

Ocenění portfolia

dle data uzavření obchodu k 31.08.2010
pro klienta CONSEQ INVEST Fond dluhopisů nové Evropy

Dluhopisy

Instrument ID Emitent	Instrument	Nominální hodnota / ks	Kurz v %	AÚV	Celkem CZK	Váha
AT0000492996 Atrium European Real Estate Ltd.	MEL2fe/15	18 000 000 CZK 9	77,25	0,00 CZK	13 905 000,00	3,14%
CZ0000000211 ECM Real Estate Investments AG	ECMf/12	10 000 000 CZK 10	30,00	-38 166,67 CZK	2 961 833,33	0,67%
CZ0001002471 Česká republika	CZgb5.00/19	5 000 000 CZK 500	113,98	96 527,78 CZK	5 795 352,78	1,31%
XS0214084252 OTP Bank Rt.	OTPfe/15	550 000 EUR 11	78,00	1 685,93 EUR	10 665 191,83	2,41%
XS0231264275 MOL Magyar Olaj Rt.	MOLHBbe3.875/15	350 000 EUR 350	90,29	12 261,99 EUR	8 129 462,82	1,83%
XS0449738987 Croatian Bank for Reconstruction & Devel	CBRDbe7.25/12	200 000 EUR 200	104,83	14 380,82 EUR	5 547 978,30	1,25%
XS0504814509 New World Resources N.V.	NWRbe7.875/18	150 000 EUR 150	101,79	4 068,75 EUR	3 881 661,06	0,88%
HU0000402318 Maďarsko	HUgb5.5-02/16	285 000 000 HUF 28 500	91,76	8 589 041,10 HUF	23 281 125,99	5,25%
HU0000402383 Maďarsko	HUgb6-11/23	120 000 000 HUF 12 000	87,77	5 523 287,67 HUF	9 554 244,75	2,16%
HU0000402433 Maďarsko	HUgb6.5-06/19	215 500 000 HUF 21 550	93,62	2 609 616,44 HUF	17 614 713,24	3,98%
XS0305275694 NIBC Bank NV	NIBCfe/12	100 000 000 HUF 4	98,25	1 820 000,00 HUF	8 625 319,50	1,95%
PL0000101937 Polsko	PLgb6-11/10	3 580 000 PLN 3 580	100,61	164 787,40 PLN	23 319 260,83	5,26%
PL0000102836 Polsko	PLgb5-10/13	2 864 000 PLN 2 864	100,31	122 006,40 PLN	18 541 929,71	4,19%
PL0000104287 Polsko	PLgb4.25-05/11	1 800 000 PLN 1 800	100,26	20 754,00 PLN	11 301 413,55	2,55%
PL0000104543 Polsko	PLgb5.25-10/17	5 900 000 PLN 5 900	99,70	263 081,00 PLN	38 045 823,88	8,59%
PL0000105441 Polsko	PLgb5.5-10/19	15 055 000 PLN 15 055	100,69	703 219,05 PLN	98 206 329,80	22,17%
RO0914DBN049 Rumunsko	ROMGB11/14	4 000 000 RON 400	110,75	215 780,82 RON	27 117 072,44	6,12%
TRSAKFH31213 AKFEN HOLDING A.S.	AKFENfe/12	340 305 TRY 340 305	100,85	18 737,86 TRY	4 630 620,12	1,05%
TRSTPFC61210 Creditwest Faktoring Hizmetleri A.S.	CRDFAfe/12	350 000 TRY 350 000	100,80	9 366,58 TRY	4 633 577,12	1,05%
TRT010420T19 Turecko	TURKGB4 04/20	500 000 TRY 5 000	99,13	8 306,01 TRY	6 447 849,30	1,46%
TRT020211T11 Turecko	TURKGB0 02/11	900 000 TRY 9 000	96,95	0,00 TRY	11 163 114,05	2,52%
TRT070312T14 Turecko	TURKGB16 03/12	600 000 TRY 6 000	111,26	46 173,91 TRY	9 131 769,69	2,06%
TRT110215T16 Turecko	TURKGB4.5 02/15	1 250 000 TRY 1 250 000	107,20	3 057,07 TRY	17 182 371,05	3,88%
TRT190111T13 Turecko	TURKGB14 01/11	750 000 TRY 7 500	102,49	12 269,02 TRY	9 990 956,76	2,26%
TRT290415T14 Turecko	TURKGB4 04/15	1 000 000 TRY 10 000	100,88	12 992,67 TRY	13 072 866,09	2,95%
XS0371442822 Home Credit&Finance Bank LLC	HCFBbe11/11	500 000 USD 500	104,36	10 694,44 USD	10 375 398,57	2,34%
Celkem za dluhopisy					413 122 236,55	93,24%

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 - výplata úroku	30.09.2010	234 088,89 CZK	0,86%	233 921,25	0,05%
XS0213064289 Landsbanki Islands HF	LANISLfe/10 - Pohledávka	31.12.2010	760 000,00 CZK	0,00%	760 000,00	0,17%
	CZK - Záloha na poplatky	31.08.2010	-1 417 192,43 CZK	0,00%	-1 472 336,62	-0,33%
	CZK - Pohledávka	31.08.2010	34 716,08 CZK	0,00%	34 716,08	0,01%
	CZK - Pohledávka	31.08.2010	443 181,58 CZK	0,00%	443 181,58	0,10%
	FX operace	31.08.2010	-164 287,81 CZK	0,00%	-164 287,81	-0,04%
	FX operace	13.09.2010	275 000,00 USD	0,86%	-5 356 453,70	-1,21%
	FX operace	13.09.2010	10 010 000,00 EUR	0,86%	-247 803 370,78	-55,93%
	FX operace	13.09.2010	248 366 118,00 CZK	0,86%	248 289 010,47	56,04%
	FX operace	13.09.2010	5 279 175,00 CZK	0,86%	5 277 536,03	1,19%
Celkem za závazky a pohledávky					241 916,50	0,05%

Peněžní zůstatky

Měna	Zůstatek	Hodnota
CZK	27 849 731,23	27 849 731,23 CZK
USD	17 001,22	331 252,83 CZK
EUR	1 971,47	48 820,04 CZK
PLN	52 328,35	323 965,97 CZK
HUF	45 661,05	3 935,66 CZK
TRY	88 112,91	1 127 320,94 CZK
RON	315,78	1 843,21 CZK
Zůstatky celkem		29 686 869,88 CZK

Použité měnové kursy

Měnový kurz	Kurz
CZK/EUR	24,8500
CZK/HUF	0,0864
CZK/PLN	6,1900
CZK/RON	5,8370
CZK/TRY	12,8240
CZK/USD	19,5950

Souhrn

Typ Instrumentu	Tržní hodnota CZK	Váha
Dluhopisy PLN	189 414 757,77	42,75%
Dluhopisy TRY	76 253 124,18	17,21%
Dluhopisy HUF	59 075 403,48	13,33%
Dluhopisy EUR	28 224 294,01	6,37%
Dluhopisy RON	27 117 072,44	6,12%
Dluhopisy CZK	22 662 186,11	5,12%
Dluhopisy USD	10 375 398,57	2,34%
Závazky a pohledávky	241 916,50	0,05%
Peněžní zůstatky	29 686 869,88	6,70%
Celková hodnota	443 051 022,93	100,00%