

02-06-2012

Obligaties	Gekocht	Verkocht
TNT 5.375% 2007-2017 14/11 (NL0006133175)	102,80%	108,00%
4,625% SNS Bank 2004-2014 18/02 (XS0185887576)	100,70%	
4,75% ING Groep 2007-17 31/05 (XS0303396062)	101,20%	105,75%
3.625% AAB 2010-17 06/10 (XS0546218925)	94,50%	100,80%
Var. Nederlandse Waterschapbank 05-45 (XS0222962564)	67,00%	74,00%
NWB Inflatie Protectie Plus Obl. 2008-18 (NL0006258485)	103,79%	108,00%
7% BNG 2007-37 (XS0284967881). Vanaf 2014 5*(CMS10-CMS2), Maximaal 9% Aflosbaar vanaf 2014	99,70%	
8% ING Perpetual Securities IV (XS0356687219) Aflosbaar vanaf 2013	87,50%	
NIB Capital Bank FX Rate 2005-40 4.592% (NL0009213552) 4*(CMS10-CMS2). Minimaal 2.85%, maximaal 8.5%. Aflosbaar 2035.	51,40%	
7.25% ASR NL 2009-99 (NL0009213552) Cumulatief. Aflosbaar vanaf 2019	82,50%	
3% USG People 2005-12 (XS0230850389) Convertible, maar gezien de koers lijkt conversie uitgesloten.	97,50%	
5% RBS Royal Vast Obligatie 2010-20 (NL0009336684) Vaste rente, maar wel dirty pricing.	89,47%	
SRLEV 9% 2011-41 (XS0616936372) Tot 2021 9%, daarna 12Mnd Euribor plus 6.165%	78,80%	
6.875% Wolters Kluwer Perpetual 2001 (NL0000119105) Inmiddels aflosbaar. Cumulatief en achtergesteld	99,20%	
8.375% Achmea Perp. Capital Securities (XS0362173246) Aflosbaar vanaf 2013, achtergesteld cummulatief	97,60%	
7.125% Friesland Campina (NL0000113504). Inmiddels aflosbaar.	104,00%	
6.655% TenneT Holding (XS0484213268) Rente vast tot 2017, daarna 3.6% plus 5yr Swap (tot 2022). Na 2022 4.6% plus 6mnd Euribor	102,50%	