

Ocenění portfolia

dle data vypořádání obchodu k 30.08.2013

účet vlastníka: mCorpBond_UCB

pro klienta UniCredit Bank Czech Republic, 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	12 000 000 6 CZK	96,00	6 563,33 CZK	11 526 563,33	2,39%
AT000B004973 Erste Group Bank AG	ERSTBKfe/13	18 000 000 9 CZK	100,02	111 350,00 CZK	18 114 050,00	3,76%
CZ0000000260 Home Credit, a.s.	HCb6.25/16	9 000 000 3 CZK	105,00	106 250,00 CZK	9 556 250,00	1,98%
CZ0001002471 Česká republika	CZgb5.00/19	5 000 000 500 CZK	117,96	96 527,78 CZK	5 994 527,78	1,24%
CZ0001500110 Hlavní město Praha	PRAHAb4.25/21	12 000 000 12 CZK	107,82	154 416,67 CZK	13 092 816,67	2,72%
CZ0003501058 ČEZ, a. s.	CEZ1f/14	17 000 000 17 CZK	102,45	673 200,00 CZK	18 089 700,00	3,75%
CZ0003501462 Severomoravské vodovody a kanalizace	SMVAKb5/15	11 000 000 11 CZK	104,20	435 416,67 CZK	11 897 416,67	2,47%
CZ0003501736 CETELEM CR, a.s.	CETELEMf/14	12 000 000 6 CZK	100,40	53 863,33 CZK	12 101 863,33	2,51%
CZ0003501884 Český Aeroholding, a.s.	AEROHDb3.9/17	6 500 000 6 500 000 CZK	102,40	92 950,00 CZK	6 748 950,00	1,40%
CZ0003502155 Český Aeroholding, a.s.	AEROHDb2.7/14	5 000 000 5 000 000 CZK	101,50	120 000,00 CZK	5 195 000,00	1,08%
CZ0003510646 Czech Property Investments a. s.	CPIb6.05/16	11 000 000 1 100 CZK	100,00	-53 609,72 CZK	10 946 390,28	2,27%
CZ0003510885 České dráhy, a.s.	CDf/18	8 000 000 2 CZK	99,74	18 320,00 CZK	7 997 920,00	1,66%
XS0219645222 KBC IFIMA NV	KBCbe3.87/16	13 500 000 1 350 CZK	102,00	148 862,47 CZK	13 918 862,47	2,89%
XS0245704449 NIBC Bank NV	NIBCfe/16	15 000 000 3 CZK	89,51	47 250,00 CZK	13 473 750,00	2,80%
XS0259125945 SNS Bank Nederland NV	SNSbe4.05/14	13 000 000 13 CZK	101,75	73 565,75 CZK	13 301 065,75	2,76%
XS0305574682 Telefónica Emisiones SAU	TELEFObe4.623/14	8 000 000 4 CZK	102,80	72 954,74 CZK	8 296 954,74	1,72%
XS0490323580 General Electric Capital Corp	GE4fe/15	12 000 000 6 CZK	100,80	87 710,00 CZK	12 183 710,00	2,53%
XS0543083298 Citigroup Inc	Cfe3/15	14 000 000 7 CZK	101,70	44 345,00 CZK	14 282 345,00	2,96%
XS0622499787 ČEZ, a. s.	CEZbe4.6/23	10 000 000 2 CZK	114,50	149 972,60 CZK	11 599 972,60	2,41%
XS0638306406 UniCredit S.p.A.	UCGIMfe4/13	15 000 000 12 CZK	100,10	40 391,67 CZK	15 055 391,67	3,12%
XS0761852556 Telefónica Emisiones SAU	TELEFObe3.934/17	5 000 000 1 CZK	103,60	82 452,33 CZK	5 262 452,33	1,09%
XS0766345481 RCI Banque SA	RENAULfe/15	12 000 000 6 CZK	101,45	42 576,67 CZK	12 216 576,67	2,54%
XS0860033769 ING Bank N.V., Amsterdam	ING5fe/14	7 500 000 150 CZK	100,10	0,00 CZK	7 507 500,00	1,56%
XS0860033843 ING Bank N.V., Amsterdam	ING6fe/17	3 000 000 60 CZK	100,50	0,00 CZK	3 015 000,00	0,63%
XS0877209188 BNP Paribas Arbitrage Issuance B.V.	BNPfe/18	8 000 000 8 CZK	100,20	8 880,00 CZK	8 024 880,00	1,67%
XS0880210702 Crédit Agricole CIB	CACIBfe/18	11 000 000 11 CZK	101,75	12 937,22 CZK	11 205 437,22	2,33%
XS0885329614 LeasePlan Corporation N.V.	LPLNfe/18	14 000 000 7 CZK	100,00	16 819,44 CZK	14 016 819,44	2,91%

