

Ocenění portfolia

dle data vypořádání obchodu k 28.03.2013
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	18 000 000 9 CZK	94,50	34 770,00 CZK	17 044 770,00	1,20%
CZ000000260 Home Credit, a.s.	HCb6.25/16	18 000 000 6 CZK	106,00	862 500,00 CZK	19 942 500,00	1,40%
CZ0001000822 Česká republika	CZgb4.60/18	18 000 000 1 800 CZK	117,75	506 000,00 CZK	21 701 450,00	1,53%
CZ0001001317 Česká republika	CZgb3.75/20	64 000 000 6 400 CZK	114,80	1 306 666,67 CZK	74 780 266,67	5,26%
CZ0001001796 Česká republika	CZgb4.20/36	22 500 000 2 250 CZK	119,45	299 250,00 CZK	27 176 062,50	1,91%
CZ0001001903 Česká republika	CZgb4.00/17	16 000 000 1 600 CZK	112,30	-23 111,11 CZK	17 945 288,89	1,26%
CZ0001001945 Česká republika	CZgb4.70/22	93 000 000 9 300 CZK	124,85	2 379 766,67 CZK	118 492 591,67	8,33%
CZ0001002331 Česká republika	CZgbf/16	32 000 000 3 200 CZK	100,14	-23 466,67 CZK	32 021 333,33	2,25%
CZ0001002471 Česká republika	CZgb5.00/19	89 000 000 8 900 CZK	121,00	-160 694,44 CZK	107 531 530,56	7,56%
CZ0001002851 Česká republika	CZgb3.85/21	57 000 000 5 700 CZK	116,48	1 091 154,17 CZK	67 486 179,17	4,75%
CZ0001003438 Česká republika	CZGBf/17	20 000 000 2 000 CZK	103,66	53 333,33 CZK	20 784 433,33	1,46%
CZ0001500110 Hlavní město Praha	PRAHAb4.25/21	23 000 000 23 CZK	114,50	860 743,06 CZK	27 195 743,06	1,91%
CZ0003501462 Severomoravské vodovody a kanalizace	SMVAKb5/15	29 000 000 29 CZK	105,20	535 694,44 CZK	31 043 694,44	2,18%
CZ0003501884 Český Aeroholding, a.s.	AEROHDb3.9/17	24 000 000 24 000 000 CZK	101,85	-52 000,00 CZK	24 392 000,00	1,72%
CZ0003502155 Český Aeroholding, a.s.	AEROHDb2.7/14	7 000 000 7 000 000 CZK	101,20	88 200,00 CZK	7 172 200,00	0,50%
XS0219645222 KBC IFIMA NV	KBCbe3.87/16	10 000 000 1 000 CZK	99,75	332 926,03 CZK	10 307 926,03	0,73%
XS0245704449 NIBC Bank NV	NIBCfe/16	10 000 000 2 CZK	89,20	8 108,33 CZK	8 928 108,33	0,63%
XS0259125945 SNS Bank Nederland NV	SNSbe4.05/14	17 000 000 17 CZK	100,65	492 324,66 CZK	17 602 824,66	1,24%
XS0305574682 Telefónica Emisiones SAU	TELEFObe4.623/14	12 000 000 6 CZK	104,10	428 609,10 CZK	12 920 609,10	0,91%
XS0490323580 General Electric Capital Corp	GE4fe/15	12 000 000 6 CZK	100,85	11 760,00 CZK	12 113 760,00	0,85%
XS0543083298 Citigroup Inc	Cfe3/15	34 000 000 17 CZK	102,00	0,00 CZK	34 680 000,00	2,44%
XS0620780147 LeasePlan Corporation N.V.	LPLNfe/14	10 000 000 5 CZK	100,80	31 138,89 CZK	10 111 138,89	0,71%
XS0622499787 ČEZ, a. s.	CEZbe4.6/23	15 000 000 3 CZK	120,50	621 945,21 CZK	18 696 945,21	1,32%
XS0761852556 Telefónica Emisiones SAU	TELEFObe3.934/17	20 000 000 4 CZK	104,50	782 488,77 CZK	21 682 488,77	1,53%
XS0766345481 RCI Banque SA	RENAULfe/15	10 000 000 5 CZK	101,00	54 444,44 CZK	10 154 444,44	0,71%
XS0860033769 ING Bank N.V., Amsterdam	ING5fe/14	15 000 000 300 CZK	100,05	9 450,00 CZK	15 016 950,00	1,06%
XS0860033843 ING Bank N.V., Amsterdam	ING6fe/17	12 000 000 240 CZK	100,00	12 413,33 CZK	12 012 413,33	0,84%

