

Ocenění portfolia

dle data uzavření obchodu k 29.10.2010
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	83,00	97 920,00 CZK	15 037 920,00	3,55%
CZ0000000211 ECM Real Estate Investments AG	ECMf/12	10 000 000 CZK 10	20,00	35 766,67 CZK	2 035 766,67	0,48%
CZ0001002471 Česká republika	CZgb5.00/19	5 000 000 CZK 500	110,91	137 500,00 CZK	5 682 775,00	1,34%
CZ0003501462 Severomoravské vodovody a kanalizace	SMVAKb5/15	5 000 000 CZK 5	105,25	-11 111,11 CZK	5 251 388,89	1,24%
XS0214084252 OTP Bank Rt.	OTPfe/15	550 000 EUR 11	79,50	1 161,14 EUR	10 805 380,26	2,55%
XS0231264275 MOL Magyar Olaj Rt.	MOLHBbe3.875/15	350 000 EUR 350	92,48	891,78 EUR	7 999 747,06	1,89%
XS0504814509 New World Resources N.V.	NWRbe7.875/18	150 000 EUR 150	104,00	5 840,62 EUR	3 988 993,49	0,94%
XS0541470075 Republika Černá Hora	MONTENbe7.875/15	100 000 EUR 100	104,05	970,89 EUR	2 588 510,21	0,61%
HU0000402318 Maďarsko	HUgb5.5-02/16	285 000 000 HUF 28 500	94,17	11 122 808,22 HUF	25 378 272,96	5,98%
HU0000402433 Maďarsko	HUgb6.5-06/19	215 500 000 HUF 21 550	96,86	4 873 842,47 HUF	19 394 769,38	4,57%
XS0305275694 NIBC Bank NV	NIBCfe/12	100 000 000 HUF 4	99,00	3 290 958,90 HUF	9 287 561,83	2,19%
PL0000102646 Polsko	PLgb5.75-09/22	3 250 000 PLN 3 250	100,48	18 427,50 PLN	20 402 859,18	4,81%
PL0000104287 Polsko	PLgb4.25-05/11	1 800 000 PLN 1 800	100,21	33 120,00 PLN	11 411 982,08	2,69%
PL0000104543 Polsko	PLgb5.25-10/17	5 900 000 PLN 5 900	98,93	3 422,00 PLN	36 283 601,73	8,55%
PL0000105441 Polsko	PLgb5.5-10/19	16 165 000 PLN 16 165	99,15	9 699,00 PLN	99 634 867,21	23,49%
PL0000106324 Polsko	PLgb0-01/13	7 680 000 PLN 7 680	90,11	0,00 PLN	42 992 870,79	10,14%
RO0914DBN049 Rumunsko	ROMGB11/14	4 000 000 RON 400	110,83	286 904,11 RON	27 261 572,06	6,43%
TRSCCKBE1316 Bank Pozitif Ve Kalkinma Ban	BNKPOZb10.08/13	400 000 TRY 400 000	101,00	2 982,58 TRY	5 039 379,55	1,19%
TRSMRNH61214	MERINOf/12	340 000 TRY 340 000	100,80	4 188,35 TRY	4 295 522,61	1,01%
TRSTPFC61210 Creditwest Faktoring Hizmetleri A.S.	CRDFAfe/12	500 000 TRY 500 000	101,30	22 352,05 TRY	6 548 403,77	1,54%
TRT010420T19 Turecko	TURKGB4 04/20	500 000 TRY 5 000	113,50	1 538,46 TRY	7 046 003,84	1,66%
TRT020211T11 Turecko	TURKGB0 02/11	900 000 TRY 9 000	97,91	0,00 TRY	10 910 600,02	2,57%
TRT070312T14 Turecko	TURKGB16 03/12	240 000 TRY 2 400	110,91	5 516,02 TRY	3 364 270,66	0,79%
TRT190111T13 Turecko	TURKGB14 01/11	750 000 TRY 7 500	101,47	29 103,26 TRY	9 783 724,36	2,31%
TRT290415T14 Turecko	TURKGB4 04/15	1 000 000 TRY 10 000	112,47	19 462,50 TRY	14 167 595,34	3,34%
XS0371442822 Home Credit&Finance Bank LLC	HCFBbe11/11	500 000 USD 500	103,66	19 708,33 USD	9 540 303,38	2,25%
Celkem za dluhopisy					416 134 642,31	98,11%

Závazky a pohledávky vyplývající z investičních operací

Instrument ID Emitent	Instrument	Splatnost	Nominální hodnota	Dis. sazba	Celkem CZK	Váha
CZ0003501462 Severomoravské vodovody a kanalizace	SMVAKb5/15 - výplata úroku	15.11.2010	250 000,00 CZK	0,87%	249 897,33	0,06%
XS0213064289 Landsbanki Islands HF	LANISLfe/10 - Pohledávka	31.12.2010	600 000,00 CZK	0,00%	600 000,00	0,14%
	CZK - Záloha na poplatky	29.10.2010	-1 990 879,34 CZK	0,00%	-1 990 879,34	-0,47%
	CZK - Pohledávka	29.10.2010	19 255,12 CZK	0,00%	19 255,12	0,00%
	CZK - Pohledávka	29.10.2010	434 587,98 CZK	0,00%	434 587,98	0,10%
	FX operace	29.10.2010	-4 425 417,09 CZK	0,00%	-4 425 417,09	-1,04%
	FX operace	30.11.2010	10 722 000,00 EUR	0,87%	-264 057 526,46	-62,26%
	FX operace	30.11.2010	264 190 080,00 CZK	0,87%	263 985 930,88	62,24%
Celkem za závazky a pohledávky					-5 184 151,57	-1,22%

Peněžní zůstatky

Měna	Zůstatek	Hodnota
CZK	12 943 799,01	12 943 799,01 CZK
USD	6 726,46	119 278,28 CZK
EUR	-1 483,51	-36 563,60 CZK
PLN	13 167,92	81 805,83 CZK
HUF	4 541,05	412,31 CZK
TRY	5 843,31	72 353,61 CZK
RON	315,78	1 823,88 CZK

Zůstatky celkem 13 182 909,31 CZK

Použité měnové kurzy

Měnový kurz	Kurz
CZK/USD	17,7327
CZK/EUR	24,6467
CZK/PLN	6,2125
CZK/HUF	0,0908
CZK/TRY	12,3750
CZK/RON	5,7670

Souhrn

Typ Instrumentu	Tržní hodnota CZK	Váha
Dluhopisy PLN	210 726 180,98	49,68%
Dluhopisy TRY	61 155 500,15	14,42%
Dluhopisy HUF	54 060 604,16	12,75%
Dluhopisy CZK	28 007 850,56	6,60%
Dluhopisy RON	27 261 572,06	6,43%
Dluhopisy EUR	25 382 631,02	5,98%
Dluhopisy USD	9 540 303,38	2,25%
Závazky a pohledávky	-5 184 151,57	-1,22%
Peněžní zůstatky	13 182 909,31	3,11%
Celková hodnota	424 133 400,05	100,00%