

SLOVENSKÁ DLHOPISOVÁ SKUPINA INDEXOV K 30.09. 2004
Slovak Bond Indices Group as of September 30, 2004

Kód indexu	Sektor	Subsektor	Názov indexu/subindexu	Cenový	Vývojový	Výnos do splatnosti	Kupónový výnos	Durácia	Zostatková splatnosť	Mod. durácia	Konvexita	Počet emisií
Index code	Sector	Sub-sector	Index/sub-index name	Price	Performance	YTM	Coupon yield	Duration	Residual maturity	Mod. duration	Convexity	Number of issues
100	Verejný	štátny	SDXG Celkový/Overall	102,5524%	106,1559%	4,717%	4,427%	4,8478	5,8106	4,6295	36,0331	15
101	Verejný	štátny	SDXG (<=5)	102,7266%	105,8773%	4,212%	3,164%	2,7404	2,8818	2,6296	10,2216	6
102	Verejný	štátny	SDXG (> 5)	102,3540%	106,4043%	4,909%	5,709%	6,8358	8,7823	6,5160	60,3820	9
200	Súkromný	súkromný	SDXG Celkový/Overall	100,7240%	105,6686%	4,762%	6,492%	3,4974	4,0764	3,3486	19,1534	12
201	Súkromný	súkromný	SDXG (<=5)	100,7286%	105,8470%	4,593%	6,887%	2,5371	2,7998	2,4387	8,8383	10
202	Súkromný	súkromný	SDXG (> 5)	101,1835%	103,9366%	4,985%	5,117%	6,9644	8,5231	6,6337	56,3940	2
210	Súkromný	podnikový	SDXG Celkový/Overall	100,2564%	106,3496%	5,663%	7,463%	2,3011	2,6509	2,2068	7,5135	5
211	Súkromný	podnikový	SDXG (<=5)	100,2564%	106,3496%	5,663%	7,463%	2,3011	2,6509	2,2068	7,5135	5
220	Súkromný	HZL	SDXG Celkový/Overall	100,9154%	105,3974%	4,625%	6,243%	3,7978	4,4427	3,6353	22,0765	7
221	Súkromný	HZL	SDXG (<=5)	100,9673%	105,6110%	4,268%	6,682%	2,6184	2,8529	2,5186	9,2948	5
222	Súkromný	HZL	SDXG (> 5)	101,1835%	103,9366%	4,985%	5,117%	6,9644	8,5231	6,6337	56,3940	2

SLOVENSKÁ DLHOPISOVÁ SKUPINA INDEXOV K 30.09. 2004
Slovak Bond Indices Group as of September 30, 2004

