

# Ocenění portfolia

dle data vypořádání obchodu k 31.01.2014  
pro klienta CONSEQ INVEST dluhopisový fond

účet vlastníka: CSQ\_BOND

se sídlem First Floor, Fitzwilton House, Wilton Place, Dublin 2

IČO/RČ: 8080066467

## Dluhopisy

Instrument ID Emitent	Instrument	Nominální hodnota / ks	Kurz v %	AÚV	Celkem CZK	Váha
AT0000492996 Atrium European Real Estate Ltd.	MEL2fe/15	14 000 000 7 CZK	98,00	114 858,33 CZK	<b>13 834 858,33</b>	0,91%
CZ000000280 Home Credit, a.s.	HCb6.25/16	21 000 000 7 CZK	107,50	794 791,67 CZK	<b>23 369 791,67</b>	1,54%
CZ0001001317 Česká republika	CZgb3.75/20	41 000 000 4 100 CZK	112,96	589 375,00 CZK	<b>46 904 000,00</b>	3,09%
CZ0001001796 Česká republika	CZgb4.20/36	15 000 000 1 500 CZK	113,49	98 000,00 CZK	<b>17 122 250,00</b>	1,13%
CZ0001001903 Česká republika	CZgb4.00/17	16 000 000 1 600 CZK	110,63	513 777,78 CZK	<b>18 215 377,78</b>	1,20%
CZ0001001945 Česká republika	CZgb4.70/22	69 500 000 6 950 CZK	120,25	1 252 158,33 CZK	<b>84 825 908,33</b>	5,59%
CZ0001002331 Česká republika	CZgbf/16	128 000 000 12 800 CZK	100,33	191 146,67 CZK	<b>128 611 626,67</b>	8,48%
CZ0001002471 Česká republika	CZgb5.00/19	49 000 000 4 900 CZK	119,20	1 966 805,56 CZK	<b>60 376 030,56</b>	3,98%
CZ0001002851 Česká republika	CZgb3.85/21	42 000 000 4 200 CZK	113,34	543 491,67 CZK	<b>48 145 241,67</b>	3,17%
CZ0001003123 Česká republika	CZgbf/23	45 000 000 4 500 CZK	104,79	507 600,00 CZK	<b>47 665 125,00</b>	3,14%
CZ0001003438 Česká republika	CZGBf/17	140 000 000 14 000 CZK	103,36	41 066,67 CZK	<b>144 744 366,67</b>	9,54%
CZ0001003834 Česká republika	CZgb1.5/19	40 000 000 4 000 CZK	100,32	151 666,67 CZK	<b>40 280 666,67</b>	2,66%
CZ0001003859 Česká republika	CZgb2.5/28	31 000 000 3 100 CZK	94,53	333 680,56 CZK	<b>29 637 980,56</b>	1,95%
CZ0001500110 Hlavní město Praha	PRAHAb4.25/21	93 000 000 93 CZK	113,00	2 843 604,17 CZK	<b>107 933 604,17</b>	7,12%
CZ0003501462 Severomoravské vodovody a kanalizace	SMVAKb5/15	25 000 000 25 CZK	104,80	260 416,67 CZK	<b>26 460 416,67</b>	1,74%
CZ0003501884 Český Aeroholding, a.s.	AEROHDb3.9/17	20 000 000 20 000 000 CZK	103,80	611 000,00 CZK	<b>21 371 000,00</b>	1,41%
CZ0003502155 Český Aeroholding, a.s.	AEROHDb2.7/14	7 000 000 7 000 000 CZK	101,05	57 750,00 CZK	<b>7 131 250,00</b>	0,47%
CZ0003510646 Czech Property Investments a. s.	CPIb6.05/16	27 000 000 2 700 CZK	99,00	549 037,50 CZK	<b>27 279 037,50</b>	1,80%
CZ0003511008 Český Aeroholding, a.s.	AEROHDb0/15	15 000 000 150 CZK	96,30	0,00 CZK	<b>14 445 000,00</b>	0,95%
XS0219645222 KBC IFIMA NV	KBCbe3.87/16	6 000 000 600 CZK	103,50	164 130,41 CZK	<b>6 374 130,41</b>	0,42%
XS0245704449 NIBC Bank NV	NIBCfe/16	5 000 000 1 CZK	93,90	9 348,61 CZK	<b>4 704 348,61</b>	0,31%
XS0259125945 SNS Bank Nederland NV	SNSbe4.05/14	24 000 000 24 CZK	101,35	545 917,81 CZK	<b>24 869 917,81</b>	1,64%
XS0305574682 Telefónica Emisiones SAU	TELEFObe4.623/14	12 000 000 6 CZK	101,75	343 495,23 CZK	<b>12 553 495,23</b>	0,83%
XS0490323580 General Electric Capital Corp	GE4fe/15	12 000 000 6 CZK	100,55	71 500,00 CZK	<b>12 137 500,00</b>	0,80%
XS0543083298 Citigroup Inc	Cfe3/15	30 000 000 15 CZK	101,55	45 866,67 CZK	<b>30 510 866,67</b>	2,01%
XS0620780147 LeasePlan Corporation N.V.	LPLNfe/14	10 000 000 5 CZK	100,32	1 475,00 CZK	<b>10 033 475,00</b>	0,66%
XS0761852556 Telefónica Emisiones SAU	TELEFObe3.934/17	10 000 000 2 CZK	106,90	330 887,12 CZK	<b>11 020 887,12</b>	0,73%

