

# Ocenění portfolia

dle data uzavření obchodu k 30.09.2010  
pro klienta CONSEQ INVEST dluhopisový fond

## 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	84,00	0,00 CZK	<b>13 440 000,00</b>	1,01%
AT0000A019E4 Allgemeine Bau - A.Porr AG	PORRfe/11	14 000 000 7 CZK	99,90	123 328,33 CZK	<b>14 109 328,33</b>	1,06%
AT000B004973 Erste Group Bank AG	ERSTBKfe/13	14 000 000 7 CZK	100,00	14 676,67 CZK	<b>14 014 676,67</b>	1,05%
CZ0000000211 ECM Real Estate Investments AG	ECMf/12	23 000 000 23 CZK	30,00	0,00 CZK	<b>6 900 000,00</b>	0,52%
CZ0001000822 Česká republika	CZgb4.60/18	23 500 000 2 350 CZK	111,55	126 116,67 CZK	<b>26 340 719,17</b>	1,98%
CZ0001001317 Česká republika	CZgb3.75/20	130 000 000 13 000 CZK	103,26	243 750,00 CZK	<b>134 482 400,00</b>	10,09%
CZ0001001796 Česká republika	CZgb4.20/36	32 500 000 3 250 CZK	103,01	1 122 333,33 CZK	<b>34 601 395,83</b>	2,60%
CZ0001001903 Česká republika	CZgb4.00/17	70 000 000 7 000 CZK	107,26	1 314 444,44 CZK	<b>76 396 794,44</b>	5,73%
CZ0001001945 Česká republika	CZgb4.70/22	137 000 000 13 700 CZK	111,53	321 950,00 CZK	<b>153 122 845,00</b>	11,48%
CZ0001002471 Česká republika	CZgb5.00/19	77 000 000 7 700 CZK	113,15	1 807 361,11 CZK	<b>88 932 476,11</b>	6,67%
CZ0001002729 Česká republika	CZgb2.80/13	20 000 000 2 000 CZK	101,90	371 777,78 CZK	<b>20 751 937,78</b>	1,56%
CZ0001002737 Česká republika	CZgb3.40/15	80 000 000 8 000 CZK	103,71	1 579 111,11 CZK	<b>84 545 511,11</b>	6,34%
CZ0003500605 MERO ČR, a. s.	MERO1b10.3/11	200 000 2 CZK	104,05	9 441,67 CZK	<b>217 541,67</b>	0,02%
CZ0003501058 ČEZ, a. s.	CEZ1f/14	20 000 000 20 CZK	110,00	713 555,56 CZK	<b>22 713 555,56</b>	1,70%
CZ0003501462 Severomoravské vodovody a kanalizace	SMVAKb5/15	25 000 000 25 CZK	105,85	1 093 750,00 CZK	<b>27 556 250,00</b>	2,07%
XS0219645222 KBC IFIMA NV	KBCbe3.87/16	20 000 000 2 000 CZK	96,50	286 273,97 CZK	<b>19 586 273,97</b>	1,47%
XS0244345087 Anglo Irish Bank Corp Ltd.	ANGIRIbe3.13/11	12 000 000 6 CZK	96,00	218 156,71 CZK	<b>11 738 156,71</b>	0,88%
XS0305574682 Telefónica Emisiones SAU	TELEFObe4.623/14	16 000 000 8 CZK	106,00	208 731,62 CZK	<b>17 168 731,62</b>	1,29%
XS0490323580 General Electric Capital Corp	GE4fe/15	24 000 000 12 CZK	99,45	42 840,00 CZK	<b>23 910 840,00</b>	1,79%
XS0504445387 Royal Bank of Scotland PLC	RBSbe3.02/13	12 000 000 8 CZK	99,00	159 053,33 CZK	<b>12 039 053,33</b>	0,90%
XS0536184301 Volkswagen Financial Services NV	VW1fe/13	10 000 000 5 CZK	100,10	12 083,33 CZK	<b>10 022 083,33</b>	0,75%
XS0543083298 Citigroup Funding Inc.	Cfe3/15	32 000 000 16 CZK	100,00	2 284,44 CZK	<b>32 002 284,44</b>	2,40%
AT0000496633 Atrium European Real Estate Ltd.	MEL1fe/17	1 500 000 30 EUR	80,00	9 333,33 EUR	<b>29 710 483,28</b>	2,23%
XS0206214438 Depfa Bank Plc	HYPINTfe/11	780 057 940 EUR	95,50	524,78 EUR	<b>18 314 677,93</b>	1,37%
XS0211034466 Goldman Sachs Group Inc	GSfe/15	800 000 800 EUR	93,94	1 768,69 EUR	<b>18 505 769,59</b>	1,39%
XS0214084252 OTP Bank Rt.	OTPfe/15	1 450 000 29 EUR	78,00	1 386,20 EUR	<b>27 820 072,71</b>	2,09%
XS0231264275 MOL Magyar Olaj Rt.	MOLHBbe3.875/15	600 000 600 EUR	91,16	22 931,51 EUR	<b>14 000 352,13</b>	1,05%

