

Ocenění portfolia

dle data vypořádání obchodu k 31.01.2014

účet vlastníka: mCorpBond_UCB

pro klienta UniCredit Bank Czech Republic and Slovakia, a.s. - Veřejný standardní fond

se sídlem Želetavská 1525/1, Praha 4 - Michle

IČO/RČ:

64948242

Dluhopisy

Instrument ID Emitent	Instrument	Nominální hodnota / ks	Kurz v %	AÚV	Celkem CZK	Váha
AT0000492996 Atrium European Real Estate Ltd.	MEL2fe/15	16 000 000 8 CZK	98,00	131 266,67 CZK	15 811 266,67	2,92%
AT0000A14QE4 Erste Group Bank AG	ERSTBKfe/19	13 000 000 130 CZK	100,00	834,17 CZK	13 000 834,17	2,40%
CZ0000000260 Home Credit, a.s.	HCb6.25/16	15 000 000 5 CZK	107,50	567 708,33 CZK	16 692 708,33	3,09%
CZ0001500110 Hlavní město Praha	PRAHAb4.25/21	37 000 000 37 CZK	112,17	1 131 326,39 CZK	42 634 226,39	7,88%
CZ0003501462 Severomoravské vodovody a kanalizace	SMVAKb5/15	11 000 000 11 CZK	104,80	114 583,33 CZK	11 642 583,33	2,15%
CZ0003501736 CETELEM CR, a.s.	CETELEMf/14	12 000 000 6 CZK	100,22	38 456,67 CZK	12 064 856,67	2,23%
CZ0003501884 Český Aeroholding, a.s.	AEROHDb3.9/17	6 500 000 6 500 000 CZK	103,80	198 575,00 CZK	6 945 575,00	1,28%
CZ0003502155 Český Aeroholding, a.s.	AEROHDb2.7/14	5 000 000 5 000 000 CZK	101,25	41 250,00 CZK	5 103 750,00	0,94%
CZ0003510646 Czech Property Investments a. s.	CPIb6.05/16	11 000 000 1 100 CZK	100,00	223 681,94 CZK	11 223 681,94	2,08%
CZ0003510885 České dráhy, a.s.	CDf/18	8 000 000 2 CZK	99,88	2 893,33 CZK	7 992 893,33	1,48%
CZ0003511008 Český Aeroholding, a.s.	AEROHDb0/15	4 000 000 40 CZK	97,50	0,00 CZK	3 900 000,00	0,72%
XS0219645222 KBC IFIMA NV	KBCbe3.87/16	13 500 000 1 350 CZK	103,50	369 293,42 CZK	14 341 793,42	2,65%
XS0245704449 NIBC Bank NV	NIBCfe/16	15 000 000 3 CZK	93,90	28 045,83 CZK	14 113 045,83	2,61%
XS0259125945 SNS Bank Nederland NV	SNSbe4.05/14	13 000 000 13 CZK	101,35	295 705,48 CZK	13 471 205,48	2,49%
XS0305574682 Telefónica Emisiones SAU	TELEFObe4.623/14	8 000 000 4 CZK	101,75	228 996,82 CZK	8 368 996,82	1,55%
XS0490323580 General Electric Capital Corp	GE4fe/15	12 000 000 6 CZK	100,55	71 500,00 CZK	12 137 500,00	2,24%
XS0543083298 Citigroup Inc	Cfe3/15	14 000 000 7 CZK	101,55	21 404,44 CZK	14 238 404,44	2,63%
XS0622499787 ČEZ, a. s.	CEZbe4.6/23	10 000 000 2 CZK	113,70	344 054,79 CZK	11 714 054,79	2,17%
XS0761852556 Telefónica Emisiones SAU	TELEFObe3.934/17	5 000 000 1 CZK	106,90	165 443,56 CZK	5 510 443,56	1,02%
XS0766345481 RCI Banque SA	RENAULfe/15	12 000 000 6 CZK	101,50	19 416,67 CZK	12 199 416,67	2,26%
XS0860033769 ING Bank N.V., Amsterdam	ING5fe/14	7 500 000 150 CZK	100,07	9 056,25 CZK	7 514 306,25	1,39%
XS0860033843 ING Bank N.V., Amsterdam	ING6fe/17	8 000 000 160 CZK	100,70	16 940,00 CZK	8 072 940,00	1,49%
XS0877209188 BNP Paribas Arbitrage Issuance B.V.	BNPfe/18	8 000 000 8 CZK	100,40	906,67 CZK	8 032 906,67	1,49%
XS0880210702 Crédit Agricole CIB	CACIBfe/18	11 000 000 11 CZK	101,45	40 040,00 CZK	11 199 540,00	2,07%
XS0884604728 General Electric Capital Corp	GE6fe/18	4 000 000 2 CZK	99,40	8 603,33 CZK	3 984 603,33	0,74%
XS0885329614 LeasePlan Corporation N.V.	LPLNfe/18	14 000 000 7 CZK	101,65	57 855,00 CZK	14 288 855,00	2,64%
AT0000A0ZZD8 Slovenska Izvovzna Razvojna Banka, d.d.	SEDABlfe/16	500 000 5 EUR	99,31	6 042,37 EUR	13 821 359,06	2,56%

