Jyske Capital
AUGUST 2026

Jyske Bank

Roskilde Stift
Stændertorvet 3A
4000
Roskilde
Danmark

Jyske Capital Clients
Jyske Bank A/S
Vestergade 8-16
DK 8600 Silkeborg
+45 89 89 20 32
cm.clientservice@jyskebank.dk
SWIFT: JYBADKKK
CVR: 17616617

Porteføljerapport



Roskilde Stift

Periode: 01.01.2026 - 31.08.2026

Rapportering på kapitalforvaltningsaftale med Roskilde Stift

Hermed fremsendes rapportering på aftalen for perioden 01.01.2026 til 31.08.2026

Perioden har resulteret i et tidsvægtet afkast på 0,61% efter omkostninger.

Rapporten

Rapporten arkiveres i netbanken, og historiske versioner vil altid kunne findes her. Der findes forskellige tilvalgsmuligheder på rapporten og leveranceformen, blandt andet er der mulighed for at få rapporten i Excel.

Hvis I har ønsker om dette, eller andre forespørgsler, kan I kontakte undertegnede eller Client Service på 8989 2032 / cm.clientservice@jyskebank.dk.

Med venlig hilsen

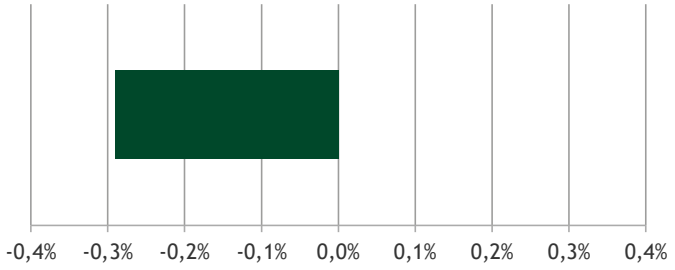
Indhold **Side**

Porteføljeoverblik 4
Afkastoversigt 5
Tidsvægtet afkast 6
Resultatspecifikation 7
Beholdningsoversigt 8
Beholdningsspecifikation 9
Transaktionsliste 10
Forklaringer til rapporten 11
Ansvarsfraskrivelse 13

PORTEFØLJEOVERBLIK

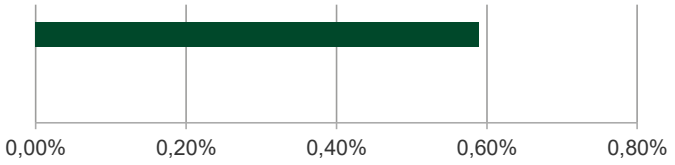
Afkast seneste måned pr. aktivklasse (01.08.2026 - 31.08.2026)

Aktivtype	Afkast	Afkast (%)
Obligationer Danmark	-758.417,00	-0,29
Total	**-758.417,00**	**-0,29**



Afkast år til dato pr. aktivklasse (01.01.2026 - 31.08.2026)

Aktivtype	Afkast	Afkast (%)
Obligationer Danmark	1.274.447,45	0,59
Kontanter / Gebyr	-67,50	
Total	**1.274.379,95**	**0,61**



Beholdningsoversigt pr. aktivklasse (31.08.2026)

Aktivtype	Markedsværdi	Andel (%)
Obligationer Danmark	259.720.918,31	100,00
Total	**259.720.918,31**	**100,00**



