

Financiële Administratie

Stg Bewaarder OHV

30 juni 2017

KAS BANK N.V.

Financial Accounting
& Reporting



INHOUD

Balans & Winst- en Verliesrekening per mandaat:

Fresh Fixed Income Fund

Contact

KAS BANK N.V.
Financial Accounting & Reporting
Postbus 24001, 1000 DB Amsterdam
Nieuwezijds Voorburgwal 225, 1012 RL Amsterdam
The Netherlands
FAR@kasbank.com
www.kasbank.com

Rapport gecreëerd 30 oktober 2017 13:12:49

Balans

30-6-2017

	Debet	Credit
Beleggingen voor risico fonds		
Vastrentende waarden		
Obligaties		
003000 Bonds	64.205.462,29	
003005 Ongerealiseerd koersresultaat Bonds		239.388,02
003010 Asset Back Securities	1.448.205,55	
003015 Ongerealiseerd koersresultaat Asset Back Sec.	29.401,10	
003040 FRN	2.136.535,94	
003045 Ongerealiseerd koersresultaat FRN		12.732,73
Totaal Obligaties	67.567.484,13	
Obligatiebeleggingsfondsen		
003900 Fixed Income Fund	227.820,41	
003905 Ongerealiseerd koersresultaat Fixed Income Fund		3.130,97
Totaal Obligatiebeleggingsfondsen	224.689,44	
Totaal Vastrentende waarden	67.792.173,57	
Totaal Beleggingen voor risico fonds	67.792.173,57	
Immateriële vaste activa		
Immateriële vaste activa		
Oprichtingskosten		
006800 Oprichtingskosten	108.900,00	
006805 Cumulatieve afschrijving Oprichtingskosten		12.000,44
Totaal Oprichtingskosten	96.899,56	
Totaal Immateriële vaste activa	96.899,56	
Totaal Immateriële vaste activa	96.899,56	
Liquide middelen		
Liquide middelen		
Liquide middelen beschikbaar voor beleggingen		
100000 Beleggingsrekening EUR	1.993.663,32	
100200 Beleggingsrekening USD	58.759,92	
100300 Beleggingsrekening GBP	881,21	
100700 Beleggingsrekening NOK	13.214,36	
108000 Margin Account EUR	5.000,00	
Totaal Liquide middelen beschikbaar voor beleggingen	2.071.518,81	
Totaal Liquide middelen	2.071.518,81	
Totaal Liquide middelen	2.071.518,81	
Nog te ontvangen uit effectentransacties		
Verkopen		
Verkopen		
110000 Verkopen	19.253,87	
Totaal Verkopen	19.253,87	
Totaal Verkopen	19.253,87	
Totaal Nog te ontvangen uit effectentransacties	19.253,87	
Nog te ontvangen uit beleggingsopbrengsten		
Vastrentende waarden		
Obligaties		
120304 Opgelopen ABS Coupon	11.225,05	

Balans

30-6-2017

		Debet	Credit
120305	Opgelopen Bond Coupon	514.318,52	
120306	Opgelopen FRN Coupon	8.562,87	
120353	Bond coupon	37.646,17	
120354	ABS Coupon	22.021,91	
120356	FRN Coupon	1.727,15	
Totaal Obligaties		595.501,67	
Totaal Vastrentende waarden		595.501,67	
Overige beleggingen			
Variation margin			
120500	Variation margin future	65.213,74	
Totaal Variation margin		65.213,74	
Totaal Overige beleggingen		65.213,74	
Rekening Courant			
Rekening Courant			
120700	Nog te betalen/te vorderen rente Rekening Courant		943,38
Totaal Rekening Courant			943,38
Totaal Rekening Courant			943,38
Totaal Nog te ontvangen uit beleggingsopbrengsten		659.772,03	
Crediteuren			
Crediteuren			
Overige crediteuren			
149000	Terugkoop eigen aandelen		166.355,60
Totaal Overige crediteuren			166.355,60
Totaal Crediteuren			166.355,60
Totaal Crediteuren			166.355,60
Overige activa/passiva			
Overlopende activa/passiva			
Overlopende activa/passiva			
259600	Betalingen onderweg	100.000,00	
Totaal Overlopende activa/passiva		100.000,00	
Totaal Overlopende activa/passiva		100.000,00	
Totaal Overige activa/passiva		100.000,00	
Eigen vermogen			
Kapitaal			
Kapitaal			
008000	Participatiekapitaal		67.239.973,23
Totaal Kapitaal			67.239.973,23
Totaal Kapitaal			67.239.973,23
Reserves			
Wettelijke reserves			
008030	Wettelijke reserve		96.899,56
Totaal Wettelijke reserves			96.899,56
Overige reserves			
008031	Resultaat vorig boekjaar		1.025.285,98

