

Fagfjárfestastjóðurinn CDO 1 - 31. mars 2006

Rekstur sjóðsins*	
Rekstrarreikningur	millj.
1/1/06 – 31/03/06	
Fjármunatekjur	87
Fjármunagjöld	58
Hreinar fjármunatekjur	29
Rekstrarkostnaður	3
Hagnaður tímabilsins	26
Efnahagsreikningur 31/03/06	
Eignir:	
Verðbréf	3.328
Bankainnistæður	378
Samtals eignir	3.706
Skuldir og eigið fé	
Ógreiddur kostnaður	1
Útgefin skuldabréf	2.800
Hlutdeildarskírteini	905
Samtals skuldir og eigið fé	3.706
* óendurskoðað uppgjör	

Helstu eignir				
Röð	Millj.	Utgefandi	Hlutfall af vbr.eign	
1	682	Sparisjóður Reykjavíkur og nágr ¹	20%	
2	486	Kaupþing Búnaðarbanki hf hf	15%	
3	276	Íslandsbanki - FBA hf	8%	
4	186	Húsnæðisstofnun ríkisins	6%	
5	185	KB-Skammtímasjóður	6%	
6	120	Landsbanki Íslands hf	4%	
7	109	Byggðastofnun	3%	
8	102	KB-Peningamarkaðssjóður	3%	
9	101	Actavis Group	3%	
10	95	Íslenskir aðalverktakar hf	3%	
11	92	Sparisjóður Hafnarfjarðar	3%	
12	73	Líf hf	2%	
13	65	Marel hf	2%	
14	55	Sparisjóður vélstjóra	2%	
15	42	HB-Grandi hf	1%	
16	41	Akureyrarkaupstaður	1%	
17	40	Kópavogsbær	1%	
18	39	Byko hf	1%	
19	39	Mosfellsbær	1%	
20	35	Burðarás 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	98%	190	6%	0,75
Sveitarfélög	25	Kópavogsbær	17%	238	7%	3,47
Fjárfmálastofnanir	8	KB-Banki	38%	1.292	39%	2,27
Fjárfestingalánasjóðir	4	SPRON	43%	591	18%	3,52
Kaupleigur	1	Vís	100%	25	1%	0,91
Skuldabréf fyrirtækja	26	Actavis Group	17%	597	18%	1,17
Veðskuldabréf	41	-	7%	108	3%	5,45
Hlutdeildarskírteini	1	KB-Skammtíma.sj.	64%	287	9%	
Samtals	108			3.328		2,4

Breytingar á skuldabréfum sjóðsins						
Flokkur	Nafnverð	Uppreiknuð staða	Greitt á tímabili	Uppreiknuð staða	Staða	Tryggingarstaða
		31.12.2005		31.03.2006		
CDO1 A1	1.100	677	170	514		
CDO1 A2	600	633	5	642		
CDO1 A3	350	224	75	152		
CDO1 A4	350	248	126	125		
CDO1 A5	300	317	3	321	1.754	2,11
CDO1 B1	250	264	3	268		
CDO1 B2	225	232	5	232		
CDO1 B3	200	165	17	151	651	1,54
CDO1 C1	190	193	5	192		
CDO1 C2	150	106	53	54		
CDO1 C3	135	146	0	149	395	1,32
	3.850	3.205	462	2.800	2.800	

Hlutdeildarskírteini	
Útgefin 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
Gengi 31/03/06	2,94998
Arður	
26/11/04 – 31/03/06	0

Varasjóður og laust fé	
	millj.
26.11.2004	0
31.12.2004	80
30.06.2005	633
31.12.2005	851
31.03.2006	746
1/1/05–30/6/05	0
Afborganir næsta tímabils:	341

¹SPRON er tilgreindur sem skuldari skv. samstæðureikningsskilum. SPRON er útgefandi að 160 millj. og Frjálsi Fjárfestingarbankinn að 522 millj.