XS0197079972 Bank of America Merrill Lynch	BAC3fe/14	300 000 300	EUR	100,11	56,40 EUR	8 260 543,50	1,53%
XS0211034466 Goldman Sachs Group Inc	GSfe/15	300 000 300	EUR	100,06	-11,33 EUR	8 254 225,83	1,53%
XS0214084252 OTP Bank Rt.	OTPfe/15	450 000 9	EUR	97,25	569,85 EUR	12 050 049,00	2,23%
XS0260783005 Erste Group Bank AG	ERSTBKfe/17	300 000 6	EUR	98,09	110,00 EUR	8 095 862,50	1,50%
XS0503453275 MOL Hungarian Oil and Gas Company	MOLHBbe5.875/17	300 000 300	EUR	107,15	13 810,27 EUR	9 219 451,28	1,70%
XS0626282783 BOS Finance AB	BOSPWbe6/16	400 000 400	EUR	109,49	17 424,66 EUR	12 522 913,08	2,32%
XS0877986231 New World Resources Plc	NWRbe7.875/21	450 000 450	EUR	17,49	1 476,56 EUR	2 205 364,22	0,41%
XS0979598207 Západoslovenská energetika, a.s.	ZSEbe2.875/18	300 000 300	EUR	102,50	2 575,68 EUR	8 527 081,34	1,58%
XS1019818787 Powszechna Kasa Oszczednosci Bank P	PKOBPbe2.324/19	600 000 600	EUR	100,46	305,62 EUR	16 583 727,10	3,07%
TRSCFAK11513 C Faktoring AS	CFKTRGf/15	500 000 5 000	TRY	99,90	1 587,33 TRY	4 484 230,51	0,83%
TRSCKB11511 Bank Pozitif Ve Kalkinma Ban	BNKPOZb10.4/15	700 000 700	TRY	99,83	5 784,11 TRY	6 305 099,47	1,17%
TRSCRSIA1516 Boyner Büyük Magazacilik A.S.	BOYNRf/15	900 000 900	TRY	100,70	2 558,47 TRY	8 133 374,41	1,50%
TRSDEVA61615 Deva Holding A.S.	DEVAf/16	200 000 200	TRY	99,20	1 301,92 TRY	1 787 132,46	0,33%
TRSERGL31517 Eregli Demir ve Çelik Fabrikalari T.A.S.	EREGLTf/15	600 000 6 000	TRY	100,05	24 969,90 TRY	5 595 540,36	1,03%
TRSMCBF71511 Mercedes-Benz Finansman Turk A.S.	DAIGRb10.03/15	800 000 800 000	TRY	96,20	3 077,70 TRY	6 914 692,73	1,28%
TRSPKPB61517 Pakpen Plastik Boru ve Yapi	PAKPENf/15	450 000 450 000	TRY	98,90	9 281,59 TRY	4 065 813,39	0,75%
TRSRNSHA1514 Rönesans Holding A.S.	RONHOLf/15	700 000 700	TRY	98,45	2 533,62 TRY	6 189 876,68	1,14%
TRSTPFCK1419 Creditwest Faktoring Hizmetleri A.S.	CRDFAfe/14	700 000 700	TRY	100,10	1 582,77 TRY	6 284 728,48	1,16%
XS0546767863 Yasar Holding A.S. (via Willow No.2 PLC	YASARbe9.625/15	750 000 750	USD	98,06	22 658,85 USD	15 424 711,64	2,85%
XS0853036860 Hrvatska Elektroprivreda	HEPbe6/17	500 000 500	USD	102,53	6 750,00 USD	10 567 458,07	1,95%
XS0994815016 Yapi ve Kredi Bankasi	YAPIbe5.25/18	700 000 700	USD	95,39	5 818,75 USD	13 703 453,18	2,53%
Celkem za dluhopisy						495 197 076,41	91,55%

