

Ocenění portfolia

dle data uzavření obchodu k 26.10.2010

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 CZK 4	100,00	21 213,33 CZK	8 021 213,33	2,45%
CZ0001000814 Česká republika	CZgb3.70/13	10 000 000 CZK 1 000	104,39	133 611,11 CZK	10 572 611,11	3,23%
CZ0001001143 Česká republika	CZgb3.80/15	5 000 000 CZK 500	104,97	102 916,67 CZK	5 351 166,67	1,63%
CZ0001001887 Česká republika	CZgb3.55/12	20 000 000 CZK 2 000	103,55	15 777,78 CZK	20 725 777,78	6,33%
CZ0001002158 Česká republika	CZgb4.10/11	35 000 000 CZK 3 500	101,44	777 291,67 CZK	36 283 041,67	11,08%
CZ0001002331 Česká republika	CZgbf/16	50 000 000 CZK 5 000	98,94	2 291,67 CZK	49 472 708,33	15,11%
CZ0001002505 Česká republika	CZgbf/12	93 500 000 CZK 9 350	101,67	99 343,75 CZK	95 156 118,75	29,06%
CZ0001002729 Česká republika	CZgb2.80/13	35 000 000 CZK 3 500	101,66	721 388,89 CZK	36 302 388,89	11,09%
CZ0001002737 Česká republika	CZgb3.40/15	25 000 000 CZK 2 500	102,81	554 861,11 CZK	26 258 611,11	8,02%
CZ0003501058 ČEZ, a. s.	CEZ1f/14	5 000 000 CZK 5	110,00	197 166,67 CZK	5 697 166,67	1,74%
XS0246197452 SNS Bank NV	SNSfe/11	2 000 000 CZK 1	99,55	3 945,56 CZK	1 994 945,56	0,61%
XS0327362116 Citigroup Funding Inc.	Cfe2/12	5 000 000 CZK 50	97,80	46 490,28 CZK	4 936 490,28	1,51%
XS0473872306 ČEZ, a. s.	CEZfe/12	6 000 000 CZK 4	100,85	44 661,67 CZK	6 095 661,67	1,86%
XS0490323580 General Electric Capital Corp	GE4fe/15	8 000 000 CZK 4	99,40	28 031,11 CZK	7 980 031,11	2,44%
Celkem za dluhopisy					314 847 932,91	96,16%

Závazky a pohledávky vyplývající z investičních operací

Instrument ID Emitent	Instrument	Splatnost	Nominální hodnota	Dis. sazba	Celkem CZK	Váha
CZ0001002331 Česká republika	CZgbf/16 - výplata úroku	27.10.2010	419 400,00 CZK	0,87%	419 389,86	0,13%
	CZK - Záloha na poplatky		-386 160,70 CZK	0,00%	-386 160,70	-0,12%
	CZK - Depozitum	01.11.2010	12 500 000,00 CZK	0,57%	12 500 000,00	3,82%
Celkem za závazky a pohledávky					12 533 229,16	3,83%

Peněžní zůstatky

Měna	Zůstatek	Hodnota
CZK	54 133,79	54 133,79 CZK
Zůstatky celkem		54 133,79 CZK

Souhrn

Typ Instrumentu	Tržní hodnota CZK	Váha
Dluhopisy CZK	314 847 932,91	96,16%
Závazky a pohledávky	12 533 229,16	3,83%
Peněžní zůstatky	54 133,79	0,02%
Celková hodnota	327 435 295,87	100,00%