XS0233154912 HSBC Finance Corp	HSBC2fe/12	663 878 8	EUR	96,25	3 274,52 EUR	<b>15 778 759,33</b>	1,18%
XS0260783005 Erste Group Bank AG	ERSTBKfe/17	800 000 16	EUR	92,39	2 021,29 EUR	<b>18 207 297,16</b>	1,37%
XS0307199215 Hungarian Development Bank Ltd.	MAGYARbe4.875/12	1 050 000 21	EUR	99,53	14 164,21 EUR	<b>26 023 937,95</b>	1,95%
XS0449738987 Croatian Bank for Reconstruction & Deve	CBRDbe7.25/12	400 000 400	EUR	105,60	2 145,21 EUR	<b>10 429 745,73</b>	0,78%
XS0503453275 MOL Magyar Olaj Rt.	MOLHBbe5.875/17	300 000 300	EUR	95,29	7 870,89 EUR	<b>7 216 480,43</b>	0,54%
XS0504814509 New World Resources N.V.	NWRbe7.875/18	350 000 350	EUR	103,79	11 407,81 EUR	<b>9 205 029,91</b>	0,69%
XS0531922465 Morgan Stanley	MSbe5.375/20	350 000 7	EUR	102,42	2 628,60 EUR	<b>8 871 422,86</b>	0,67%
HU0000402318 Maďarsko	HUgb5.5-02/16	173 000 000 17 300	HUF	95,35	5 995 753,42 HUF	<b>15 187 311,77</b>	1,14%
HU0000402433 Maďarsko	HUgb6.5-06/19	202 700 000 20 270	HUF	98,34	3 537 531,51 HUF	<b>18 023 675,18</b>	1,35%
XS0305275694 NIBC Bank NV	NIBCfe/12	125 000 000 5	HUF	98,25	3 209 931,51 HUF	<b>11 196 344,47</b>	0,84%
PL0000102836 Polsko	PLgb5-10/13	2 033 000 2 033	PLN	100,39	94 961,43 PLN	<b>13 200 427,15</b>	0,99%
PL0000104287 Polsko	PLgb4.25-05/11	2 350 000 2 350	PLN	100,21	35 297,00 PLN	<b>14 772 910,79</b>	1,11%
PL0000104543 Polsko	PLgb5.25-10/17	2 350 000 2 350	PLN	99,80	114 915,00 PLN	<b>15 204 558,93</b>	1,14%
PL0000105441 Polsko	PLgb5.5-10/19	4 850 000 4 850	PLN	100,59	248 465,50 PLN	<b>31 686 262,88</b>	2,38%
XS0371442822 Home Credit&Finance Bank LLC	HCFBbe11/11	1 000 000 1 000	USD	105,00	30 555,56 USD	<b>19 445 294,85</b>	1,46%
<b>Celkem za dluhopisy</b>						<b>1 187 393 670,09</b>	89,06%

## Poukázky MF

Instrument ID Emitent	Instrument	Nominální hodnota / ks	Splatnost	Výnos %	Celkem CZK	Váha
CZ0001002984 Česká republika	MF 03/12   599	60 000 000 60 CZK	03.12.2010	1,07	<b>59 882 778,80</b>	4,49%
<b>Celkem za poukázky</b>					<b>59 882 778,80</b>	4,49%

## Směnky

Instrument ID Emitent	Instrument	Nominální hodnota	Kurz v %	Celkem CZK	Váha
CZ0000011 Ceské dráhy, a.s.	CDs2-11/10	28 000 000 CZK	99,63	<b>27 896 318,68</b>	2,09%
<b>Celkem za směnky</b>				<b>27 896 318,68</b>	2,09%

## Závazky a pohledávky vyplývající z investičních operací

Instrument ID Emitent	Instrument	Splatnost	Nominální hodnota	Dis. sazba	Celkem CZK	Váha
XS0215426957 Glitnir Banki HF	ISFBAbe3/10 - Pohledávka	03.10.2010	5 400 000,00 CZK	0,00%	<b>5 400 000,00</b>	0,41%
	FX operace	29.10.2010	365 000,00 EUR	0,87%	<b>-8 960 913,72</b>	-0,67%
	CZK - Záloha na poplatky	30.09.2010	-3 192 978,85 CZK	0,00%	<b>-3 126 378,24</b>	-0,23%
	CZK - Pohledávka	30.09.2010	1 247 273,55 CZK	0,00%	<b>1 247 273,55</b>	0,09%
	FX operace	30.09.2010	-854 838,72 CZK	0,00%	<b>-854 838,72</b>	-0,06%
	FX operace	29.10.2010	11 980 000,00 EUR	0,87%	<b>-294 114 373,48</b>	-22,06%
	FX operace	29.10.2010	295 989 860,00 CZK	0,87%	<b>295 782 565,72</b>	22,19%
	FX operace	29.10.2010	9 018 055,00 CZK	0,87%	<b>9 011 739,27</b>	0,68%
<b>Celkem za závazky a pohledávky</b>					<b>4 385 074,39</b>	0,33%

## Peněžní zůstatky

Měna	Zůstatek	Hodnota
CZK	53 054 157,13	<b>53 054 157,13 CZK</b>
USD	-2 381,51	<b>-42 856,81 CZK</b>
EUR	4 708,20	<b>115 669,43 CZK</b>
PLN	88 927,44	<b>549 602,88 CZK</b>
HUF	22 865,12	<b>2 031,43 CZK</b>
TRY	669,89	<b>8 334,27 CZK</b>
RON	61,82	<b>356,15 CZK</b>
<b>Zůstatky celkem</b>		<b>53 687 294,47 CZK</b>

## 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 CZK	844 592 855,08	63,35%
Dluhopisy EUR	204 084 029,01	15,31%
Dluhopisy PLN	74 864 159,75	5,62%
Dluhopisy HUF	44 407 331,41	3,33%
Dluhopisy USD	19 445 294,85	1,46%
Pokladniční poukázky CZK	59 882 778,80	4,49%
Směnky CZK	27 896 318,68	2,09%
Závazky a pohledávky	4 385 074,39	0,33%
Peněžní zůstatky	53 687 294,47	4,03%
<b>Celková hodnota</b>	<b>1 333 245 136,43</b>	<b>100,00%</b>