

Ocenění portfolia

dle data uzavření obchodu k 29.10.2010
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 CZK 8	83,00	87 040,00 CZK	13 367 040,00	1,09%
AT0000A019E4 Allgemeine Bau - A.Porr AG	PORRfe/11	14 000 000 CZK 7	99,85	161 785,56 CZK	14 140 785,56	1,16%
AT000B004973 Erste Group Bank AG	ERSTBKfe/13	14 000 000 CZK 7	100,25	39 713,33 CZK	14 074 713,33	1,15%
CZ0000000211 ECM Real Estate Investments AG	ECMf/12	23 000 000 CZK 23	20,00	82 263,33 CZK	4 682 263,33	0,38%
CZ0001000822 Česká republika	CZgb4.60/18	23 500 000 CZK 2 350	109,12	213 197,22 CZK	25 855 574,72	2,12%
CZ0001001317 Česká republika	CZgb3.75/20	130 000 000 CZK 13 000	100,77	636 458,33 CZK	131 634 208,33	10,77%
CZ0001001796 Česká republika	CZgb4.20/36	32 500 000 CZK 3 250	102,16	1 232 291,67 CZK	34 434 941,67	2,82%
CZ0001001903 Česká republika	CZgb4.00/17	70 000 000 CZK 7 000	105,52	1 540 000,00 CZK	75 405 750,00	6,17%
CZ0001001945 Česká republika	CZgb4.70/22	137 000 000 CZK 13 700	108,53	840 647,22 CZK	149 531 542,22	12,24%
CZ0001002471 Česká republika	CZgb5.00/19	77 000 000 CZK 7 700	110,91	2 117 500,00 CZK	87 514 735,00	7,16%
CZ0001002737 Česká republika	CZgb3.40/15	80 000 000 CZK 8 000	102,70	1 798 222,22 CZK	83 956 622,22	6,87%
CZ0003500605 MERO ČR, a. s.	MERO1b10.3/11	200 000 CZK 2	103,85	11 101,11 CZK	218 801,11	0,02%
CZ0003501058 ČEZ, a. s.	CEZ1f/14	20 000 000 CZK 20	110,10	797 333,33 CZK	22 817 333,33	1,87%
CZ0003501462 Severomoravské vodovody a kanalizace	SMVAKb5/15	25 000 000 CZK 25	105,25	-55 555,56 CZK	26 256 944,44	2,15%
XS0219645222 KBC IFIMA NV	KBCbe3.87/16	20 000 000 CZK 2 000	96,75	347 769,86 CZK	19 697 769,86	1,61%
XS0244345087 Anglo Irish Bank Corp Ltd.	ANGIRIbe3.13/11	16 000 000 CZK 8	95,75	330 665,21 CZK	15 650 665,21	1,28%
XS0305574682 Telefónica Emisiones SAU	TELEFObe4.623/14	16 000 000 CZK 8	105,00	267 500,71 CZK	17 067 500,71	1,40%
XS0490323580 General Electric Capital Corp	GE4fe/15	24 000 000 CZK 12	99,97	88 853,33 CZK	24 080 861,33	1,97%
XS0504445387 Royal Bank of Scotland PLC	RBSbe3.02/13	12 000 000 CZK 8	98,80	188 246,67 CZK	12 044 246,67	0,99%
XS0536184301 Volkswagen Financial Services NV	VW1fe/13	10 000 000 CZK 5	100,25	23 763,89 CZK	10 048 763,89	0,82%
XS0543083298 Citigroup Funding Inc.	Cfe3/15	32 000 000 CZK 16	100,02	68 533,33 CZK	32 074 933,33	2,63%
AT0000496633 Atrium European Real Estate Ltd.	MEL1fe/17	1 500 000 EUR 30	80,50	14 166,67 EUR	30 110 030,59	2,46%
XS0206214438 Depfa Bank Plc	HYPINTfe/11	780 057 EUR 940	95,25	1 186,47 EUR	18 341 835,64	1,50%
XS0211034466 Goldman Sachs Group Inc	GSfe/15	800 000 EUR 800	94,77	2 923,56 EUR	18 757 514,44	1,54%
XS0214084252 OTP Bank Rt.	OTPfe/15	1 450 000 EUR 29	79,50	3 061,19 EUR	28 486 911,60	2,33%
XS0233154912 HSBC Finance Corp	HSBC2fe/12	663 878 EUR 8	96,25	75,24 EUR	15 750 664,08	1,29%
XS0260783005 Erste Group Bank AG	ERSTBKfe/17	800 000 EUR 16	94,08	309,56 EUR	18 558 556,56	1,52%

