

REÁLNÉ A JMENOVITÉ HODNOTY DERIVÁTŮ
Deriváty sjednané za účelem měnového zajištění k 30.6.2016

ISIN	Název	Měna	Ks v cizí měně	Ks v CZK	Účetní hodnota
FX0000090635	SWP2 EUR/CZK 27.02 25/08/2016	EUR	3 170 000	85 653 400	-424 757
FX0000090637	SWP2 USD/CZK 23.78 21/07/2016	USD	1 700 000	40 426 000	-1 105 533
FX0000091178	SWP2 EUR/CZK 27.05 09/09/2016	EUR	200 000	5 410 000	-22 835
FX0000091441	SWP2 EUR/CZK 27.03 11/10/2016	EUR	400 000	10 812 000	-56 986
FX0000091567	FWD EUR/CZK 27.08 25/08/2016	EUR	50 000	1 354 000	-3 685
FX0000091651	SWP2 USD/CZK 24.19 27/09/2016	USD	200 000	4 838 000	-44 554
CELKEM				148 493 400	-1 658 349

Deriváty sjednané za účelem měnového zajištění k 31.3.2016

ISIN	Název	Měna	Ks v cizí měně	Ks v CZK	Účetní hodnota
FX0000089176	SWP2 EUR/CZK 27.01 21/04/2016	EUR	3 150 000	85 081 500	-159 000
FX0000089184	SWP2 USD/CZK 24.89 21/04/2016	USD	1 710 000	42 561 900	1 940 000
FX0000089852	SWP2 EUR/CZK 27.03 25/05/2016	EUR	230 000	6 216 900	-10 000
FX0000089999	SWP2 EUR/CZK 27.05 09/06/2016	EUR	400 000	10 820 000	-13 000
CELKEM				144 680 300	1 758 000

Deriváty sjednané za účelem měnového zajištění k 31.12.2015

ISIN	Název	Měna	Ks v cizí měně	Ks v CZK	Účetní hodnota
FX0000088537	SWP2 USD/CZK 25.49 21/01/2016	USD	1 865 000	47 538 850	1 256 000
FX0000088539	SWP2 EUR/CZK 26.99 21/01/2016	EUR	3 145 000	84 883 550	-127 000
CELKEM				132 422 400	1 129 000

Deriváty sjednané za účelem měnového zajištění k 30.9.2015

ISIN	Název	Měna	Ks v cizí měně	Ks v CZK	Účetní hodnota
FX0000086659	SWP2 EUR/CZK 27.01 05/10/2015	EUR	2 380 000	64 283 800	-410 000
FX0000086661	SWP2 USD/CZK 23.94 05/10/2015	USD	1 890 000	45 246 600	-623 000
FX0000086971	SWP2 EUR/CZK 27.1 05/10/2015	EUR	300 000	8 130 000	23 000
FX0000087132	SWP2 EUR/CZK 27.14 05/10/2015	EUR	200 000	5 428 000	-8 000
CELKEM				123 088 400	-1 018 000

Deriváty sjednané za účelem měnového zajištění k 30.6.2015

ISIN	Název	Měna	Ks v cizí měně	Ks v CZK	Účetní hodnota
FX0000084698	SWP2 EUR/CZK 27.44 09/07/2015	EUR	2 660 000	72 990 400	510 000
FX0000084700	SWP2 USD/CZK 25.03 09/07/2015	USD	2 020 000	50 560 600	1 388 000
FX0000085164	SWP2 EUR/CZK 27.22 09/07/2015	EUR	120 000	3 266 400	3 000
CELKEM				126 817 400	1 901 000