

Ocenění portfolia

dle data vypořádání obchodu k 29.03.2013
pro klienta Conseq korporátních dluhopisů - Veřejný standardní fond

účet vlastníka: **ConCorpBond**

se sídlem Rybná 682/14, Praha 1

IČO/RČ: **8880248902**

Dluhopisy

Instrument ID Emitent	Instrument	Nominální hodnota / ks	Kurz v %	AÚV	Celkem CZK	Váha
AT0000492996 Atrium European Real Estate Ltd.	MEL2fe/15	6 000 000 3 CZK	94,50	11 895,00 CZK	5 681 895,00	1,98%
AT000B004973 Erste Group Bank AG	ERSTBKfe/13	6 000 000 3 CZK	100,25	3 493,33 CZK	6 018 493,33	2,09%
CZ0000000260 Home Credit, a.s.	HCb6.25/16	6 000 000 2 CZK	106,00	288 541,67 CZK	6 648 541,67	2,31%
CZ0001500110 Hlavní město Praha	PRAHAb4.25/21	5 000 000 5 CZK	114,50	187 708,33 CZK	5 912 708,33	2,06%
CZ0003501058 ČEZ, a. s.	CEZ1f/14	11 000 000 11 CZK	104,95	125 033,33 CZK	11 669 533,33	4,06%
CZ0003501462 Severomoravské vodovody a kanalizace	SMVAKb5/15	7 000 000 7 CZK	105,20	130 277,78 CZK	7 494 277,78	2,61%
CZ0003501736 CETELEM CR, a.s.	CETELEMf/14	6 000 000 3 CZK	100,45	36 166,67 CZK	6 063 166,67	2,11%
CZ0003501884 Český Aeroholding, a.s.	AEROHDb3.9/17	2 500 000 2 500 000 CZK	101,85	-5 145,83 CZK	2 541 104,17	0,88%
CZ0003502155 Český Aeroholding, a.s.	AEROHDb2.7/14	5 000 000 5 000 000 CZK	100,00	63 375,00 CZK	5 063 375,00	1,76%
XS0219645222 KBC IFIMA NV	KBCbe3.87/16	6 000 000 600 CZK	99,75	200 391,78 CZK	6 185 391,78	2,15%
XS0245704449 NIBC Bank NV	NIBCfe/16	5 000 000 1 CZK	89,20	4 247,22 CZK	4 464 247,22	1,55%
XS0259125945 SNS Bank Nederland NV	SNSbe4.05/14	6 000 000 6 CZK	100,65	174 427,40 CZK	6 213 427,40	2,16%
XS0490323580 General Electric Capital Corp	GE4fe/15	8 000 000 4 CZK	100,85	8 166,67 CZK	8 076 166,67	2,81%
XS0504445387 Royal Bank of Scotland PLC	RBSbe3.02/13	12 000 000 8 CZK	100,13	339 246,67 CZK	12 354 846,67	4,30%
XS0543083298 Citigroup Inc	Cfe3/15	8 000 000 4 CZK	102,00	404,44 CZK	8 160 404,44	2,84%
XS0622499787 ČEZ, a. s.	CEZbe4.6/23	10 000 000 2 CZK	120,50	415 890,41 CZK	12 465 890,41	4,34%
XS0626768096 Natixis	NATIXISfe/13	10 000 000 5 CZK	100,05	10 633,33 CZK	10 015 633,33	3,48%
XS0638306406 UniCredit S.p.A.	UCGIMfe4/13	10 000 000 8 CZK	100,10	4 094,44 CZK	10 014 094,44	3,48%
XS0638557073 Jyske Bank A/S	JYBCfe/13	10 000 000 100 CZK	100,05	1 211,11 CZK	10 006 211,11	3,48%
XS0761852556 Telefónica Emisiones SAU	TELEFObe3.934/17	5 000 000 1 CZK	104,60	196 161,10 CZK	5 426 161,10	1,89%
XS0766345481 RCI Banque SA	RENAULfe/15	6 000 000 3 CZK	101,00	33 075,00 CZK	6 093 075,00	2,12%
XS0860033769 ING Bank N.V., Amsterdam	ING5fe/14	4 500 000 90 CZK	100,05	2 936,25 CZK	4 505 186,25	1,57%
XS0860033843 ING Bank N.V., Amsterdam	ING6fe/17	3 000 000 60 CZK	100,00	3 214,17 CZK	3 003 214,17	1,04%
XS0877209188 BNP ParibasS Arbitrage Issuance B.V.	BNPfe/18	8 000 000 8 CZK	100,10	16 100,00 CZK	8 024 100,00	2,79%
XS0880210702 Crédit Agricole CIB	CACIBfe/18	8 000 000 8 CZK	100,00	18 666,67 CZK	8 018 666,67	2,79%
XS0885329614 LeasePlan Corporation N.V.	LPLNfe/18	14 000 000 7 CZK	100,00	35 793,33 CZK	14 035 793,33	4,88%
AT0000A0ZZD8 Slovenska Izvovzna Razvojna Banka, d.d.	SEDABlfe/16	300 000 3 EUR	97,91	29,48 EUR	7 560 247,51	2,63%

