

# Ocenění portfolia

dle data uzavření obchodu k 29.09.2010

pro klienta Conseq státních dluhopisů, OPF, Conseq ISConseq vládních dluhopisů OPF

## Dluhopisy

Instrument ID Emitent	Instrument	Nominální hodnota / ks	Kurz v %	AÚV	Celkem CZK	Váha
AT000B004973 Erste Group Bank AG	ERSTBKfe/13	8 000 000 4 CZK	100,00	7 893,33 CZK	<b>8 007 893,33</b>	2,44%
CZ0001000814 Česká republika	CZgb3.70/13	10 000 000 1 000 CZK	104,72	105 861,11 CZK	<b>10 577 361,11</b>	3,22%
CZ0001001143 Česká republika	CZgb3.80/15	5 000 000 500 CZK	105,63	88 666,67 CZK	<b>5 370 416,67</b>	1,64%
CZ0001001887 Česká republika	CZgb3.55/12	20 000 000 2 000 CZK	103,84	-37 472,22 CZK	<b>20 730 527,78</b>	6,31%
CZ0001002158 Česká republika	CZgb4.10/11	35 000 000 3 500 CZK	101,74	669 666,67 CZK	<b>36 276 916,67</b>	11,05%
CZ0001002331 Česká republika	CZgbf/16	50 000 000 5 000 CZK	99,05	-64 166,67 CZK	<b>49 460 833,33</b>	15,06%
CZ0001002505 Česká republika	CZgbf/12	93 500 000 9 350 CZK	101,87	-83 526,67 CZK	<b>95 164 923,33</b>	28,98%
CZ0001002729 Česká republika	CZgb2.80/13	35 000 000 3 500 CZK	101,92	647 888,89 CZK	<b>36 318 138,89</b>	11,06%
CZ0001002737 Česká republika	CZgb3.40/15	25 000 000 2 500 CZK	103,74	491 111,11 CZK	<b>26 424 861,11</b>	8,05%
CZ0003501058 ČEZ, a. s.	CEZ1f/14	5 000 000 5 CZK	110,00	177 666,67 CZK	<b>5 677 666,67</b>	1,73%
XS0246197452 SNS Bank Nederland NV	SNSfe/11	2 000 000 1 CZK	99,40	1 935,56 CZK	<b>1 989 935,56</b>	0,61%
XS0327362116 Citigroup Funding Inc.	Cfe2/12	5 000 000 50 CZK	97,80	39 477,78 CZK	<b>4 929 477,78</b>	1,50%
XS0473872306 ČEZ, a. s.	CEZfe/12	6 000 000 4 CZK	100,85	35 166,67 CZK	<b>6 086 166,67</b>	1,85%
XS0490323580 General Electric Capital Corp	GE4fe/15	8 000 000 4 CZK	99,95	13 751,11 CZK	<b>8 009 751,11</b>	2,44%
<b>Celkem za dluhopisy</b>					<b>315 024 870,00</b>	<b>95,94%</b>

## Závazky a pohledávky vyplývající z investičních operací

Instrument ID Emitent	Instrument	Splatnost	Nominální hodnota	Dis. sazba	Celkem CZK	Váha
CZ0001001242 Česká republika	CZgb2.55/10 - splátka NH a úr	18.10.2010	7 691 250,00 CZK	0,87%	<b>7 691 250,00</b>	2,34%
CZ0001001887 Česká republika	CZgb3.55/12 - výplata úroku	18.10.2010	1 349 000,00 CZK	0,87%	<b>1 349 000,00</b>	0,41%
CZ0001002505 Česká republika	CZgbf/12 - výplata úroku	11.10.2010	1 273 750,50 CZK	0,87%	<b>1 273 750,50</b>	0,39%
CZ0001002331 Česká republika	CZgbf/16 - výplata úroku	27.10.2010	419 375,00 CZK	0,87%	<b>419 400,00</b>	0,13%
	CZK - Záloha na poplatky		-408 381,22 CZK	0,00%	<b>-408 381,22</b>	-0,12%
<b>Celkem za závazky a pohledávky</b>					<b>10 325 019,28</b>	<b>3,14%</b>

## Peněžní zůstatky

Měna	Zůstatek	Hodnota
CZK	2 998 829,84	<b>2 998 829,84 CZK</b>
<b>Zůstatky celkem</b>		<b>2 998 829,84 CZK</b>

## Souhrn

Typ Instrumentu	Tržní hodnota CZK	Váha
Dluhopisy CZK	315 024 870,00	95,94%
Závazky a pohledávky	10 325 019,28	3,14%
Peněžní zůstatky	2 998 829,84	0,91%
<b>Celková hodnota</b>	<b>328 348 719,12</b>	<b>100,00%</b>