Závazky a pohledávky vyplývající z investičních operací

Instrument ID Emitent	Instrument	Splatnost	Nominální hodnota	Dis. sazba	Celkem CZK	Váha
CZ0000000211 ECM Real Estate Investments AG	ECMf/12 - Pohledávka	31.12.2014	3 900 000,00 CZK	0,00%	3 900 000,00	0,72%
CZ0001500110 Hlavní město Praha	PRAHAb4.25/21 - Prodej	28.02.2014	25 773 427,27 CZK	0,27%	-3 038 818,60	-0,56%
TRSTISB21511 Türkiye Is Bankasi A.S.	ISBANK0 02/15 - Nákup	04.02.2014	537 504,00 TRY	0,50%	5 603,80	0,00%
XS0211034466 Goldman Sachs Group Inc	GSfe/15 - výplata úroku	03.02.2014	515,67 EUR	0,21%	14 180,67	0,00%
AT0000743059 OMV AG	OMV - Daňová pohledávka	31.12.2014	379,50 EUR	0,00%	10 436,25	0,00%
AT0000908504 Vienna Insurance Group	VIG - Daňová pohledávka	31.12.2014	330,00 EUR	0,00%	9 075,00	0,00%
GB00B42CTW68 New World Resources Plc	NWR_plc - Daňová pohledávka	31.12.2014	68,25 EUR	0,00%	1 876,88	0,00%
	FX operace	21.02.2014	600 000,00 EUR	0,21%	-16 497 938,10	-3,05%
	FX operace	21.02.2014	4 328 000,00 EUR	0,21%	-119 005 126,84	-22,00%
	FX operace	21.02.2014	1 825 000,00 TRY	0,66%	-16 230 968,63	-3,00%
	CZK - Depozitum	05.02.2014	40 000 000,00 CZK	0,03%	40 000 066,67	7,40%
	FX operace	21.02.2014	16 501 020,00 CZK	0,22%	16 498 920,68	3,05%
	FX operace	21.02.2014	118 537 428,00 CZK	0,22%	118 522 347,27	21,91%
	FX operace	21.02.2014	16 679 222,50 CZK	0,22%	16 677 100,51	3,08%
Celkem za závazky a pohledávky					40 866 755,56	7,56%

Peněžní zůstatky

Měna	Zůstatek	Hodnota
CZK	4 019 572,74	4 019 572,74 CZK
USD	705,43	14 352,68 CZK
EUR	1 937,61	53 284,27 CZK
PLN	133,48	863,75 CZK
TRY	81 279,36	727 368,99 CZK
Zůstatky celkem		4 815 442,44 CZK

Použité měnové kurzy

Měnový kurz	Kurz
CZK/EUR	27,5000
CZK/PLN	6,4710
CZK/TRY	8,9490
CZK/USD	20,3460

Souhrn

Typ Instrumentu	Tržní hodnota CZK	Váha
Dluhopisy CZK	306 200 388,11	56,61%
Dluhopisy EUR	99 540 576,92	18,40%
Dluhopisy TRY	49 760 488,49	9,20%
Dluhopisy USD	39 695 622,89	7,34%
Závazky a pohledávky	40 866 755,56	7,56%
Peněžní zůstatky	4 815 442,44	0,89%
Celková hodnota	540 879 274,41	100,00%