Fresh Fixed Income Fund

EUR

Balans

30-6-2017

	Debet	Credit
008100 Reserve oprichtingskosten	96.899,56	
Totaal Overige reserves		928.386,42
Totaal Reserves		1.025.285,98
Totaal Eigen vermogen		68.265.259,21
Nog te betalen uit effectentransacties		
Aankopen		
Aankopen		
140000 Aankopen		1.525.957,29
Totaal Aankopen		1.525.957,29
Totaal Aankopen		1.525.957,29
Totaal Nog te betalen uit effectentransacties		1.525.957,29
Overlopende passiva		
Overlopende passiva		
Nog te betalen bedragen		
190040 Nog te betalen management fee		34.502,34
190054 Nog te betalen oprichtingskosten		103.968,77
Totaal Nog te betalen bedragen		138.471,11
Totaal Overlopende passiva		138.471,11
Totaal Overlopende passiva		138.471,11
Winstsaldo		643.574,63
Totaal Balans	70.739.617,84	70.739.617,84

Totaal Netto Vermogenswaarde

68.908.833,84

Winst- en Verliesrekening

Periode 1-1-2017 t/m 30-6-2017

	Debet	Credit
Kosten		
Kosten Bewaarder		
Kosten Bewaarder		
409100 Bewaarder in de zin van de Wft	807,85	
Totaal Kosten Bewaarder	807,85	
Totaal Kosten Bewaarder	807,85	
Performance en beheerkosten		
Performance en beheerkosten		
404000 Beheerskosten	143.955,20	
Totaal Performance en beheerkosten	143.955,20	
Totaal Performance en beheerkosten	143.955,20	
Provisie en bankkosten		
Provisie en bankkosten		
407000 Bankkosten	19.710,00	
407001 Bewaarloon	10.623,11	
407002 Provisie futures	13.973,16	
Totaal Provisie en bankkosten	44.306,27	
Totaal Provisie en bankkosten	44.306,27	
Afschrijvingskosten		
Afschrijvingskosten		
408100 Afschrijvingskosten oprichtingskosten	12.000,44	
Totaal Afschrijvingskosten	12.000,44	
Totaal Afschrijvingskosten	12.000,44	
Overige kosten		
Overige kosten		
409050 Overige kosten	31.004,48	
Totaal Overige kosten	31.004,48	
Totaal Overige kosten	31.004,48	
Totaal Kosten	232.074,24	
Directe beleggingsopbrengsten		
Opbrengst vastrentende waarden		
Opbrengst obligaties		
603000 Meegekochte rente bonds	501.628,56	
603001 Meeverkochte rente bonds		392.957,05
603002 Lopende rente bonds		266.428,15
603003 Opbrengst couponrente bonds		518.546,49
603010 Meegekochte rente ABS	18.304,33	
603012 Lopende rente ABS		6.012,17
603013 Opbrengst couponrente ABS gerealiseerd		59.292,78
603040 Meegekochte rente FRN	3.446,12	
603041 Meeverkochte rente FRN		449,20
603042 Lopende rente FRN		8.494,25
603043 Opbrengst couponrente FRN gerealiseerd		17.775,69
Totaal Opbrengst obligaties		746.576,77
Opbrengst obligatiebeleggingsfondsen		
603900 Opbrengst Fixed Income Fund		5.223,11
603920 Opbrengst High Yield Fund		3.989,00
Totaal Opbrengst obligatiebeleggingsfondsen		9.212,11

