



AP7 Räntefond

Bilaga till årsberättelse 2015-12-31

Innehavsförteckning

Finansiella instrument med positivt marknadsvärde

Samtliga belopp i tusentals kronor

Överlåtbara värdepapper

Avser överlåtbara värdepapper som är upptagna till handel på en reglerad marknad eller en motsvarande marknad utanför EES.

Realiserat

| <u>Värdepapper</u> | <u>Nominellt belopp</u> | <u>Ansk värde</u> | <u>Ränta</u> | <u>Markn värde inkl uppl ränta</u> | <u>resultat inkl uppl ränta</u> | <u>Andel av fond</u> |
|--|-----------------------------|-------------------|--------------|--|-------------------------------------|--------------------------|
| Statsobligationer | | | | | | |
| Svenska staten 1051 | 2 593 300 | 2 825 564 | -0,44 | 2 805 834 | -19 730 | 12,71% |
| Svenska staten | | | | 2 805 834 | | 12,71% |
| Kommunobligationer | | | | | | |
| Kommuninvest i Sverige 1708 | 1 110 000 | 1 209 381 | -0,18 | 1 201 590 | -7 791 | 5,44% |
| Kommuninvest i Sverige 1806 | 610 000 | 626 055 | 0,10 | 626 676 | 621 | 2,84% |
| Kommuninvest i Sverige AB | | | | 1 828 266 | | 8,28% |
| Säkerställda bostadsobligationer | | | | | | |
| Länsförsäkringar Hypotek 507 | 443 000 | 484 373 | -0,07 | 483 080 | -1 292 | 2,19% |
| Länsförsäkringar Hypotek 511 | 581 000 | 618 039 | 0,26 | 620 528 | 2 489 | 2,81% |
| Länsförsäkringar Hypotek | | | | 1 103 608 | | 5,00% |
| Nordea Hypotek 5528 | 984 000 | 1 042 679 | -0,07 | 1 043 689 | 1 010 | 4,73% |
| Nordea Hypotek 5529 | 2 020 000 | 2 121 416 | 0,23 | 2 128 647 | 7 231 | 9,64% |
| Nordea Hypotek | | | | 3 172 336 | | 14,37% |
| Skandinaviska Enskilda Banken 570 | 1 088 000 | 1 153 096 | -0,07 | 1 153 998 | 903 | 5,23% |
| Skandinaviska Enskilda Banken 571 | 1 386 000 | 1 495 263 | 0,23 | 1 501 791 | 6 528 | 6,80% |
| SEB | | | | 2 655 789 | | 12,03% |
| Stadshypotek 1579 | 2 003 000 | 2 257 373 | -0,07 | 2 243 941 | -13 432 | 10,16% |
| Stadshypotek 1580 | 2 026 000 | 2 183 394 | 0,15 | 2 200 499 | 17 105 | 9,97% |
| Stadshypotek AB | | | | 4 444 440 | | 20,13% |
| Sveriges Säkerställda Obligationer 133 | 452 000 | 489 127 | -0,08 | 488 467 | -660 | 2,21% |
| Sveriges Säkerställda Obligationer 134 | 503 000 | 555 847 | 0,15 | 561 283 | 5 435 | 2,54% |
| AB Sveriges Säkerställda Obligationer | | | | 1 049 750 | | 4,75% |
| Swedbank Hypotek 185 | 1 338 000 | 1 426 845 | -0,14 | 1 439 912 | 13 067 | 6,52% |
| Swedbank Hypotek 186 | 1 475 000 | 1 609 785 | 0,05 | 1 583 371 | -26 415 | 7,17% |
| Swedbank Hypotek 187 | 1 810 000 | 1 987 610 | 0,33 | 1 995 273 | 7 663 | 9,04% |
| Swedbank Hypotek | | | | 5 018 556 | | 22,73% |
| Summa Överlåtbara värdepapper | | 22 085 846 | | 22 078 580 | -7 266 | 99,99% |

Summering av fondförmögenhet

| | <u>Markn värde TSEK</u> | <u>Andel av fond</u> |
|--------------------------------------|-------------------------|----------------------|
| Överlåtbara värdepapper | 22 078 580 | 100,0 % |
| Netto, övriga tillgångar och skulder | 3 995 | 0,0 % |
| Total fondförmögenhet | 22 082 575 | 100,0 % |