

Fagfjárfestasjóðurinn CDO 1 - 31. desember 2005

Rekstur sjóðsins	
Rekstrarreikningur	millj.
1/1/05 – 31/12/05	
Fjármunatekjur	349
Fjármunagjöld	278
Hreinar fjármunatekjur	71
Rekstrarkostnaður	16
Hagnaður tímabilsins	55
Efnahagsreikningur 31/12/05	
Eignir:	
Verðbréf	3.595
Bankainnistæður	490
Samtals eignir	4.085
Skuldir og eigið fé	
Ógreiddur kostnaður	1
Útgefin skuldabréf	3.205
Hlutdeildarskírteini	879
Samtals skuldir og eigið fé	4.085

Helstu eignir			
Röð	Millj.	Utgefandi	Hlutfall af vbr.eign
1	780	Sparisjóður Reykjavíkur og nágr ¹	22%
2	492	Kaupbing Búnaðarbanki hf	14%
3	276	Íslandsbanki - FBA hf	8%
4	222	Húsnæðisstofnun ríkisins	6%
5	182	KB-Skammtímasjóður	5%
6	112	Landsbanki Íslands hf	3%
7	106	Byggðastofnun	3%
8	101	Actavis Group	3%
9	99	KB-Peningamarkaðssjóður	3%
10	95	Íslenskir aðalverktakar hf	3%
11	89	Sparisjóður Hafnarfjarðar	3%
12	74	Sparisjóðabanki Íslands hf	2%
13	72	Líf hf	2%
14	63	Marel hf	2%
15	56	Sparisjóður vélstjóra	2%
16	43	Kópavogsbær	1%
17	41	Akureyrarkaupstaður	1%
18	40	HB-Grandi hf	1%
19	38	Burðarás hf.	1%
20	39	Byko hf	1%

Flokkar eigna

Yfirflokkur	Fjöldi útgefenda	Stærsti aðili í yfirflokki	Hlutfall af yfirflokki	Stærð yfirflokks	Hlutfall yfirflokks af verðbréfum	Líftími yfirflokks
Húsnæðisbréf	2	Húsnæðisstofnun	97%	230	6%	0,83
Sveitarfélög	25	Kópavogsbær	17%	256	7%	3,33
Fjárfmálastofnanir	8	KB-Banki	36%	1.363	38%	2,31
Fjárfestingalánasjóðir	4	SPRON	51%	714	20%	3,19
Kaupleigur	1	VÍS	100%	24	1%	1,16
Skuldabréf fyrirtækja	26	Actavis Group	16%	616	17%	1,35
Veðskuldabréf	41	-	7%	111	3%	5,9
Hlutdeildarskírteini	1	KB-Skammtíma.sj.	65%	281	8%	
Samtals	108			3.595	8%	2,4

Breytingar á skuldabréfum sjóðsins

Flokkur	Nafnverð	Uppreiknuð staða		Staða	Tryggingarstaða
		31.12.2004	31.12.2005		
CDO1 A1	1.100	1.109	503	677	
CDO1 A2	600	605	18	633	
CDO1 A3	350	353	152	224	
CDO1 A4	350	353	126	248	
CDO1 A5	300	303	9	317	2.099
CDO1 B1	250	252	9	264	
CDO1 B2	225	228	15	232	
CDO1 B3	200	202	51	165	661
CDO1 C1	190	192	16	193	
CDO1 C2	150	151	57	106	
CDO1 C3	135	136		146	
	3.850	3.884	956	3.205	3.205

Hlutdeildarskírteini	
Utgefin skírteini	306.803.977
Gengi 26/11/04	2,61431
Gengi 31/12/04	2,68555
Gengi 30/6/05	2,76242
Gengi 31/12/05	2,86567
Arður	
26/11/04 – 31/12/05	0

Varasjóður og laust fé	
	millj.
26.11.2004	0
31.12.2004	80
30.06.2005	633
31.12.2005	851
1/1/05–30/6/05	0

¹SPRON er tilgreindur sem skuldari skv. samstæðureikningsskilum. SPRON er útgefandi að 154 millj. og Frjálsi Fjárfestingarbankinn að 626 millj.