

# Ocenění portfolia

dle data uzavření obchodu k 29.10.2010  
pro klienta Conseq Invest konzervativní dluhopisový fond

## Dluhopisy

Instrument ID Emitent	Instrument	Nominální hodnota / ks	Kurz v %	AÚV	Celkem CZK	Váha
AT0000A019E4 Allgemeine Bau - A.Porr AG	PORRfe/11	8 000 000 CZK 4	99,85	92 448,89 CZK	<b>8 080 448,89</b>	1,38%
CZ0001001887 Česká republika	CZgb3.55/12	55 000 000 CZK 5 500	103,52	59 659,72 CZK	<b>56 997 584,72</b>	9,71%
CZ0001001903 Česká republika	CZgb4.00/17	10 000 000 CZK 1 000	105,52	220 000,00 CZK	<b>10 772 250,00</b>	1,83%
CZ0001002158 Česká republika	CZgb4.10/11	15 000 000 CZK 1 500	101,39	338 250,00 CZK	<b>15 546 375,00</b>	2,65%
CZ0001002331 Česká republika	CZgbf/16	33 000 000 CZK 3 300	99,12	2 823,33 CZK	<b>32 711 862,33</b>	5,57%
CZ0001002471 Česká republika	CZgb5.00/19	5 000 000 CZK 500	110,91	137 500,00 CZK	<b>5 682 775,00</b>	0,97%
CZ0001002505 Česká republika	CZgbf/12	101 000 000 CZK 10 100	101,70	128 775,00 CZK	<b>102 845 775,00</b>	17,51%
CZ0001002729 Česká republika	CZgb2.80/13	23 000 000 CZK 2 300	101,63	479 422,22 CZK	<b>23 854 322,22</b>	4,06%
CZ0001002737 Česká republika	CZgb3.40/15	33 000 000 CZK 3 300	102,70	741 766,67 CZK	<b>34 632 106,67</b>	5,90%
CZ0001500086 Hlavní město Praha	PRAHA1b6,85/11	5 000 000 CZK 5	102,80	156 027,78 CZK	<b>5 296 027,78</b>	0,90%
CZ0003501058 ČEZ, a. s.	CEZ1f/14	8 000 000 CZK 8	110,10	318 933,33 CZK	<b>9 126 933,33</b>	1,55%
CZ0003501462 Severomoravské vodovody a kanalizace	SMVAKb5/15	10 000 000 CZK 10	105,25	-22 222,22 CZK	<b>10 502 777,78</b>	1,79%
CZ0003701286 Česká spořitelna, a. s.	CSPOb3.49/12	4 000 000 CZK 2	101,90	84 147,78 CZK	<b>4 160 147,78</b>	0,71%
CZ0003702367 Česká spořitelna, a. s.	CSPOf/13	12 000 000 CZK 6	100,40	11 400,00 CZK	<b>12 059 400,00</b>	2,05%
XS0230246323 ING Bank N.V., Amsterdam	INGfe2/12	20 000 000 CZK 2	99,10	91 000,00 CZK	<b>19 911 000,00</b>	3,39%
XS0235608873 Merrill Lynch & Co Inc	MERfe/10	16 000 000 CZK 8	99,95	37 235,56 CZK	<b>16 029 235,56</b>	2,73%
XS0244345087 Anglo Irish Bank Corp Ltd.	ANGIRIbe3.13/11	8 000 000 CZK 4	95,75	165 332,60 CZK	<b>7 825 332,60</b>	1,33%
XS0246197452 SNS Bank NV	SNSfe/11	6 000 000 CZK 3	99,60	12 506,67 CZK	<b>5 988 506,67</b>	1,02%
XS0327362116 Citigroup Funding Inc.	Cfe2/12	10 000 000 CZK 100	98,10	0,00 CZK	<b>9 810 000,00</b>	1,67%
XS0350806351 E.ON International Finance B.V.	EONfe/13	6 000 000 CZK 3	100,10	15 103,33 CZK	<b>6 021 103,33</b>	1,03%
XS0365845485 Vodafone Group Plc	VODfe/13	6 000 000 CZK 4	100,20	18 106,67 CZK	<b>6 030 106,67</b>	1,03%
XS0473872306 ČEZ, a. s.	CEZfe/12	15 000 000 CZK 10	100,90	114 291,67 CZK	<b>15 249 291,67</b>	2,60%
XS0490323580 General Electric Capital Corp	GE4fe/15	14 000 000 CZK 7	99,97	51 831,11 CZK	<b>14 047 169,11</b>	2,39%
XS0504445387 Royal Bank of Scotland PLC	RBSbe3.02/13	7 500 000 CZK 5	98,80	117 654,17 CZK	<b>7 527 654,17</b>	1,28%
XS0536184301 Volkswagen Financial Services NV	VW1fe/13	6 000 000 CZK 3	100,25	14 258,33 CZK	<b>6 029 258,33</b>	1,03%
XS0543083298 Citigroup Funding Inc.	Cfe3/15	4 000 000 CZK 2	100,02	8 566,67 CZK	<b>4 009 366,67</b>	0,68%
XS0194297502 Slovenske Elektrarne Finance B.V.	ELEKSKbe5.625/11	250 000 EUR 250	102,35	4 892,98 EUR	<b>6 427 065,62</b>	1,09%