Winst- en Verliesrekening

Periode 1-1-2017 t/m 30-6-2017

	Debet	Credit
Totaal Opbrengst vastrentende waarden		755.788,88
Opbrengst overige beleggingen		
Opbrengst beleggingsfondsen		
602290 Opbrengst commodity fund		530,00
Totaal Opbrengst beleggingsfondsen		530,00
Totaal Opbrengst overige beleggingen		530,00
Opbrengst renten		
Opbrengst rekening courant		
607000 Ontvangen rente Rekening Courant		5.505,62
607050 Betaalde rente Rekening Courant	9.156,30	
Totaal Opbrengst rekening courant	3.650,68	
Totaal Opbrengst renten	3.650,68	
Overige opbrengsten		
Opbrengst toe en uittredeprovisie		
608300 Opbrengst toe- en uittredeprovisie		29.730,30
Totaal Opbrengst toe en uittredeprovisie		29.730,30
Totaal Overige opbrengsten		29.730,30
Totaal Directe beleggingsopbrengsten		782.398,50
Gerealiseerde koersresultaten		
Gerealiseerde koersresultaten vastrentende waarden		
Gerealiseerde koersresultaten obligaties		
703000 Gerealiseerde koersresultaten Bonds	21.503,44	
703001 Gerealiseerde valutaresultaten Bonds	27.020,22	
703010 Gerealiseerde koersresultaten Asset Back Sec.		27.826,92
703011 Gerealiseerde valutaresultaten Asset Back Sec.	493,94	
703040 Gerealiseerde koersresultaten FRN		9.621,53
Totaal Gerealiseerde koersresultaten obligaties	11.569,15	
Gerealiseerde koersresultaten obl. bel. fondsen		
703920 Gerealiseerde koersresultaten High Yield Fund		24.648,76
Totaal Gerealiseerde koersresultaten obl. bel. fondsen		24.648,76
Totaal Gerealiseerde koersresultaten vastrentende waarden		13.079,61
Gerealiseerde koersresultaten derivaten		
Gerealiseerde koersresultaten valutaderivaten		
704030 Gerealiseerde koersresultaten Currency future		230.556,87
Totaal Gerealiseerde koersresultaten valutaderivaten		230.556,87
Gerealiseerde koersresultaten rentederivaten		
704340 Gerealiseerde koersresultaten Bond Future		373.990,30
Totaal Gerealiseerde koersresultaten rentederivaten		373.990,30
Gerealiseerde koersresultaten commodityderivaten		
704500 Gerealiseerde koersresultaten Commodity Future		69,83
Totaal Gerealiseerde koersresultaten commodityderivaten		69,83
Totaal Gerealiseerde koersresultaten derivaten		604.617,00
Totaal Gerealiseerde koersresultaten		617.696,61
Ongerealiseerde koersresultaten		
Ongerealiseerde koersresultaten vastrent. waarden		

Winst- en Verliesrekening

Periode 1-1-2017 t/m 30-6-2017

	Debet	Credit
Ongerealiseerde koersresultaten obligaties		
803000 Ongerealiseerde koersresultaten Bonds	211.437,28	
803001 Ongerealiseerde valutaresultaten Bonds	253.629,91	
803010 Ongerealiseerde koersresultaten Asset Back Sec.		82.132,53
803011 Ongerealiseerde valutaresultaten Asset Back Sec.	77.527,12	
803040 Ongerealiseerde koersresultaten FRN		8.289,13
803041 Ongerealiseerde valutaresultaten FRN	33.867,93	
Totaal Ongerealiseerde koersresultaten obligaties	486.040,58	
Ongerealiseerde koersresultaten obl. bel. fondsen		
803900 Ongerealiseerde koersresultaten Fixed Income Fund	1.442,24	
803920 Ongerealiseerde koersresultaten High Yield Fund	22.445,32	
Totaal Ongerealiseerde koersresultaten obl. bel. fondsen	23.887,56	
Totaal Ongerealiseerde koersresultaten vastrent. waarden	509.928,14	
Ongerealiseerde koersresultaten rekening courant		
Ongerealiseerde koersresultaten rekening courant		
888000 Ongerealiseerde valuta resultaten Rekening Courant	13.744,07	
888030 Ongerealiseerde valuta resultaten openst. posten	775,30	
Totaal Ongerealiseerde koersresultaten rekening courant	14.519,37	
Totaal Ongerealiseerde koersresultaten rekening courant	14.519,37	
Totaal Ongerealiseerde koersresultaten	524.447,51	
Bijzondere baten en lasten		
Incidentele baten en lasten		
Incidentele baten en lasten lopend boekjaar		
900050 Rekenverschillen		1,27
Totaal Incidentele baten en lasten lopend boekjaar		1,27
Totaal Incidentele baten en lasten		1,27
Totaal Bijzondere baten en lasten		1,27
Winstsaldo	643.574,63	
Totaal Winst- en Verliesrekening	1.400.096,38	1.400.096,38

KAS BANK Amsterdam

P.O. Box 24001
1000 DB Amsterdam
The Netherlands

Nieuwezijds Voorburgwal 225
1012 RL Amsterdam
The Netherlands
T: +31 20 557 59 11

 **KAS BANK**
COMMITTED SINCE 1806