

Výskyt datového souboru

Kód souboru: DOFOS31
Subjekt: 90014269
Ke dni: 30.06.2007
Rozsah: S_BCPZB
Typ: Provozní
Stav: Platný

Cenné papíry - DOFO31_11 - Majetkové CP v majetku fondu

Název cenného papíru	ISIN	Země (stát)	Vztah k legislativě	Investiční limit na majetek fondu	Investiční limit na emitenta či FKl	Celková pořizovací cena	Celková reálná hodnota	Počet jednotek	Celková nominální hodnota	Podíl na majetkových CP vydaných jedním emitentem/FKl
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11
1 Součet (Σ)	Součet (Σ)	Součet (Σ)	Součet (Σ)	Součet (Σ)	Součet (Σ)	1,7	1,8		1,10	
2	2,1	2,2	2,3	2,4	2,5	2,6	2,7	2,8	2,9	2,10

Cenné papíry - DOFO31_12 - Dluhové CP v majetku fondu

Název cenného papíru	ISIN	Země (stát)	Vztah k legislativě	Investiční limit na majetek fondu	Investiční limit na emitenta	Celková pořizovací cena	Celková reálná hodnota	Počet jednotek	Celková nominální hodnota	Podíl na dluhových CP vydaných jedním emitentem
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11
1 Součet (Σ)	Součet (Σ)	Součet (Σ)	Součet (Σ)	Součet (Σ)	Součet (Σ)	1,7	1,8		1,10	
2 ABN AMRO BK NV VAR 09/05/08	XS0218713112	LU	048	055	054	499450	500975	500	500000	0.90
2,1	2,2	2,3	2,4	2,5	2,6	2,7	2,8	2,9	2,10	2,11
3 ALZ 5,75 30/07/07	DE0001940005	DE	048	055	054	284384	302584	10000000	287150	0.91
3,1	3,2	3,3	3,4	3,5	3,6	3,7	3,8	3,9	3,10	3,11
4 AURA Series 20 Class B-1	XS0252851661	IE	050	055	054	431398	431516	430	430000	8.27
4,1	4,2	4,3	4,4	4,5	4,6	4,7	4,8	4,9	4,10	4,11
5 BANCA POP LODI FLOAT 04/10	XS0218063823	IT	048	055	054	300000	301469	300	300000	7.11
5,1	5,2	5,3	5,4	5,5	5,6	5,7	5,8	5,9	5,10	5,11
6 BANQUE PSA FINANCE 5,75 15/04/2008	XS0166175124	FR	048	055	054	486778	498014	500	500000	3.37
6,1	6,2	6,3	6,4	6,5	6,6	6,7	6,8	6,9	6,10	6,11
7 CAISSE CENT CREDIT IMMOB 01/12/11	XS0182740786	FR	048	055	054	417030	410491	400	400000	2.71
7,1	7,2	7,3	7,4	7,5	7,6	7,7	7,8	7,9	7,10	7,11
8 CEZCO 4,125 17/10/13	XS0271020850	CZ	048	055	054	488133	506230	358	513999	0.59
8,1	8,2	8,3	8,4	8,5	8,6	8,7	8,8	8,9	8,10	8,11
9 CIT GROUP INC 4,25 09/22/11	XS0201605192	US	048	055	054	276054	285923	10000	287150	1.33
9,1	9,2	9,3	9,4	9,5	9,6	9,7	9,8	9,9	9,10	9,11
10 CREDIOP VAR 01/09/18	XS0174358332	LU	048	055	054	400000	405593	400000	400000	0.90
10,1	10,2	10,3	10,4	10,5	10,6	10,7	10,8	10,9	10,10	10,11
11 ČEZ 0,00/09	CZ0003501181	CZ	048	055	054	370000	378000	400	400000	0.46
11,1	11,2	11,3	11,4	11,5	11,6	11,7	11,8	11,9	11,10	11,11
12 DEPFA FLOAT 04/08	DE000A0D6Z65	DE	048	055	054	249125	251195	10000	250000	1.50
12,1	12,2	12,3	12,4	12,5	12,6	12,7	12,8	12,9	12,10	12,11
13 DEXGRP 4,75 15/04/2008	XS0166291467	IT	048	055	054	505964	507667	500	500000	1.13
13,1	13,2	13,3	13,4	13,5	13,6	13,7	13,8	13,9	13,10	13,11
14 EIB VAR/18	CZ0000000179	LU	048	055	054	492853	493676	500	500000	0.80
14,1	14,2	14,3	14,4	14,5	14,6	14,7	14,8	14,9	14,10	14,11
15 GS Float 08/17/10	XS0226883832	US	048	055	054	400000	404016	8000	400000	1.31
15,1	15,2	15,3	15,4	15,5	15,6	15,7	15,8	15,9	15,10	15,11
16 LANDSBANKI ISLANDS Float 03/10	XS0213064289	IS	048	055	054	400000	403812	400	400000	8.16
16,1	16,2	16,3	16,4	16,5	16,6	16,7	16,8	16,9	16,10	16,11
17 NIB CAP.BANK FLOAT 10	XS0217267888	LU	048	055	054	411375	433303	150	430725	4.75