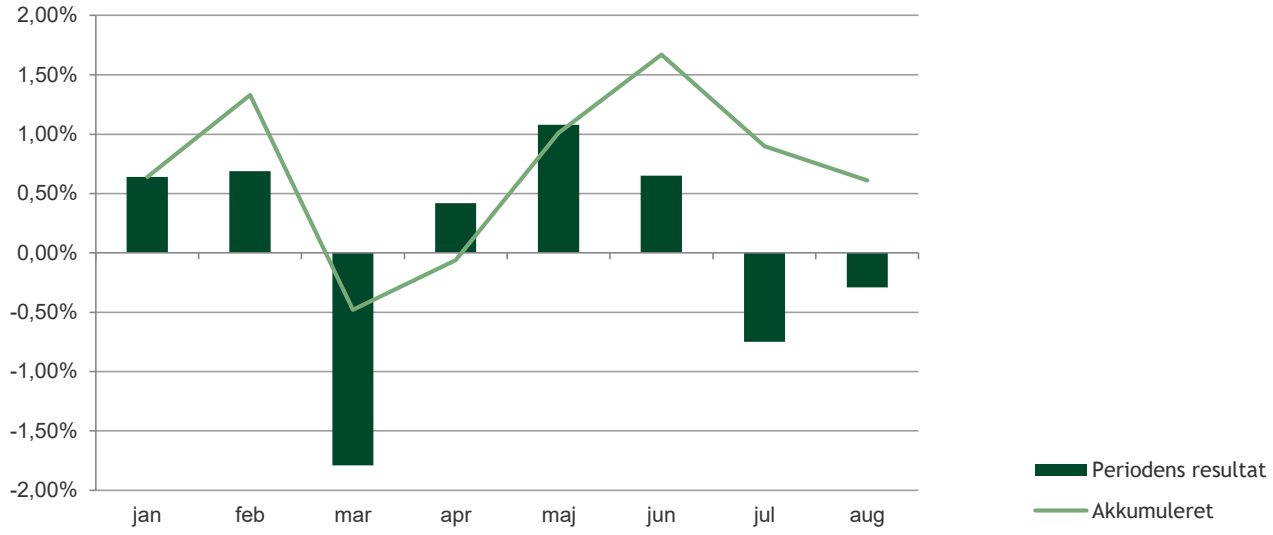
AFKASTOVERSIGT

Afkastopgørelse

Formueværdi 01.01.2026		**268.519.088,89**
Gevinst/tab	-3.471.107,75	
Rente	0,00	
Udbytte	4.745.555,20	
Refunderede gebyrer	0,00	
Udbytteomkostninger	0,00	
Gebyrer	-67,50	
Resultat efter gebyrer		**1.274.379,95**
Hævet/indsat	-10.072.550,53	
Udbytteskat	0,00	
Depotflyt	0,00	
Formueværdi pr. 31.08.2026		**259.720.918,31**
Periodens afkast (tidsvægtet)		**0,61%**

Det totale porteføljeafkast inkluderer et gebyr på 67,50. Handelsomkostninger 0,00 er indregnet i resultatet. De samlede omkostninger i rapporteringsperioden er 67,50.
Ønsker du at få omkostningerne uddybet så kontakt gerne din rådgiver i Jyske Bank.

Tidsvægtet afkast



TIDSVÆGTET AFKAST (%)

Periode	Depot
01.01.2026 til 31.01.2026	0,64
01.02.2026 til 28.02.2026	0,69
01.03.2026 til 31.03.2026	-1,79
01.04.2026 til 30.04.2026	0,42
01.05.2026 til 31.05.2026	1,08
01.06.2026 til 30.06.2026	0,65
01.07.2026 til 31.07.2026	-0,75
01.08.2026 til 31.08.2026	-0,29
01.01.2026 til 31.08.2026	**0,61**

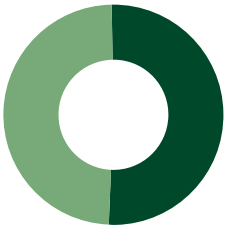
RESULTATSPECIFIKATION (01.01.2026 - 31.08.2026)