Názov emisie	Sektor	Subsektor	Subindex	Veľkosť emisie v mil. Sk	Kupónový výnos	AÚV	Zostatková splatnosť	Kurz	Dátum kurzu	Výnos do splatnosti	Durácia	sub-index	Váha	sub-sector	sector
Name of issue	Sector	Sub-sector	Sub-index	Volume of issue in SKKm	Coupon yield	Accrued interest rate	Residual maturity	Price	Date of price	YTM	Duration	sub-index	Weight	sub-sector	sector
Štátny dlhopis 134	Verejný	štátny	SDXG (<=5)	2 430,00	8,000%	0,3111%	2,961	110,6190%	30.9.2004	4,116%	2,756	3,143%	1,583%	1,583%	
Štátny dlhopis 166	Verejný	štátny	SDXG (<=5)	7 000,00	7,800%	5,6117%	2,281	108,2650%	14.9.2004	3,988%	2,080	9,053%	4,560%	4,560%	
Štátny dlhopis 170	Verejný	štátny	SDXG (<=5)	4 870,00	7,650%	4,9300%	2,356	108,1400%	30.9.2004	3,948%	2,158	6,299%	3,172%	3,172%	
Štátny dlhopis 191	Verejný	štátny	SDXG (<=5)	15 000,00	4,950%	2,8875%	3,417	102,2380%	30.9.2004	4,225%	3,146	19,400%	9,771%	9,771%	
Štátny dlhopis 200	Verejný	štátny	SDXG (<=5)	35 710,00	0,000%	0,0000%	2,275	91,2600%	30.9.2004	4,102%	2,275	46,185%	23,260%	23,260%	
Štátny dlhopis 203	Verejný	štátny	SDXG (<=5)	12 309,00	4,800%	2,2800%	4,525	101,1780%	30.9.2004	4,500%	4,091	15,920%	8,018%	8,018%	
Štátny dlhopis 133	Verejný	štátny	SDXG (> 5)	7 120,00	8,500%	1,1333%	5,867	119,6170%	30.9.2004	4,604%	4,909	9,343%	4,638%	4,638%	
Štátny dlhopis 163	Verejný	štátny	SDXG (> 5)	2 160,00	8,300%	0,3689%	6,956	120,3680%	30.9.2004	4,787%	5,675	2,835%	1,407%	1,407%	
Štátny dlhopis 174	Verejný	štátny	SDXG (> 5)	8 310,00	7,500%	4,2083%	7,439	116,2760%	30.9.2004	4,836%	5,880	10,905%	5,413%	5,413%	
Štátny dlhopis 188	Verejný	štátny	SDXG (> 5)	15 000,00	5,000%	3,5139%	8,297	101,0000%	30.9.2004	4,847%	6,770	19,684%	9,771%	9,771%	
Štátny dlhopis 189	Verejný	štátny	SDXG (> 5)	15 000,00	4,900%	3,2667%	5,333	101,6020%	30.9.2004	4,550%	4,682	19,684%	9,771%	9,771%	
Štátny dlhopis 192	Verejný	štátny	SDXG (> 5)	1 060,00	5,100%	2,6775%	8,475	101,3560%	30.9.2004	4,896%	6,925	1,391%	0,690%	0,690%	
Štátny dlhopis 199	Verejný	štátny	SDXG (> 5)	6 784,00	4,750%	1,2271%	8,742	98,1930%	30.9.2004	5,007%	7,255	8,902%	4,419%	4,419%	
Štátny dlhopis 202	Verejný	štátny	SDXG (> 5)	12 839,00	4,900%	3,1850%	9,350	98,7690%	30.9.2004	5,065%	7,476	6,350%	3,152%	3,152%	
Štátny dlhopis 204	Verejný	štátny	SDXG (> 5)	15 932,00	5,300%	2,1053%	14,603	101,4680%	30.9.2004	5,151%	10,350	20,907%	10,378%	10,378%	
B.O.F. 05	Súkromný	podnikový	SDXG (<=5)	225,00	7,000%	1,2444%	2,822	101,6000%	30.9.2004	6,019%	1,743	16,364%	16,364%	3,346%	
I.D.C. Holding IV	Súkromný	podnikový	SDXG (<=5)	350,00	6,330%	-0,1758%	4,028	103,2800%	28.9.2004	5,406%	3,691	25,455%	25,455%	5,205%	
MATADOR 03	Súkromný	podnikový	SDXG (<=5)	250,00	6,620%	2,0779%	1,686	101,9300%	30.9.2004	5,401%	1,593	18,182%	18,182%	3,718%	
MATADOR 04	Súkromný	podnikový	SDXG (<=5)	300,00	6,720%	2,1093%	2,686	102,6150%	16.6.2004	5,750%	2,456	21,818%	21,818%	4,461%	
PALMA-TUMYS 3	Súkromný	podnikový	SDXG (<=5)	250,00	11,200%	0,0933%	1,492	106,9300%	28.9.2004	6,295%	1,416	18,182%	18,182%	3,718%	
HZL ISTROBANKA I	Súkromný	HZL	SDXG (<=5)	500,00	7,500%	3,5417%	2,528	108,2220%	30.9.2004	4,000%	2,333	12,987%	9,346%	7,435%	
HZL SPO 01	Súkromný	HZL	SDXG (<=5)	1 000,00	7,400%	1,9117%	2,742	108,4200%	15.7.2004	4,298%	2,548	25,974%	18,692%	14,870%	
HZL SPO 04	Súkromný	HZL	SDXG (<=5)	1 000,00	4,600%	-0,1278%	4,028	100,0000%	21.9.2004	4,602%	3,772	25,974%	18,692%	14,870%	
HZL Tatra banka 01	Súkromný	HZL	SDXG (<=5)	600,00	7,500%	6,0625%	2,192	107,2500%	30.9.2004	3,970%	1,997	15,584%	11,215%	8,922%	
HZL VÚB VI.	Súkromný	HZL	SDXG (<=5)	750,00	7,300%	2,3319%	2,181	107,0000%	30.9.2004	3,916%	2,018	19,481%	14,019%	11,152%	
HZL ISTROBANKA II	Súkromný	HZL	SDXG (> 5)	500,00	5,150%	2,5035%	8,514	100,9710%	3.8.2004	5,005%	6,947	33,333%	9,346%	7,435%	
HZL VÚB VII.	Súkromný	HZL	SDXG (> 5)	1 000,00	5,100%	2,4083%	8,528	100,8210%	29.9.2004	4,975%	6,973	66,667%	18,692%	14,870%	