17,1	17,2	17,3	17,4	17,5	17,6	17,7	17,8	17,9	17,10	17,11
18 OTP BANK PLC 5,27 19/09/16	XS0268320800	HU	048	055	054	222904	233764	80	229720	1.93
18,1	18,2	18,3	18,4	18,5	18,6	18,7	18,8	18,9	18,10	18,11
19 SNSBANK VAR/11	XS0164397977	NL	048	055	054	569823	560453	550	550000	5.43
19,1	19,2	19,3	19,4	19,5	19,6	19,7	19,8	19,9	19,10	19,11
20 SOCGEN 4,4 01/28/08	XS0161315121	FR	048	055	054	303962	307630	300	300000	1.68
20,1	20,2	20,3	20,4	20,5	20,6	20,7	20,8	20,9	20,10	20,11
21 SOGE VAR 30/06/15	XS0223562249	FR	048	055	054	649675	649735	130	650000	4.53
21,1	21,2	21,3	21,4	21,5	21,6	21,7	21,8	21,9	21,10	21,11
22 ST. DLUHOP. 2,30/08	CZ0001001309	CZ	048	058	054	795084	801844	80000	800000	0.21
22,1	22,2	22,3	22,4	22,5	22,6	22,7	22,8	22,9	22,10	22,11
23 ST. DLUHOP. 2,55/10	CZ0001001242	CZ	048	058	054	391240	388580	40000	400000	0.10
23,1	23,2	23,3	23,4	23,5	23,6	23,7	23,8	23,9	23,10	23,11
24 ST. DLUHOP. 3,80/15	CZ0001001143	CZ	048	058	054	400960	386096	40000	400000	0.10
24,1	24,2	24,3	24,4	24,5	24,6	24,7	24,8	24,9	24,10	24,11
25 ŠKODA AUTO VAR/07	CZ0003501181	CZ	048	055	054	315615	316942	3153	315300	6.31
25,1	25,2	25,3	25,4	25,5	25,6	25,7	25,8	25,9	25,10	25,11
26 TELEFONICA EMISIONES VAR 19/06/10	XS0305573957	ES	048	055	054	500000	499722	250	500000	0.98
26,1	26,2	26,3	26,4	26,5	26,6	26,7	26,8	26,9	26,10	26,11
27 VEOLIA ENVRNMT VAR 04/10	XS0167345437	FR	048	055	054	600080	602058	5900	590000	0.34
27,1	27,2	27,3	27,4	27,5	27,6	27,7	27,8	27,9	27,10	27,11
28 VOLVO TREASURY NORT VAR 06/15/08	XS0169285698	SE	048	055	054	753522	749001	750	750000	8.01
28,1	28,2	28,3	28,4	28,5	28,6	28,7	28,8	28,9	28,10	28,11
29 20308503 SPP 39T 6 mld 03/11	CZ0001001762	CZ	048	058	054	1280177	1296606	1300	1300000	1.86
29,1	29,2	29,3	29,4	29,5	29,6	29,7	29,8	29,9	29,10	29,11
30 21008512 SPP 26T 5 mld 09/02	CZ0001001861	CZ	048	058	054	789719	797466	800	800000	1.14
30,1	30,2	30,3	30,4	30,5	30,6	30,7	30,8	30,9	30,10	30,11
31 21104517 SPP 52T 5mld 13/04	CZ0001001960	CZ	048	058	054	243177	243532	250	250000	0.36
31,1	31,2	31,3	31,4	31,5	31,6	31,7	31,8	31,9	31,10	31,11
32 21210502 SPP 52T 6 mld 13/10	CZ0001001739	CZ	048	058	054	587587	594914	600	600000	0.86
32,1	32,2	32,3	32,4	32,5	32,6	32,7	32,8	32,9	32,10	32,11
33 21307494 SPP 52T 5 mld 14/07	CZ0001001655	CZ	048	058	054	591803	599409	600	600000	0.86
33,1	33,2	33,3	33,4	33,5	33,6	33,7	33,8	33,9	33,10	33,11
34 21409508 SPP 39T 6 mld 15/12	CZ0001001820	CZ	048	058	054	294454	298185	300	300000	0.43
34,1	34,2	34,3	34,4	34,5	34,6	34,7	34,8	34,9	34,10	34,11
35 21801511 SPP 52T 6 mld 19/01	CZ0001001853	CZ	048	058	054	4861625	491276	500	500000	0.71
35,1	35,2	35,3	35,4	35,5	35,6	35,7	35,8	35,9	35,10	35,11
36 22112514 SPP 39T 5 mld 23/03	CZ0001001929	CZ	048	058	054	283359	284728	289	289000	0.41
36,1	36,2	36,3	36,4	36,5	36,6	36,7	36,8	36,9	36,10	36,11
37 22709515 SPP 181D 5 mld 30/03	CZ0001001937	CZ	048	058	054	888673	893544	900	900000	1.29
37,1	37,2	37,3	37,4	37,5	37,6	37,7	37,8	37,9	37,10	37,11
38 23005519 SPP 52T 5 mld 01/06	CZ0001001986	CZ	048	058	054	290754	290763	300	300000	0.43
38,1	38,2	38,3	38,4	38,5	38,6	38,7	38,8	38,9	38,10	38,11
39 23108498 SPP 52T 5 mld 01/09	CZ0001001697	CZ	048	058	054	589561	597076	600	600000	0.86
39,1	39,2	39,3	39,4	39,5	39,6	39,7	39,8	39,9	39,10	39,11