Værdipapir	Realiseret kursgevinst	Realiseret valutagevinst	Urealiseret kursgevinst	Urealiseret valutagevinst	Rente / udbytte	Refusion / gebyr	Samlet resultat	Afkast (%)
OBLIGATIONER DANMARK								
Danske kroner								
Kapf. JI Inst Stifternes Kapitaler (1) Oms.beg	-491.118,46	0,00	-3.305.509,24	0,00	4.745.555,20	0,00	948.927,50	0,80
Kapf. JI Inst Stifternes Kapitaler (2) Oms.beg	-46.785,20	0,00	372.305,15	0,00	0,00	0,00	325.519,95	0,37
Danske kroner total	-537.903,66	0,00	-2.933.204,09	0,00	4.745.555,20	0,00	1.274.447,45	0,59
OBLIGATIONER DANMARK TOTAL	**-537.903,66**	**0,00**	**-2.933.204,09**	**0,00**	**4.745.555,20**	**0,00**	**1.274.447,45**	**0,59**
KONTANTER								
Danske kroner								
DANSKE KRONER Interest Transaktionskonti	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	
DANSKE KRONER Transaktionskonti	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	-67,50	-67,50	
Danske kroner total	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	-67,50	-67,50	
KONTANTER TOTAL	**0,00**	**0,00**	**0,00**	**0,00**	**0,00**	**-67,50**	**-67,50**	
PORTEFØLJE TOTAL	**-537.903,66**	**0,00**	**-2.933.204,09**	**0,00**	**4.745.555,20**	**-67,50**	**1.274.379,95**	**0,61**

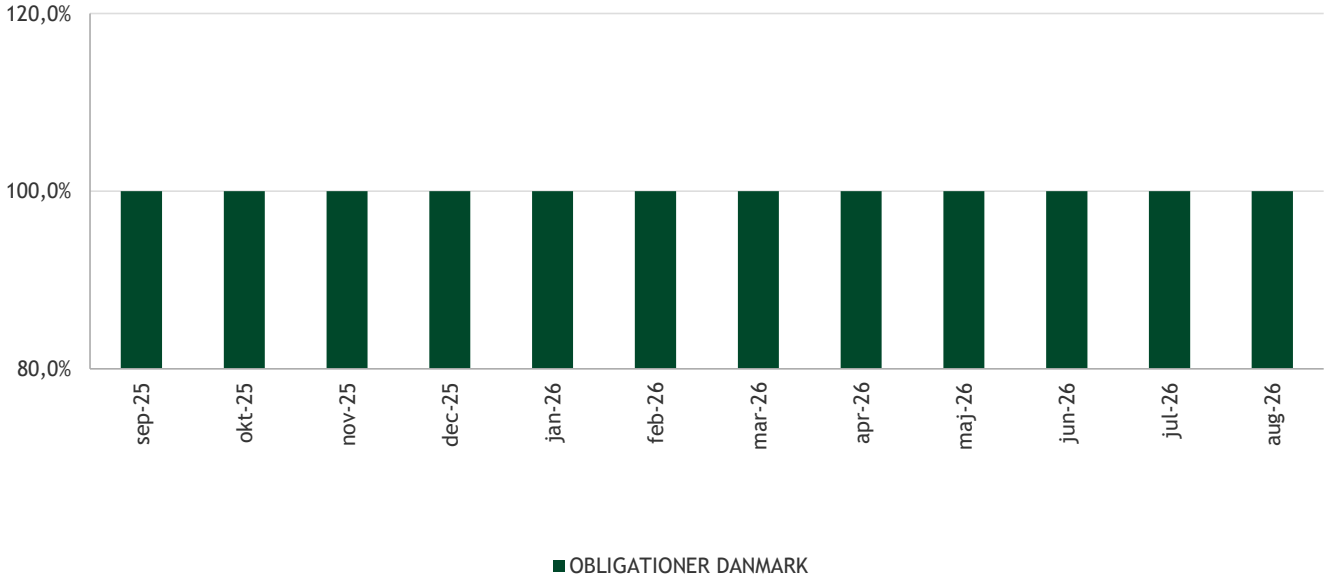
BEHOLDNINGSOVERSIGT

Top 5 beholdninger (31.08.2026)

Aktivnavn	Markedsværdi	Andel (%)
Kapf. JI Inst Stifternes Kapitaler (1) Oms.beg	132.362.062	50,96
Kapf. JI Inst Stifternes Kapitaler (2) Oms.beg	127.358.856	49,04
Total	**259.720.918**	**100,00**



