

Ocenění portfolia

dle data uzavření obchodu k 30.09.2010
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 4 CZK	99,90	70 473,33 CZK	8 062 473,33	1,38%
CZ0001001887 Česká republika	CZgb3.55/12	55 000 000 5 500 CZK	103,85	-97 625,00 CZK	57 020 150,00	9,74%
CZ0001001903 Česká republika	CZgb4.00/17	10 000 000 1 000 CZK	107,26	187 777,78 CZK	10 913 827,78	1,86%
CZ0001002158 Česká republika	CZgb4.10/11	15 000 000 1 500 CZK	101,66	288 708,33 CZK	15 537 708,33	2,65%
CZ0001002331 Česká republika	CZgbf/16	33 000 000 3 300 CZK	99,06	-40 837,50 CZK	32 649 787,50	5,58%
CZ0001002471 Česká republika	CZgb5.00/19	5 000 000 500 CZK	113,15	117 361,11 CZK	5 774 836,11	0,99%
CZ0001002505 Česká republika	CZgbf/12	101 000 000 10 100 CZK	101,85	-82 707,78 CZK	102 780 742,22	17,56%
CZ0001002729 Česká republika	CZgb2.80/13	23 000 000 2 300 CZK	101,90	427 544,44 CZK	23 864 728,44	4,08%
CZ0001002737 Česká republika	CZgb3.40/15	33 000 000 3 300 CZK	103,71	651 383,33 CZK	34 875 023,33	5,96%
CZ0001500086 Hlavní město Praha	PRAHA1b6,85/11	5 000 000 5 CZK	103,20	128 437,50 CZK	5 288 437,50	0,90%
CZ0003501058 ČEZ, a. s.	CEZ1f/14	8 000 000 8 CZK	110,00	285 422,22 CZK	9 085 422,22	1,55%
CZ0003501462 Severomoravské vodovody a kanalizace	SMVAKb5/15	10 000 000 10 CZK	105,85	437 500,00 CZK	11 022 500,00	1,88%
CZ0003701286 Česká spořitelna, a. s.	CSPOb3.49/12	4 000 000 2 CZK	102,45	72 902,22 CZK	4 170 902,22	0,71%
CZ0003702367 Česká spořitelna, a. s.	CSPOf/13	12 000 000 6 CZK	100,45	-5 220,00 CZK	12 048 780,00	2,06%
XS0230246323 ING Bank N.V., Amsterdam	INGfe2/12	20 000 000 2 CZK	98,90	62 000,00 CZK	19 842 000,00	3,39%
XS0232158708 Lease Plan Finance N.V.	LPLNfe/10	12 000 000 6 CZK	99,90	34 796,67 CZK	12 022 796,67	2,05%
XS0235608873 Merrill Lynch & Co Inc	MERfe/10	16 000 000 8 CZK	99,93	18 933,33 CZK	16 007 733,33	2,73%
XS0244345087 Anglo Irish Bank Corp Ltd.	ANGIRIbe3.13/11	6 000 000 3 CZK	96,00	109 078,36 CZK	5 869 078,36	1,00%
XS0246197452 SNS Bank Nederland NV	SNSfe/11	6 000 000 3 CZK	99,40	6 030,00 CZK	5 970 030,00	1,02%
XS0324973147 UniCredit Bank Ireland PLC	UCGIMfe3/10	5 000 000 50 CZK	100,00	123 059,72 CZK	5 123 059,72	0,88%
XS0327362116 Citigroup Funding Inc.	Cfe2/12	10 000 000 100 CZK	97,80	79 475,00 CZK	9 859 475,00	1,68%
XS0350806351 E.ON International Finance B.V.	EONfe/13	6 000 000 3 CZK	99,95	5 581,67 CZK	6 002 581,67	1,03%
XS0365845485 Vodafone Group Plc	VODfe/13	6 000 000 4 CZK	99,80	8 730,00 CZK	5 996 730,00	1,02%
XS0473872306 ČEZ, a. s.	CEZfe/12	15 000 000 10 CZK	100,85	88 795,83 CZK	15 216 295,83	2,60%
XS0490323580 General Electric Capital Corp	GE4fe/15	14 000 000 7 CZK	99,45	24 990,00 CZK	13 947 990,00	2,38%
XS0504445387 Royal Bank of Scotland PLC	RBSbe3.02/13	7 500 000 5 CZK	99,00	99 408,33 CZK	7 524 408,33	1,29%
XS0536184301 Volkswagen Financial Services NV	VW1fe/13	6 000 000 3 CZK	100,10	7 250,00 CZK	6 013 250,00	1,03%

