

Ocenění portfolia

dle data uzavření obchodu k 30.09.2010
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	84,00	0,00 CZK	15 120 000,00	3,38%
CZ0000000211 ECM Real Estate Investments AG	ECMf/12	10 000 000 CZK 10	30,00	0,00 CZK	3 000 000,00	0,67%
CZ0001002471 Česká republika	CZgb5.00/19	5 000 000 CZK 500	113,15	117 361,11 CZK	5 774 836,11	1,29%
CZ0003501462 Severomoravské vodovody a kanalizace	SMVAKb5/15	5 000 000 CZK 5	105,85	218 750,00 CZK	5 511 250,00	1,23%
XS0214084252 OTP Bank Rt.	OTPfe/15	550 000 EUR 11	78,00	525,80 EUR	10 552 441,37	2,36%
XS0231264275 MOL Magyar Olaj Rt.	MOLHBbe3.875/15	350 000 EUR 350	91,16	13 376,71 EUR	8 166 872,08	1,82%
XS0307199215 Hungarian Development Bank Ltd.	MAGYARbe4.875/12	350 000 EUR 7	99,53	4 721,40 EUR	8 674 645,98	1,94%
XS0449738987 Croatian Bank for Reconstruction & Deve	CBRDbe7.25/12	200 000 EUR 200	105,60	1 072,60 EUR	5 214 872,86	1,16%
XS0504814509 New World Resources N.V.	NWRbe7.875/18	150 000 EUR 150	103,79	4 889,06 EUR	3 945 012,82	0,88%
XS0541470075 Republika Černá Hora	MONTENbe7.875/15	100 000 EUR 100	103,11	345,21 EUR	2 541 573,11	0,57%
HU0000402318 Maďarsko	HUgb5.5-02/16	285 000 000 HUF 28 500	95,35	9 877 397,26 HUF	25 019 559,84	5,59%
HU0000402383 Maďarsko	HUgb6-11/23	120 000 000 HUF 12 000	94,03	6 115 068,49 HUF	10 567 786,69	2,36%
HU0000402433 Maďarsko	HUgb6.5-06/19	215 500 000 HUF 21 550	98,34	3 760 917,81 HUF	19 161 825,36	4,28%
XS0305275694 NIBC Bank NV	NIBCfe/12	100 000 000 HUF 4	98,25	2 567 945,21 HUF	8 957 075,57	2,00%
PL0000101937 Polsko	PLgb6-11/10	3 580 000 PLN 3 580	100,39	182 436,80 PLN	23 338 478,15	5,21%
PL0000102836 Polsko	PLgb5-10/13	2 864 000 PLN 2 864	100,39	133 777,44 PLN	18 596 174,79	4,15%
PL0000104287 Polsko	PLgb4.25-05/11	1 800 000 PLN 1 800	100,21	27 036,00 PLN	11 315 421,03	2,53%
PL0000104543 Polsko	PLgb5.25-10/17	5 900 000 PLN 5 900	99,80	288 510,00 PLN	38 173 147,96	8,52%
PL0000105441 Polsko	PLgb5.5-10/19	15 055 000 PLN 15 055	100,59	771 267,65 PLN	98 358 079,93	21,96%
RO0914DBN049 Rumunsko	ROMGB11/14	4 000 000 RON 400	110,51	251 945,21 RO	26 916 689,41	6,01%
TRSMRNH61214	MERINOfe/12	340 000 TRY 340 000	100,80	991,98 TRY	4 276 206,57	0,95%
TRSTPFC61210 Creditwest Faktoring Hizmetleri A.S.	CRDFAfe/12	500 000 TRY 500 000	100,80	17 942,47 TRY	6 493 616,59	1,45%
TRT010420T19 Turecko	TURKGB4 04/20	500 000 TRY 5 000	103,82	9 945,36 TRY	6 581 780,13	1,47%
TRT020211T11 Turecko	TURKGB0 02/11	900 000 TRY 9 000	97,57	0,00 TRY	10 925 482,56	2,44%
TRT070312T14 Turecko	TURKGB16 03/12	600 000 TRY 6 000	110,86	6 099,45 TRY	8 351 119,84	1,86%
TRT110215T16 Turecko	TURKGB4.5 02/15	1 250 000 TRY 1 250 000	111,10	7 642,66 TRY	17 372 481,14	3,88%
TRT190111T13 Turecko	TURKGB14 01/11	750 000 TRY 7 500	101,97	20 828,80 TRY	9 773 613,24	2,18%

TRT290415T14 Turecko	TURKGB4 04/15	1 000 000 TRY 10 000	104,22	16 830,60 TRY	13 175 664,24	2,94%
XS0371442822 Home Credit&Finance Bank LLC	HCFBbe11/11	500 000 USD 500	105,00	15 277,78 USD	9 722 647,43	2,17%
Celkem za dluhopisy					435 578 354,81	97,24%

Závazky a pohledávky vyplývající z investičních operací

Instrument ID Emitent	Instrument	Splatnost	Nominální hodnota	Dis. sazba	Celkem CZK	Váha
XS0213064289 Landsbanki Islands HF	LANISLfe/10 - Pohledávka	03.10.2010	760 000,00 CZK	0,00%	760 000,00	0,17%
	CZK - Záloha na poplatky	30.09.2010	-1 918 077,49 CZK	0,00%	-1 885 329,60	-0,42%
	CZK - Pohledávka	30.09.2010	26 854,57 CZK	0,00%	26 854,57	0,01%
	CZK - Pohledávka	30.09.2010	113 313,84 CZK	0,00%	113 313,84	0,03%
	FX operace	30.09.2010	-198 447,26 CZK	0,00%	-198 447,26	-0,04%
	FX operace	29.10.2010	10 110 000,00 EUR	0,87%	-248 205 034,71	-55,41%
	FX operace	29.10.2010	335 000,00 EUR	0,87%	-8 224 400,26	-1,84%
	FX operace	29.10.2010	249 787 770,00 CZK	0,87%	249 612 833,01	55,72%
	FX operace	29.10.2010	8 276 845,00 CZK	0,87%	8 271 048,37	1,85%
Celkem za závazky a pohledávky					270 837,96	0,06%

Peněžní zůstatky

Měna	Zůstatek	Hodnota
CZK	11 567 949,98	11 567 949,98 CZK
USD	13 165,12	236 914,83 CZK
EUR	-1 819,61	-44 703,55 CZK
PLN	52 328,35	323 407,62 CZK
HUF	45 661,05	4 056,71 CZK
TRY	1 446,33	17 994,15 CZK
RON	315,78	1 819,21 CZK
Zůstatky celkem		12 107 438,96 CZK

Použité měnové kurzy

Měnový kurz	Kurz
CZK/EUR	24,6100
CZK/HUF	0,0893
CZK/PLN	6,1760
CZK/RON	5,7610
CZK/TRY	12,4210
CZK/USD	18,0250

Souhrn

Typ Instrumentu	Tržní hodnota CZK	Váha
Dluhopisy PLN	189 781 301,85	42,37%
Dluhopisy TRY	76 949 964,32	17,18%
Dluhopisy HUF	63 706 247,47	14,22%
Dluhopisy EUR	39 095 418,22	8,73%
Dluhopisy CZK	29 406 086,11	6,56%
Dluhopisy RON	26 916 689,41	6,01%
Dluhopisy USD	9 722 647,43	2,17%
Závazky a pohledávky	270 837,96	0,06%
Peněžní zůstatky	12 107 438,96	2,70%
Celková hodnota	447 956 631,72	100,00%