Allokering seneste år (30.09.2025 - 31.08.2026)



Primo Kontanter (01.01.2026)

Valuta	Beløb
DANSKE KRONER	-52,49
KONTANTER TOTAL	**-52,49**

BEHOLDNINGSSPECIFIKATION

Værdipapir	ISIN	Beholdning	Gns. købskurs	Kurs	Markedsværdi	Vedhængende rente	Markedsværdi inkl. vedhængende rente	Porteføljeandel (%)
OBLIGATIONER DANMARK								
Danske kroner								
Kapf. Jl Inst Stifternes Kapitaler (1) Oms.beg	DK0060231421	1.465.750,00	95,76	90,3033	132.362.061,98		132.362.061,98	50,96
Kapf. Jl Inst Stifternes Kapitaler (2) Oms.beg	DK0060231504	1.270.092,00	97,74	100,2753	127.358.856,33		127.358.856,33	49,04
Danske kroner total					*259.720.918,31*		*259.720.918,31*	*100,00*
OBLIGATIONER DANMARK TOTAL					**259.720.918,31**		**259.720.918,31**	**100,00**
PORTEFØLJE TOTAL					**259.720.918,31**		**259.720.918,31**	**100,00**

TRANSAKTIONSLISTE

Handels dato	Valør dato	Værdipapir	ISIN	Transaktion	Antal	Kurs	Valuta kurs	Handelsbeløb	Kurtage	Andre omk.	Rente / udbytte	Total i valuta	Valuta	Total beløb
07.01.2026	07.01.2026	DANSKE KRONER		Indskud	52,49		100,00					52,49	DKK	52,49
07.01.2026	09.01.2026	Kapf. JI Inst Stifternes Kapitaler (1) O	DK0060231421	Køb	15.000,00	93,1735	100,00	1.397.602,50				1.397.602,50	DKK	1.397.602,50
07.01.2026	09.01.2026	Kapf. JI Inst Stifternes Kapitaler (2) O	DK0060231504	Køb	15.000,00	100,1674	100,00	1.502.511,00				1.502.511,00	DKK	1.502.511,00
09.01.2026	09.01.2026	DANSKE KRONER		Indskud	2.900.113,50		100,00					2.900.113,50	DKK	2.900.113,50
26.01.2026	28.01.2026	Kapf. JI Inst Stifternes Kapitaler (1) O	DK0060231421	Geninvestering	52.764,00	89,9391	100,00	4.745.546,67				4.745.546,68	DKK	4.745.546,68
26.01.2026	28.01.2026	Kapf. JI Inst Stifternes Kapitaler (1) O	DK0060231421	Udbytte			100,00				4.745.555,20	4.745.555,20	DKK	4.745.555,20
10.02.2026	10.02.2026	DANSKE KRONER		Udtræk	-8,52		100,00					-8,52	DKK	-8,52
23.03.2026	25.03.2026	Kapf. JI Inst Stifternes Kapitaler (1) O	DK0060231421	Salg	-65.000,00	89,2784	100,00	5.803.096,00				5.803.096,00	DKK	5.803.096,00
23.03.2026	25.03.2026	Kapf. JI Inst Stifternes Kapitaler (2) O	DK0060231504	Salg	-65.000,00	99,1882	100,00	6.447.233,00				6.447.233,00	DKK	6.447.233,00
27.03.2026	27.03.2026	DANSKE KRONER		Udtræk	-12.250.329,00		100,00					-12.250.329,00	DKK	-12.250.329,00
31.03.2026	31.03.2026	DANSKE KRONER		Gebyr			100,00					-31,50	DKK	-31,50
08.04.2026	08.04.2026	DANSKE KRONER		Indskud	31,50		100,00					31,50	DKK	31,50
24.04.2026	28.04.2026	Kapf. JI Inst Stifternes Kapitaler (1) O	DK0060231421	Salg	-65.000,00	89,6308	100,00	5.826.002,00				5.826.002,00	DKK	5.826.002,00
24.04.2026	28.04.2026	Kapf. JI Inst Stifternes Kapitaler (2) O	DK0060231504	Salg	-65.000,00	99,6336	100,00	6.476.184,00				6.476.184,00	DKK	6.476.184,00
28.04.2026	28.04.2026	DANSKE KRONER		Udtræk	-12.302.186,00		100,00					-12.302.186,00	DKK	-12.302.186,00
30.06.2026	30.06.2026	DANSKE KRONER		Gebyr			100,00					-36,00	DKK	-36,00
01.07.2026	03.07.2026	Kapf. JI Inst Stifternes Kapitaler (1) O	DK0060231421	Køb	70.000,00	91,2678	100,00	6.388.746,00				6.388.746,00	DKK	6.388.746,00
01.07.2026	03.07.2026	Kapf. JI Inst Stifternes Kapitaler (2) O	DK0060231504	Køb	70.000,00	101,3061	100,00	7.091.427,00				7.091.427,00	DKK	7.091.427,00
03.07.2026	03.07.2026	DANSKE KRONER		Indskud	13.480.209,00		100,00					13.480.209,00	DKK	13.480.209,00
21.07.2026	23.07.2026	Kapf. JI Inst Stifternes Kapitaler (1) O	DK0060231421	Salg	-35.000,00	90,4564	100,00	3.165.974,00				3.165.974,00	DKK	3.165.974,00
21.07.2026	23.07.2026	Kapf. JI Inst Stifternes Kapitaler (2) O	DK0060231504	Salg	-35.000,00	100,4247	100,00	3.514.864,50				3.514.864,50	DKK	3.514.864,50
28.07.2026	28.07.2026	DANSKE KRONER		Udtræk	-6.680.838,50		100,00					-6.680.838,50	DKK	-6.680.838,50
24.08.2026	26.08.2026	Kapf. JI Inst Stifternes Kapitaler (1) O	DK0060231421	Køb	25.000,00	90,6466	100,00	2.266.165,00				2.266.165,00	DKK	2.266.165,00
24.08.2026	26.08.2026	Kapf. JI Inst Stifternes Kapitaler (2) O	DK0060231504	Køb	25.000,00	100,5696	100,00	2.514.240,00				2.514.240,00	DKK	2.514.240,00
27.08.2026	27.08.2026	DANSKE KRONER		Indskud	4.780.405,00		100,00					4.780.405,00	DKK	4.780.405,00