XS0543083298 Citigroup Funding Inc.	Cfe3/15	4 000 000 2	CZK	100,00	285,56 CZK	4 000 285,56	0,68%
XS0194297502 Slovenske Elektrarne Finance B.V.	ELEKSKbe5.625/11	250 000 250	EUR	103,15	3 775,68 EUR	6 428 143,58	1,10%
XS0206214438 Depfa Bank Plc	HYPINTfe/11	381 730 460	EUR	95,50	256,81 EUR	8 962 501,96	1,53%
XS0211034466 Goldman Sachs Group Inc	GSfe/15	200 000 200	EUR	93,94	442,17 EUR	4 626 442,40	0,79%
XS0214084252 OTP Bank Rt.	OTPfe/15	550 000 11	EUR	78,00	525,80 EUR	10 552 441,37	1,80%
XS0233154912 HSBC Finance Corp	HSBC2fe/12	414 924 5	EUR	96,25	2 046,58 EUR	9 861 724,58	1,68%
XS0260783005 Erste Group Bank AG	ERSTBKfe/17	450 000 9	EUR	92,39	1 136,97 EUR	10 241 604,65	1,75%
XS0282614204 AEGON Global Institutional Markets plc	AGIMbe4.25/12	250 000 250	EUR	102,19	7 277,40 EUR	6 454 964,39	1,10%
XS0307199215 Hungarian Development Bank Ltd.	MAGYARbe4.875/12	350 000 7	EUR	99,53	4 721,40 EUR	8 674 645,98	1,48%
XS0449738987 Croatian Bank for Reconstruction & Deve	CBRDbe7.25/12	200 000 200	EUR	105,60	1 072,60 EUR	5 214 872,86	0,89%
Celkem za dluhopisy						537 508 375,25	91,83%

Směňky

Instrument ID Emitent	Instrument	Nominální hodnota	Kurz v %	Celkem CZK	Váha
CZ0000010 České dráhy, a.s.	CDs1-11/10	13 000 000 CZK	99,63	12 951 862,25	2,21%
Celkem za směňky				12 951 862,25	2,21%

Závazky a pohledávky vyplývající z investičních operací

Instrument ID Emitent	Instrument	Splatnost	Nominální hodnota	Dis. sazba	Celkem CZK	Váha
CZ0003702367 Česká spořitelna, a. s.	CSPOf/13 - výplata úroku	11.10.2010	53 360,00 CZK	0,87%	53 345,82	0,01%
CZ0001001887 Česká republika	CZgb3.55/12 - výplata úroku	18.10.2010	1 952 500,00 CZK	0,87%	1 951 651,03	0,33%
CZ0001002505 Česká republika	CZgbf/12 - výplata úroku	11.10.2010	1 375 956,63 CZK	0,87%	1 375 590,95	0,24%
CZ0001002331 Česká republika	CZgbf/16 - výplata úroku	27.10.2010	276 787,50 CZK	0,87%	276 607,01	0,05%
CZ0003501199 ŠKODA AUTO a.s.	SKODA3f/10 - splátka NH a úr	26.10.2010	20 191 000,00 CZK	0,87%	20 178 321,29	3,45%
XS0213064289 Landsbanki Islands HF	LANISLfe/10 - Pohledávka	03.10.2010	1 520 000,00 CZK	0,00%	1 520 000,00	0,26%
	FX operace	29.10.2010	2 825 000,00 EUR	0,87%	-69 355 017,12	-11,85%
	CZK - Záloha na poplatky	30.09.2010	-1 856 738,09 CZK	0,00%	-1 798 347,70	-0,31%
	CZK - Pohledávka	30.09.2010	91 341,85 CZK	0,00%	91 341,85	0,02%
	FX operace	30.09.2010	-344 983,44 CZK	0,00%	-344 983,44	-0,06%
	FX operace	29.10.2010	69 797 275,00 CZK	0,87%	69 748 393,00	11,92%
Celkem za závazky a pohledávky					23 696 902,70	4,05%

Peněžní zůstatky

Měna	Zůstatek	Hodnota
CZK	11 043 461,23	11 043 461,23 CZK
USD	-562,48	-10 122,19 CZK
EUR	6 637,23	163 061,17 CZK
PLN	1,65	10,20 CZK
Zůstatky celkem		11 196 410,41 CZK

Použité měnové kursy

Měnový kurz	Kurz
CZK/EUR	24,6100
CZK/PLN	6,1760
CZK/USD	18,0250

Souhrn

Typ Instrumentu	Tržní hodnota CZK	Váha
Dluhopisy CZK	466 491 033,47	79,69%
Dluhopisy EUR	71 017 341,78	12,13%
Směnky CZK	12 951 862,25	2,21%
Závazky a pohledávky	23 696 902,70	4,05%
Peněžní zůstatky	11 196 410,41	1,91%
Celková hodnota	585 353 550,60	100,00%