XS0206214438 Depfa Bank Plc	HYPINTfe/11	381 730 EUR 460	95,25	580,61 EUR	<b>8 975 791,91</b>	1,53%
XS0211034466 Goldman Sachs Group Inc	GSfe/15	200 000 EUR 200	94,77	730,89 EUR	<b>4 689 378,61</b>	0,80%
XS0214084252 OTP Bank Rt.	OTPfe/15	550 000 EUR 11	79,50	1 161,14 EUR	<b>10 805 380,26</b>	1,84%
XS0233154912 HSBC Finance Corp	HSBC2fe/12	414 924 EUR 5	96,25	47,02 EUR	<b>9 844 165,05</b>	1,68%
XS0260783005 Erste Group Bank AG	ERSTBKfe/17	450 000 EUR 9	94,08	174,13 EUR	<b>10 439 188,07</b>	1,78%
XS0282614204 AEGON Global Institutional Markets plc	AGIMbe4.25/12	250 000 EUR 250	102,09	8 121,58 EUR	<b>6 490 798,15</b>	1,11%
XS0307199215 Hungarian Development Bank Ltd.	MAGYARbe4.875/12	350 000 EUR 7	99,94	6 077,05 EUR	<b>8 770 571,42</b>	1,49%
XS0449738987 Croatian Bank for Reconstruction & Devel	CBRDbe7.25/12	200 000 EUR 200	105,60	2 224,66 EUR	<b>5 260 126,00</b>	0,90%
<b>Celkem za dluhopisy</b>					<b>522 449 276,35</b>	88,97%

## Poukázky MF

Instrument ID Emitent	Instrument	Nominální hodnota / ks	Splatnost	Výnos %	Celkem CZK	Váha
CZ0001002984 Česká republika	MF 03/12   599	20 000 000 CZK 20	03.12.2010	0,97	<b>19 980 066,00</b>	3,40%
<b>Celkem za poukázky</b>					<b>19 980 066,00</b>	3,40%

## Směnky

Instrument ID Emitent	Instrument	Nominální hodnota	Kurz v %	Celkem CZK	Váha
CZ0000010 České dráhy, a.s.	CDs1-11/10	13 000 000 CZK	99,81	<b>12 975 084,23</b>	2,21%
<b>Celkem za směnky</b>				<b>12 975 084,23</b>	2,21%

## 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	500 000,00 CZK	0,87%	<b>499 794,67</b>	0,09%
XS0211034466 Goldman Sachs Group Inc	GSfe/15 - výplata úroku	02.11.2010	689,49 EUR	0,87%	<b>16 992,00</b>	0,00%
XS0213064289 Landsbanki Islands HF	LANISLfe/10 - Pohledávka	31.12.2010	1 200 000,00 CZK	0,00%	<b>1 200 000,00</b>	0,20%
	FX operace	30.11.2010	2 820 000,00 EUR	0,87%	<b>-69 449 937,01</b>	-11,83%
	CZK - Záloha na poplatky	29.10.2010	-1 762 045,10 CZK	0,00%	<b>-1 762 045,10</b>	-0,30%
	CZK - Pohledávka	29.10.2010	2 628 034,63 CZK	0,00%	<b>2 613 014,50</b>	0,44%
	FX operace	29.10.2010	-674 988,27 CZK	0,00%	<b>-674 988,27</b>	-0,11%
	FX operace	30.11.2010	69 484 800,00 CZK	0,87%	<b>69 431 106,61</b>	11,82%
<b>Celkem za závazky a pohledávky</b>					<b>1 873 937,40</b>	0,32%

## Peněžní zůstatky

Měna	Zůstatek	Hodnota
CZK	29 679 565,37	<b>29 679 565,37 CZK</b>
USD	6 086,80	<b>107 935,38 CZK</b>
EUR	5 316,43	<b>131 032,36 CZK</b>
PLN	1,65	<b>10,25 CZK</b>
<b>Zůstatky celkem</b>		<b>29 918 543,36 CZK</b>

## Použité měnové kursy

Měnový kurz	Kurz
CZK/USD	17,7327
CZK/EUR	24,6467
CZK/PLN	6,2125

## Souhrn

Typ Instrumentu	Tržní hodnota CZK	Váha
Dluhopisy CZK	450 746 811,27	76,76%
Dluhopisy EUR	71 702 465,09	12,21%
Pokladniční poukázky CZK	19 980 066,00	3,40%
Směnky CZK	12 975 084,23	2,21%
Závazky a pohledávky	1 873 937,40	0,32%
Peněžní zůstatky	29 918 543,36	5,10%
<b>Celková hodnota</b>	<b>587 196 907,35</b>	<b>100,00%</b>