XS0307199215 Hungarian Development Bank Ltd.	MAGYARbe4.875/12	1 050 000 EUR 21	99,94	18 231,16 EUR	26 311 714,25	2,15%
XS0449738987 Croatian Bank for Reconstruction & Devel	CBRDbe7.25/12	600 000 EUR 600	105,60	6 673,97 EUR	15 780 377,99	1,29%
XS0503453275 MOL Magyar Olaj Rt.	MOLHBbe5.875/17	300 000 EUR 300	96,71	9 271,23 EUR	7 379 165,83	0,60%
XS0504814509 New World Resources N.V.	NWRbe7.875/18	350 000 EUR 350	104,00	13 628,12 EUR	9 307 651,47	0,76%
XS0531922465 Morgan Stanley	MSbe5.375/20	350 000 EUR 7	101,17	4 123,29 EUR	8 829 272,00	0,72%
XS0545031642 Powszechna Kasa Oszczednosci Bank P	PKOBPbe3.733/15	1 100 000 EUR 1 100	98,09	900,01 EUR	26 616 438,36	2,18%
HU0000402318 Maďarsko	HUgb5.5-02/16	173 000 000 HUF 17 300	94,17	6 751 739,73 HUF	15 405 056,92	1,26%
HU0000402433 Maďarsko	HUgb6.5-06/19	81 500 000 HUF 8 150	96,86	1 843 239,73 HUF	7 334 912,78	0,60%
XS0305275694 NIBC Bank NV	NIBCfe/12	125 000 000 HUF 5	99,00	4 113 698,63 HUF	11 609 452,28	0,95%
PL0000102646 Polsko	PLgb5.75-09/22	3 250 000 PLN 3 250	100,48	18 427,50 PLN	20 402 859,18	1,67%
PL0000104287 Polsko	PLgb4.25-05/11	2 350 000 PLN 2 350	100,21	43 240,00 PLN	14 898 976,60	1,22%
PL0000104543 Polsko	PLgb5.25-10/17	2 350 000 PLN 2 350	98,93	1 363,00 PLN	14 451 943,06	1,18%
PL0000105441 Polsko	PLgb5.5-10/19	5 235 000 PLN 5 235	99,15	3 141,00 PLN	32 266 534,48	2,64%
PL0000106324 Polsko	PLgb0-01/13	2 400 000 PLN 2 400	90,11	0,00 PLN	13 435 272,12	1,10%
XS0371442822 Home Credit&Finance Bank LLC	HCFBbe11/11	1 000 000 USD 1 000	103,66	39 416,67 USD	19 080 606,77	1,56%
Celkem za dluhopisy					1 187 671 743,29	97,20%

Směňky

Instrument ID Emitent	Instrument	Nominální hodnota	Kurz v %	Celkem CZK	Váha
CZ0000011 Ceské dráhy, a.s.	CDs2-11/10	28 000 000 CZK	99,81	27 946 335,27	2,29%
Celkem za směňky				27 946 335,27	2,29%

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	1 250 000,00 CZK	0,87%	1 249 486,67	0,10%
XS0211034466 Goldman Sachs Group Inc	GSfe/15 - výplata úroku	02.11.2010	2 757,96 EUR	0,87%	67 967,99	0,01%
XS0215426957 Gltinir Banki HF	ISFBAb3/10 - Pohledávka	31.12.2010	5 100 000,00 CZK	0,00%	5 100 000,00	0,42%
	CZK - Záloha na poplatky	29.10.2010	-3 935 489,25 CZK	0,00%	-3 935 489,25	-0,32%
	CZK - Pohledávka		597 020,57 CZK	0,00%	597 020,57	0,05%
	CZK - Pohledávka	29.10.2010	25 917 606,51 CZK	0,00%	25 917 606,51	2,12%
	FX operace	29.10.2010	-32 077 399,56 CZK	0,00%	-32 077 399,56	-2,63%
	FX operace	30.11.2010	13 441 000,00 EUR	0,87%	-331 020 072,11	-27,09%
	FX operace	30.11.2010	331 186 240,00 CZK	0,87%	330 930 320,55	27,08%
Celkem za závazky a pohledávky					-3 170 558,62	-0,26%

Peněžní zůstatky

Měna	Zůstatek	Hodnota
CZK	9 149 603,04	9 149 603,04 CZK
USD	13 688,37	242 731,72 CZK
EUR	681,71	16 801,89 CZK
PLN	1 350,67	8 391,05 CZK
HUF	4 499,12	408,50 CZK
TRY	669,89	8 294,78 CZK
RON	61,82	357,06 CZK
Zůstatky celkem		9 426 588,04 CZK

Použité měnové kursy

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 CZK	814 555 996,28	66,66%
Dluhopisy EUR	224 230 132,82	18,35%
Dluhopisy PLN	95 455 585,44	7,81%
Dluhopisy HUF	34 349 421,98	2,81%
Dluhopisy USD	19 080 606,77	1,56%
Směnky CZK	27 946 335,27	2,29%
Závazky a pohledávky	-3 170 558,62	-0,26%
Peněžní zůstatky	9 426 588,04	0,77%
Celková hodnota	1 221 874 107,98	100,00%