FORKLARINGER TIL RAPPORTEN

Afkastprocent
Afkastprocenten angives som periodens afkast. Afkastet er opgjort som tidsvægtet igennem hele rapporten. Tidsvægtede afkast viser periodens afkast uden hensyntagen til hvor stor andel af porteføljen, der har været investeret på forskellige tidspunkter. Det tidsvægtede afkast er derfor uafhængigt af udtræk eller indskud i aftalen, og derfor den mest retvisende afkastprocent i forhold til investeringsbeslutninger truffet af Jyske Capital. Tidsvægtede afkast er derfor det mest anvendelige i sammenligninger med benchmark og på tværs af kapitalforvaltere.

Markedsværdi
Markedsværdien er opgjort på grundlag af seneste officielle lukkekurs, med mindre denne kurs er misvisende eller beregnet på grundlag af en atypisk omsætning. Markedsværdier pr. 31.12 er opgjort på grundlag af skattekurser fra VP. Ved Valutakurs anvendes Jyske Banks referencekurs, som er leveret af SIX Financial Information og er fastsat kl. 14:15. Den er angivet i "Beholdningsspecifikationen" i kolonnen "Værdipapir" i parentes efter valutabetegnelsen.

Vedhængende rente
Vedhængende rente for obligationer henviser til de renter, som porteføljen har optjent, men endnu ikke fået udbetalt.

Horisontafkast
Horisontafkast viser det forventede annualiserede afkast for en given obligation de næste seks måneder.