XS0766345481 RCI Banque SA	RENAULfe/15	6 000 000 3	CZK	101,50	9 708,33 CZK	<b>6 099 708,33</b>	0,40%
XS0860033769 ING Bank N.V., Amsterdam	ING5fe/14	15 000 000 300	CZK	100,07	18 112,50 CZK	<b>15 028 612,50</b>	0,99%
XS0860033843 ING Bank N.V., Amsterdam	ING6fe/17	7 000 000 140	CZK	100,70	14 822,50 CZK	<b>7 063 822,50</b>	0,47%
XS0880210702 Crédit Agricole CIB	CACIBfe/18	19 000 000 19	CZK	101,45	69 160,00 CZK	<b>19 344 660,00</b>	1,28%
XS0884604728 General Electric Capital Corp	GE6fe/18	16 000 000 8	CZK	99,40	34 413,33 CZK	<b>15 938 413,33</b>	1,05%
XS0885329614 LeasePlan Corporation N.V.	LPLNfe/18	20 000 000 10	CZK	101,65	82 650,00 CZK	<b>20 412 650,00</b>	1,35%
AT0000496633 Atrium European Real Estate Ltd.	MEL1fe/17	500 000 10	EUR	100,50	9 722,22 EUR	<b>14 120 429,49</b>	0,93%
AT0000A0ZZD8 Slovenska Izvozná Razvojna Banka, d.d.	SEDABife/16	1 400 000 14	EUR	99,31	16 918,65 EUR	<b>38 794 090,77</b>	2,56%
HU0000402664 Maďarsko	REPUNfi/16	1 200 000 1 200 000	EUR	100,25	7 995,58 EUR	<b>33 383 513,95</b>	2,20%
XS0214084252 OTP Bank Rt.	OTPfe/15	1 000 000 20	EUR	97,25	1 266,33 EUR	<b>26 843 126,36</b>	1,77%
XS0260783005 Erste Group Bank AG	ERSTBKfe/17	1 750 000 35	EUR	98,09	641,67 EUR	<b>47 340 922,25</b>	3,12%
XS0503453275 MOL Hungarian Oil and Gas Company	MOLHBbe5.875/17	400 000 400	EUR	107,15	18 413,70 EUR	<b>12 322 550,51</b>	0,81%
XS0504814509 New World Resources Plc	NWRbe7.875/18	750 000 750	EUR	57,52	14 601,56 EUR	<b>12 294 097,62</b>	0,81%
XS0626282783 BOS Finance AB	BOSPWbe6/16	100 000 100	EUR	109,49	4 356,16 EUR	<b>3 138 355,75</b>	0,21%
XS0750894577 Česká republika	CZECHbe3.875/22	1 400 000 1 400	EUR	111,71	37 454,79 EUR	<b>44 145 455,73</b>	2,91%
XS0877986231 New World Resources Plc	NWRbe7.875/21	400 000 400	EUR	17,49	1 312,50 EUR	<b>1 965 099,74</b>	0,13%
PL0000102646 Polsko	PLGb5.75-09/22	1 000 000 1 000	PLN	107,39	20 480,00 PLN	<b>7 096 924,07</b>	0,47%
PL0000104543 Polsko	PLGb5.25-10/17	2 600 000 2 600	PLN	104,66	36 660,00 PLN	<b>17 883 291,48</b>	1,18%
PL0000105359 Polská republika	PLGb2.75-08/23	1 650 000 1 650	PLN	120,66	22 918,87 PLN	<b>13 059 124,83</b>	0,86%
PL0000105441 Polsko	PLGb5.5-10/19	2 999 000 2 999	PLN	105,97	44 295,23 PLN	<b>20 897 434,86</b>	1,38%
PL0000107264 Polská republika	PLGb4-10/23	3 450 000 3 450	PLN	94,49	37 053,00 PLN	<b>21 379 820,97</b>	1,41%
TRSCKB11511 Bank Pozitif Ve Kalkinma Ban	BNKPOZb10.4/15	500 000 500	TRY	99,83	4 131,51 TRY	<b>4 550 202,77</b>	0,30%
TRSCRSIA1516 Boyner Büyük Magazacilik A.S.	BOYNRF/15	1 500 000 1 500	TRY	100,70	4 264,11 TRY	<b>13 695 766,96</b>	0,90%
TRSERGL31517 Eregli Demir ve Çelik Fabrikalari T.A.S.	EREGLTf/15	700 000 7 000	TRY	100,05	29 131,55 TRY	<b>6 595 620,59</b>	0,43%
TRSMCBF71511 Mercedes-Benz Finansman Turk A.S.	DAIGRb10.03/15	1 250 000 1 250 000	TRY	96,20	4 808,90 TRY	<b>10 915 905,19</b>	0,72%
TRSPKPB61517 Pakpen Plastik Boru ve Yapı	PAKPENf/15	500 000 500 000	TRY	98,90	10 312,88 TRY	<b>4 564 274,71</b>	0,30%
TRSRNSHA1514 Rönesans Holding A.S.	RONHOLf/15	800 000 800	TRY	98,45	2 895,56 TRY	<b>7 147 279,85</b>	0,47%
TRSTPFCK1419 Creditwest Faktoring Hizmetleri A.S.	CRDFafe/14	1 300 000 1 300	TRY	100,10	2 939,42 TRY	<b>11 792 304,23</b>	0,78%
XS0994815016 Yapı ve Kredi Bankası	YAPibe5.25/18	1 000 000 1 000	USD	95,39	8 312,50 USD	<b>19 668 686,95</b>	1,30%