Finanční deriváty - DOFO31_21 - Burzovní finanční deriváty v majetku fondu

Název burzovního finančního derivátu		ISIN	Celková reálná hodnota burzovního finančního derivátu
1		2	3
1	Součet (Σ)	Součet (Σ)	1.3
2	2.1	2.2	2.3

Finanční deriváty - DOFO31_22 - Mimoburzovní finanční deriváty v majetku fondu

Název mimoburzovního finančního derivátu		Název protistrany mimoburzovního finančního derivátu	IČO protistrany mimoburzovního finančního derivátu	Podkladové aktivum mimoburzovních finančních derivátů	Celková reálná hodnota mimoburzovního finančního derivátu	Riziko spojené s druhou smluvní stranou finančního derivátu
1		2	3	4	5	6
1	Součet (Σ)	Součet (Σ)	Součet (Σ)	Součet (Σ)	1.5	
2	měnovο-úrokový swap	KB	45317054	20	53005	2.6
	2.1	2.2	2.3	2.4	2.5	
3	měnový swap	ING	25629123	22	1973	3.6
	3.1	3.2	3.3	3.4	3.5	
4	úrokový swap	ČSOB	00001350	20	35494	4.6
	4.1	4.2	4.3	4.4	4.5	

Kvalita investičních nástrojů - DOFO31_31 - Struktura investičních nástrojů podle hodnocení kvality IN

	1
Rating 1. stupně	13856615
	1.1
Rating 2. stupně	3201788
	2.1
Rating 3. stupně	3248892
	3.1
Rating 4. stupně	4.1
Bez ratingu	50034
	5.1