Varighed
Varighed er den officielle varighed, som fremgår af kurslisterne. Varigheden måles i antal år og angiver, hvornår investor har fået sin investering igen. Varigheden er også et risikomål, der angiver, hvor kursfølsom en obligation er over for ændringer i renten. Den officielle varighed tager ikke hensyn til optionselementet i konverterbare obligationer, hvorfor den ikke afspejler den korrekte risiko.

Modificeret varighed
Modificeret varighed beregnes ved, at dividere varigheden for den pågældende obligation med 1 plus den effektive rente på instrumentet. For konverterbare obligationer anvendes Jyske Banks model til beregning af modificeret varighed. Den modificerede varighed er også et risikomål, der angiver hvor kursfølsom en obligation er over for ændringer i renten.

Konveksitet
Kurskonveksiteten angiver ændring i kursrisikoen pr. nominel 100 kr. ved en parallelforskydning af rentekurven med 1%. Obligationer med negativ kurskonveksitet giver typisk et højere afkast end sammenlignelige obligationer ved uændret rente. Ved renteændringer i både op- og nedadgående retning vil afkastet typisk være lavere end på obligationer med højere (mindre negativ eller positiv) konveksitet.

OAS
Rentespænd til swapkurven. OAS (option adjusted spread) for konverterbare obligationer er modelafhængigt og siger derfor ikke noget i sig selv. Udviklingen i OAS over tid kan derimod bruges til at vurdere om en obligation er relativ dyr eller billig. Et voksende OAS tyder på, at obligationen er blevet billigere.

Benchmark
Benchmark er det sammenligningsgrundlag, der er defineret i "Aftalen om Kapitalforvaltning". Benchmarks repræsenterer de enkelte aktivklasser og viser markedsafkastet. Der er ingen investeringsomkostninger i et benchmark.

Udbytte
Udbytte indgår kun netto i kontantbeholdninger, mens afkastberegninger sker på baggrund af bruttoudbytte. Udbytteskat fremgår af afkastoversigten i rapporten sammen med hævede og indsatte beløb.

Kurs- og valutagevinst
Realiseret og urealiseret kurs- og valutagevinst er opgjort i forhold til værdien primo rapporteringsperioden eller værdien af køb foretaget i rappoteringsperioden. Eventuelle handelsomkostninger er indregnet.

Gennemsnitlig købskurs

Gns. Købskurs i "Beholdningsspecifikation" kan alene anvendes af lagerbeskattede kunder, da denne er et udtryk for den gennemsnitlige købskurs siden porteføljens start.

Total i valuta
Afregningsbeløb i den valuta som transaktionen er afregnet i (Transaktionsliste).

Valuta
Afregningskontoens valuta (Transaktionsliste).

Total beløb
Afregningsbeløb i rapporteringsvaluta. Hvis afregningskontoens valuta er den samme som rapporteringsvalutaen, svarer beløbet til Total i valuta. Hvis afregningen er sket over en konto i anden valuta, er beløbet omregnet til valutakursen på afregningsdagen (Transaktionsliste).

ANSVARSFRASKRIVELSE

Denne afkastrapport bør ikke anvendes som bogføringsmateriale. Til dette formål bør fondsnotaer, kontoudtog og depotudtog benyttes.

Rapporten er baseret på informationer, som Jyske Bank finder pålidelige, men Jyske Bank påtager sig ikke ansvar for materialets rigtighed eller for dispositioner foretaget på baggrund af dettes informationer eller vurderinger.

Der kan være manglende eller fejlagtige beregninger, hvis depotet indeholder værdipapirer, hvor der indgår ikke afsluttede corporate actions.

Investering i finansielle instrumenter er behæftet med risiko og man kan risikere at miste hele eller en del af sin investering.

Historiske afkast og kursudvikling kan ikke anvendes som pålidelig indikator for fremtidige afkast og kursudvikling. Afkast og/eller kursudvikling kan blive negativ

Materialet er til personligt brug for Jyske Banks kunder og må ikke kopieres.