AT0000A0ZZD8 Slovenska Izvovzna Razvojna Banka, d.d	SEDABlfe/16	300 000 3	EUR	97,70	4 568,62 EUR	7 660 888,09	1,59%
XS0197079972 Merrill Lynch & Co Inc	BAC3fe/14	300 000 300	EUR	100,10	217,75 EUR	7 733 862,90	1,60%
XS0211034466 Goldman Sachs Group Inc	GSfe/15	300 000 300	EUR	99,97	158,20 EUR	7 722 062,11	1,60%
XS0214084252 OTP Bank Rt.	OTPfe/15	400 000 8	EUR	92,79	725,00 EUR	9 570 666,36	1,99%
XS0260783005 Erste Group Bank AG	ERSTBKfe/17	300 000 6	EUR	94,97	392,00 EUR	7 342 285,57	1,52%
XS0503453275 MOL Hungarian Oil and Gas Company	MOLHBbe5.875/17	300 000 300	EUR	105,82	6 373,97 EUR	8 333 674,27	1,73%
XS0626282783 BOS Finance AB	BOSPWbe6/16	250 000 250	EUR	109,50	4 561,64 EUR	7 162 028,47	1,49%
XS0731129747 Eileme 2 AB	POLKOMbe11.75/20	300 000 300	EUR	117,39	2 937,50 EUR	9 138 575,71	1,90%
XS0877986231 New World Resources Plc	NWRbe7.875/21	250 000 250	EUR	40,98	2 460,94 EUR	2 699 722,13	0,56%
TRSCFAK11513 C Faktoring AS	CFKTRGf/15	500 000 5 000	TRY	99,75	5 980,82 TRY	4 834 816,54	1,00%
TRSCRSIA1516 Boyner Büyük Magazacilik A.S.	BOYNRF/15	900 000 900	TRY	100,90	5 778,74 TRY	8 754 044,45	1,82%
TRSEVA61615 Deva Holding A.S.	DEVAf/16	200 000 200	TRY	99,90	1 608,22 TRY	1 929 289,33	0,40%
TRSERGL31517 Eregli Demir ve Çelik Fabrikalari T.A.S.	EREGLTf/15	600 000 6 000	TRY	98,65	19 871,15 TRY	5 860 155,87	1,22%
TRSMCBF71511 Mercedes-Benz Finansman Turk A.S.	DAIGRb10.03/15	800 000 800 000	TRY	99,45	8 573,59 TRY	7 703 178,81	1,60%
TRSPKPB61517 Pakpen Plastik Boru ve Yapı	PAKPENf/15	450 000 450 000	TRY	99,75	10 082,47 TRY	4 396 353,56	0,91%
TRSRNSHA1514 Rönesans Holding A.S.	RONHOLf/15	700 000 700	TRY	100,05	1 682,88 TRY	6 724 772,93	1,40%
TRSTISB51427 Türkiye İS Bankasi A.S.	ISBANK0 05/14	600 000 600 000	TRY	93,55	0,00 TRY	5 376 692,70	1,12%
TRSTPFCK1419 Creditwest Faktoring Hizmetleri A.S.	CRDFAfe/14	700 000 700	TRY	99,95	950,47 TRY	6 711 051,86	1,39%
XS0546767863 Yasar Holding A.S. (via Willow No.2 PLC	YASARbe9.625/15	450 000 450	USD	99,99	17 204,69 USD	9 083 832,62	1,89%
Celkem za dluhopisy						423 360 120,22	87,86%

Závazky a pohledávky vyplývající z investičních operací

Instrument ID Emitent	Instrument	Splatnost	Nominální hodnota	Dis. sazba	Celkem CZK	Váha
CZ0003510646 Czech Property Investments a. s.	CPIb6.05/16 - výplata úroku	30.09.2013	332 750,00 CZK	0,30%	332 663,49	0,07%
CZ0000000211 ECM Real Estate Investments AG	ECMf/12 - Pohledávka	31.12.2013	3 900 000,00 CZK	0,00%	3 900 000,00	0,81%
AT0000743059 OMV AG	OMV - Daňová pohledávka	31.12.2013	379,50 EUR	0,00%	9 766,43	0,00%
AT0000908504 Vienna Insurance Group	VIG - Daňová pohledávka	31.12.2013	330,00 EUR	0,00%	8 492,55	0,00%
GB00B42CTW68 New World Resources Plc	NWR_plc - Daňová pohledávka	31.12.2013	68,25 EUR	0,00%	1 756,41	0,00%
NL0006282204 New World Resources NV	NWR - Daňová pohledávka	31.12.2013	280,50 EUR	0,00%	7 218,67	0,00%
	FX operace	07.10.2013	32 000,00 EUR	0,14%	-823 397,22	-0,17%
	FX operace	07.10.2013	4 980 000,00 EUR	0,14%	-128 141 192,25	-26,59%
	CZK - Depozitum	03.09.2013	25 000 000,00 CZK	0,04%	25 000 083,33	5,19%
	FX operace	07.10.2013	821 843,20 CZK	0,32%	821 569,16	0,17%
	FX operace	07.10.2013	128 471 550,00 CZK	0,32%	128 428 711,89	26,65%
Celkem za závazky a pohledávky					29 545 672,47	6,13%

Peněžní zůstatky

Měna	Zůstatek	Hodnota
CZK	27 736 150,94	27 736 150,94 CZK
USD	242,17	4 709,00 CZK
EUR	5 133,82	132 118,86 CZK
PLN	77,30	466,81 CZK
TRY	113 315,59	1 085 450,04 CZK
Zůstatky celkem		28 958 895,64 CZK

Použité měnové kursy

Měnový kurz	Kurz
CZK/EUR	25,7350
CZK/PLN	6,0390
CZK/TRY	9,5790
CZK/USD	19,4450

Souhrn

Typ Instrumentu	Tržní hodnota CZK	Váha
Dluhopisy CZK	294 622 165,95	61,14%
Dluhopisy EUR	67 363 765,61	13,98%
Dluhopisy TRY	52 290 356,05	10,85%
Dluhopisy USD	9 083 832,62	1,89%
Závazky a pohledávky	29 545 672,47	6,13%
Peněžní zůstatky	28 958 895,64	6,01%
Celková hodnota	481 864 688,34	100,00%