**Celkem za dluhopisy**

**1 498 040 299,36** 98,75%

## Závazky a pohledávky vyplývající z investičních operací

Instrument ID Emitent	Instrument	Splatnost	Nominální hodnota	Dis. sazba	Celkem CZK	Váha
CZ0000000211 ECM Real Estate Investments AG	ECMf/12 - Pohledávka	31.01.2014	3 450 000,00 CZK	0,00%	<b>3 450 000,00</b>	0,23%
CZ0001500110 Hlavní město Praha	PRAHAb4.25/21 - Prodej	28.02.2014	77 320 281,80 CZK	0,27%	<b>-9 738 955,80</b>	-0,64%
TRSTISB21511 Türkiye Is Bankasi A.S.	ISBANK0 02/15 - Nákup	04.02.2014	806 256,00 TRY	0,50%	<b>8 492,61</b>	0,00%
	FX operace	31.01.2014	-19 317 694,17 CZK	0,00%	<b>-19 317 694,17</b>	-1,27%
	FX operace	03.02.2014	115 000,00 USD	0,10%	<b>2 350 805,59</b>	0,15%
	FX operace	21.02.2014	12 372 000,00 EUR	0,21%	<b>-341 016 291,70</b>	-22,48%
	FX operace	21.02.2014	2 100 000,00 TRY	0,66%	<b>-18 869 817,83</b>	-1,24%
	FX operace	21.02.2014	200 000,00 EUR	0,21%	<b>-5 512 710,83</b>	-0,36%
	CZK - Záloha na poplatky	31.01.2014	-3 963 370,41 CZK	0,00%	<b>-3 963 370,41</b>	-0,26%
	CZK - Pohledávka	31.01.2014	51 200 805,12 CZK	0,00%	<b>51 200 805,12</b>	3,38%
	FX operace	21.02.2014	338 730 513,60 CZK	0,22%	<b>338 687 419,15</b>	22,33%
	FX operace	21.02.2014	5 473 072,00 CZK	0,22%	<b>5 472 375,70</b>	0,36%
	FX operace	21.02.2014	19 205 606,70 CZK	0,22%	<b>19 203 163,30</b>	1,27%
	FX operace	03.02.2014	2 349 714,50 CZK	0,16%	<b>-2 349 683,82</b>	-0,15%
<b>Celkem za závazky a pohledávky</b>					<b>19 604 536,92</b>	<b>1,29%</b>

### Peněžní zůstatky

Měna	Zůstatek	Hodnota
CZK	-3 777 419,19	<b>-3 777 419,19 CZK</b>
USD	98 345,82	<b>2 010 380,83 CZK</b>
EUR	6 420,09	<b>176 982,61 CZK</b>
PLN	434,54	<b>2 817,94 CZK</b>
HUF	21 000,62	<b>1 854,48 CZK</b>
TRY	99 774,46	<b>902 112,58 CZK</b>
RON	61,82	<b>378,61 CZK</b>
<b>Zůstatky celkem</b>		<b>-682 892,14 CZK</b>

### Použité měnové kursy

Měnový kurz	Kurz
CZK/EUR	27,5670
CZK/HUF	0,0883
CZK/PLN	6,4849
CZK/RON	6,1244
CZK/TRY	9,0415
CZK/USD	20,4420

### Souhrn

Typ Instrumentu	Tržní hodnota CZK	Váha
Dluhopisy CZK	1 104 446 019,74	72,81%
Dluhopisy EUR	234 347 642,16	15,45%
Dluhopisy PLN	80 316 596,21	5,29%
Dluhopisy TRY	59 261 354,30	3,91%
Dluhopisy USD	19 668 686,95	1,30%
Závazky a pohledávky	19 604 536,92	1,29%
Peněžní zůstatky	-682 892,14	-0,05%
<b>Celková hodnota</b>	<b>1 516 961 944,14</b>	<b>100,00%</b>