XS0197079972 Merrill Lynch & Co Inc	BAC3fe/14	300 000 300	EUR	99,78	362,45 EUR	7 712 572,33	2,68%
XS0211034466 Goldman Sachs Group Inc	GSfe/15	300 000 300	EUR	99,45	301,22 EUR	7 685 904,87	2,67%
XS0214084252 OTP Bank Rt.	OTPfe/15	300 000 6	EUR	90,01	158,12 EUR	6 953 175,59	2,42%
XS0260783005 Erste Group Bank AG	ERSTBKfe/17	300 000 6	EUR	92,69	616,40 EUR	7 171 801,49	2,49%
XS0503453275 MOL Hungarian Oil and Gas Company	MOLHBbe5.875/17	250 000 250	EUR	104,95	13 802,23 EUR	7 107 227,90	2,47%
XS0545031642 Powszechna Kasa Oszczednosci Bank P	PKOBPbe3.733/15	250 000 250	EUR	105,40	4 065,39 EUR	6 885 698,82	2,40%
XS0626282783 BOS Finance AB	BOSPWbe6/16	250 000 250	EUR	108,65	13 232,88 EUR	7 330 849,63	2,55%
XS0731129747 Eileme 2 AB	POLKOMbe11.75/20	200 000 200	EUR	116,25	3 851,39 EUR	6 082 297,11	2,12%
XS0783933350 EP Energy, a. s.	EPERYbe5.875/19	250 000 250	EUR	106,75	6 078,99 EUR	7 024 471,01	2,44%
XS0877986231 New World Resources Plc	NWRbe7.875/21	250 000 250	EUR	90,75	3 609,37 EUR	5 931 515,39	2,06%
TRQTSB91310 Türkiye Is Bankasi A.S.	ISBANK0 09/13	590 000 590	TRY	97,16	0,00 TRY	6 361 157,72	2,21%
XS0546767863 Yasar Holding A.S. (via Willow No.2 PLC	YASARbe9.625/15	250 000 250	USD	105,75	11 496,53 USD	5 537 293,31	1,93%
Celkem za dluhopisy						283 499 817,95	98,61%

Závazky a pohledávky vyplývající z investičních operací

Instrument ID Emitent	Instrument	Splatnost	Nominální hodnota	Dis. sazba	Celkem CZK	Váha
CZ0003501884 Český Aeroholding, a.s.	AEROHDb3.9/17 - výplata úro	18.04.2013	97 500,00 CZK	0,26%	97 485,92	0,03%
	FX operace	14.05.2013	277 500,00 USD	0,22%	-5 568 381,51	-1,94%
	FX operace	03.05.2013	300 000,00 EUR	0,13%	-7 719 555,61	-2,69%
	FX operace	03.05.2013	244 100,00 EUR	0,13%	-6 281 145,08	-2,18%
	FX operace	03.05.2013	2 707 000,00 EUR	0,13%	-69 656 123,41	-24,23%
	CZK - Záloha na poplatky	29.03.2013	-924 077,91 CZK	0,00%	-924 077,91	-0,32%
	CZK - Depozitum	04.04.2013	5 000 000,00 CZK	0,03%	5 000 000,00	1,74%
	FX operace	03.05.2013	7 712 610,00 CZK	0,32%	7 710 211,27	2,68%
	FX operace	03.05.2013	6 297 438,26 CZK	0,32%	6 295 479,67	2,19%
	FX operace	03.05.2013	69 429 136,00 CZK	0,32%	69 407 542,54	24,14%
	FX operace	14.05.2013	5 558 769,00 CZK	0,34%	5 556 340,88	1,93%
Celkem za závazky a pohledávky					3 917 776,76	1,36%

Peněžní zůstatky

Měna	Zůstatek	Hodnota
CZK	67 821,33	67 821,33 CZK
USD	35,81	718,78 CZK
EUR	127,23	3 274,26 CZK
TRY	59,90	664,71 CZK
Zůstatky celkem		72 479,08 CZK

Použité měnové kursy

Měnový kurz	Kurz
CZK/EUR	25,7350
CZK/TRY	11,0970
CZK/USD	20,0720

Souhrn

Typ Instrumentu	Tržní hodnota CZK	Váha
Dluhopisy CZK	194 155 605,27	67,53%
Dluhopisy EUR	77 445 761,65	26,94%
Dluhopisy TRY	6 361 157,72	2,21%
Dluhopisy USD	5 537 293,31	1,93%
Závazky a pohledávky	3 917 776,76	1,36%
Peněžní zůstatky	72 479,08	0,03%
Celková hodnota	287 490 073,79	100,00%