



|                                                  |                                                     |
|--------------------------------------------------|-----------------------------------------------------|
| Jméno fondu<br>Fund name                         | <b>2. dluhopisový zajištěný OPF GICEE, IS, a.s.</b> |
| Skladba portfolia k<br>Portfolio structure as of | <b>31.5.2017</b>                                    |

| Název investičního nástroje<br>Investment instrument name | ISIN         | Měna<br>Currency | Tržní hodnota v měně fondu<br>Market value in fund currency |
|-----------------------------------------------------------|--------------|------------------|-------------------------------------------------------------|
| VIMPELCOM 9.125 30/4/2018                                 | XS0361041808 | CZK              | 25 359 829,06                                               |
| NOMOS CAP 7.25 25/4/2018 B                                | XS0923110232 | CZK              | 25 171 776,32                                               |
| RUSSIAN AG BANK 7.75 29/5/2018                            | XS0366630902 | CZK              | 24 845 043,77                                               |
| VTB CAPITAL SA 6.875 29/5/18 P13                          | XS0365923977 | CZK              | 23 395 703,51                                               |
| ROSNEFT FINANCE 7.875 13/3/2018                           | XS0324963932 | CZK              | 18 468 589,22                                               |
| SEVERSTAL 4.45 19/03/2018                                 | XS0899969702 | CZK              | 6 779 443,47                                                |
| Ostatní aktiva / Other assets                             |              | CZK              | 23 967 056,77                                               |
| <b>Celková hodnota / Total value</b>                      |              | <b>CZK</b>       | <b>147 987 442,12</b>                                       |