

Obligaties

Obligaties Stamrecht BV (WJ-12a)	ISIN	Gekocht	Verkocht	Percentage	Maanden in bezit	Koers
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 Waterschapbank 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)	NL0009336684	89,47%	112,46%		10,9	
USG 3% (XS0230850389)	XS0230850389	97,50%	100,00%		11,7	
7% BNG 2007-37 (XS0284967881). Vanaf 2014 5*(CMS10-CMS2), Maximaal 9% Aflosbaar vanaf 2014	XS0284967881	99,70%		6,0%	15,8	107,50%
8% ING Perpetual Securities IV (XS0356687219) Aflosbaar vanaf 2013	XS0356687219	87,50%		5,6%	15,4	101,66%
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%	14,9	67,70%
7.25% ASR NL 2009-99 (NL0009213552) Cumulatief, Aflosbaar vanaf 2019	NL0009213552	82,50%		5,8%	14,6	105,25%
SRLEV 9% 2011-41 (XS0616936372) Tot 2021 9%, daarna 12Mnd Euribor plus 6.165%	XS0616936372	78,80%		6,6%	10,2	95,75%
6.875% Wolters Kluwer Perpetual 2001 (NL0000119105) Inmiddels aflosbaar. Cumulatief en achtergesteld	NL0000119105	99,20%		5,7%	10,1	102,50%
8.375% Achmea Perp. Capital Securities (XS0362173246) Aflosbaar vanaf 2013, achtergesteld cumulatief	XS0362173246	97,60%		5,7%	9,0	102,51%
7.125% Friesland Campina (NL0000113504). Inmiddels aflosbaar.	NL0000113504	104,00%		5,8%	7,2	104,30%
6.855% 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%		6,0%	7,0	108,40%
5.125% Achmea (NL0000117224) Cumulatief, aflosbaar 2015	NL0000117224	74,00%		13,4%	6,7	96,50%
9% Delta Lloyd (XS0821168423) Rente vanaf 2022 kwartaalbases. 8.12+3mnd Euribor Cumulatief, aflosbaar 2022	XS0821168423	99,30%		6,2%	3,8	112,05%
SNS FFR 6.258 (XS0310904155) 6.258% tot 2017. Daarna 3maand Euribor + 2.29% Cumulatief Call vanaf 2017	XS0310904155	51,50%		5,0%	3,2	51,75%
7,125% ABN 2012-22 (XS0802995166)	XS0802995166	106,90%		6,5%	2,8	117,47%
RBS Range Accrual Note 2005-35 (NL0000116796) Rente = 5.5*(Perc dagen CMS10>CMS2)	NL0000116796	76,30%		6,0%	2,0	86,63%
4.31% AAB 2006-Perp	XS0246487457	83,30%		4,6%	0,5	83,60%
6% Aegon Capital Sec Perpetual 2006	NL0000168466	99,78%		5,5%	0,1	99,69%
Obligaties Prive (WJ-12b)	ISIN	Gekocht	Verkocht	Percentage	Maanden in bezit	Koers
TNT 5.375% 2007-2017 14/11 (NL0006133175)	NL0006133175	103,15%	108,75%		12,6	
Var. Nederlandse Waterschapbank 05-45 (XS0222962564)	XS0222962564	66,90%	74,00%		9,1	
SNS FFR 6.258 (XS0310904155)	XS0310904155	44,50%		13,6%	13,5	51,75%
NIB Capital Bank FX Rate 2005-40 4.592% (XS0210781828) 4*(CMS10-CMS2), Minimaal 2.85%, maximaal 8.5%. Aflosbaar 2035.	XS0210781828	56,00%		17,8%	9,8	67,70%
6.994%RBS Royal 8% - 3M Euribor 2010-20 (NL0009336783)	NL0009336783	107,15%		16,3%	7,7	123,42%
2.908% ING Perpetual Securities II (NL0000113587)	NL0000113587	59,10%		11,8%	7,7	59,60%
6% Aegon Capital Sec Perpetual 2006 (NL0000168466)	NL0000168466	80,00%		13,1%	7,4	99,69%
7.25% ASR NL 2009-99 (NL0009213552) Cumulatief, Aflosbaar vanaf 2019	NL0009213552	96,85%		13,9%	3,3	105,25%
4.50886% AXA Acht.g.Float Rate 2004 (XS0188935174) 4%+0.22*CMS10	XS0188935174	61,75%		13,5%	3,3	68,50%