,3	62,80%