XS0880210702 Crédit Agricole CIB	CACIBfe/18	22 000 000 22	CZK	101,15	50 416,67 CZK	22 303 416,67	1,57%
XS0884604728 General Electric Capital Corp	GE6fe/18	20 000 000 10	CZK	99,87	26 916,67 CZK	20 001 616,67	1,41%
XS0885329614 LeasePlan Corporation N.V.	LPLNfe/18	20 000 000 10	CZK	100,00	50 150,00 CZK	20 050 150,00	1,41%
AT0000496633 Atrium European Real Estate Ltd.	MEL1fe/17	500 000 10	EUR	98,50	12 888,89 EUR	13 019 758,83	0,92%
AT0000A0ZZD8 Slovenska Izvozna Razvojna Banka, d.d	SEDABfe/16	1 200 000 12	EUR	97,91	0,00 EUR	30 269 518,08	2,13%
XS0197079972 Merrill Lynch & Co Inc	BAC3fe/14	700 000 700	EUR	99,78	832,90 EUR	18 015 988,95	1,27%
XS0211034466 Goldman Sachs Group Inc	GSfe/15	700 000 700	EUR	99,37	689,58 EUR	17 937 368,25	1,26%
XS0214084252 OTP Bank Rt.	OTPfe/15	1 400 000 28	EUR	90,17	708,40 EUR	32 538 607,43	2,29%
XS0260783005 Erste Group Bank AG	ERSTBKfe/17	1 750 000 35	EUR	92,59	3 542,00 EUR	41 834 288,44	2,94%
XS0503453275 MOL Hungarian Oil and Gas Company	MOLHBbe5.875/17	900 000 900	EUR	104,87	49 543,15 EUR	25 591 142,05	1,80%
XS0504814509 New World Resources Plc	NWRbe7.875/18	750 000 750	EUR	101,38	24 117,19 EUR	20 210 301,52	1,42%
XS0626282783 BOS Finance AB	BOSPWbe6/16	250 000 250	EUR	108,56	13 191,78 EUR	7 331 743,00	0,52%
XS0731129747 Eileme 2 AB	POLKOMbe11.75/20	300 000 300	EUR	116,17	5 679,17 EUR	9 124 765,66	0,64%
XS0750894577 Česká republika	CZECHbe3.875/22	1 400 000 1 400	EUR	113,52	45 778,08 EUR	42 122 681,72	2,96%
XS0757372114 Česká exportní banka, a. s.	CEBbe3.625/19	100 000 100	EUR	108,68	129,11 EUR	2 803 202,55	0,20%
XS0877986231 New World Resources Plc	NWRbe7.875/21	400 000 400	EUR	90,95	5 687,50 EUR	9 518 531,43	0,67%
PL0000102646 Polsko	PLGb5.75-09/22	2 850 000 2 850	PLN	114,39	83 505,00 PLN	20 625 473,88	1,45%
PL0000104543 Polsko	PLGb5.25-10/17	2 600 000 2 600	PLN	107,94	57 590,00 PLN	17 665 517,40	1,24%
PL0000105359 Polská republika	PLGb2.75-08/23	1 650 000 1 650	PLN	125,40	30 801,50 PLN	12 952 446,76	0,91%
PL0000105441 Polsko	PLGb5.5-10/19	2 335 000 2 335	PLN	111,35	54 195,35 PLN	16 372 125,99	1,15%
TRSCRSIA1516 Boyner Büyük Magazacilik A.S.	BOYNRF/15	2 100 000 2 100	TRY	105,30	12 660,97 TRY	24 657 388,91	1,73%
TRSINGB11411 ING Bank N.V., Amsterdam	INGTURb0/14	700 000 700 000	TRY	93,85	0,00 TRY	7 283 703,21	0,51%
TRSRNSHA1514 Rönesans Holding A.S.	RONHOLF/15	1 500 000 1 500	TRY	101,90	0,00 TRY	16 946 708,82	1,19%
TRSTISB11512 Türkiye İis Bankası A.S.	ISBANKf/15	2 000 000 20 000	TRY	100,28	27 360,00 TRY	22 539 732,52	1,59%
TRSTPFCK1419 Creditwest Faktoring Hizmetleri A.S.	CRDFAfe/14	2 000 000 2 000	TRY	101,85	473,42 TRY	22 589 773,54	1,59%
Celkem za dluhopisy						1 293 243 604,64	90,97%

Směnky

Instrument ID Emitent	Instrument	Nominální hodnota	Kurz v %	Celkem CZK	Váha
CZ0000205 České dráhy, a.s.	CDs1-06/13	30 000 000	CZK 99,91	29 973 772,95	2,11%
Celkem za směnky				29 973 772,95	2,11%

Závazky a pohledávky vyplývající z investičních operací

Instrument ID Emitent	Instrument	Splatnost	Nominální hodnota	Dis. sazba	Celkem CZK	Váha
CZ0003501884 Český Aeroholding, a.s.	AEROHDb3.9/17 - výplata úro	18.04.2013	936 000,00 CZK	0,27%	935 855,33	0,07%
CZ0001001903 Česká republika	CZgb4.00/17 - výplata úroku	11.04.2013	640 000,00 CZK	0,23%	639 942,76	0,05%
CZ0001002471 Česká republika	CZgb5.00/19 - výplata úroku	11.04.2013	4 450 000,00 CZK	0,23%	4 449 602,01	0,31%
CZ0001002331 Česká republika	CZgbf/16 - výplata úroku	29.04.2013	142 364,44 CZK	0,31%	142 324,72	0,01%
CZ0000000211 ECM Real Estate Investments AG	ECMf/12 - Pohledávka	31.07.2013	3 450 000,00 CZK	0,00%	3 450 000,00	0,24%
XS0215426957 Glitnir Banki HF	ISFBAb3/10 - Pohledávka	31.07.2013	4 700 000,00 CZK	0,00%	4 700 000,00	0,33%
	CZK-10irs - Pohledávka	31.07.2013	80 000,00 EUR	0,00%	2 060 948,96	0,14%
	CZK-10irs - Pohledávka	31.07.2013	70 000,00 EUR	0,00%	1 803 330,34	0,13%
	CZK-10irs - Pohledávka	31.07.2013	60 000,00 EUR	0,00%	1 545 711,72	0,11%
	CZK-10irs - Pohledávka	31.07.2013	230 000,00 EUR	0,00%	5 925 228,27	0,42%
	CZK-10irs - Pohledávka	31.07.2013	70 000,00 EUR	0,00%	1 803 330,34	0,13%
	CZK-10irs - Pohledávka	31.07.2013	60 000,00 EUR	0,00%	1 545 711,72	0,11%
	CZK-10irs -	31.07.2013	-80 000,00 EUR	0,00%	-2 060 948,96	-0,14%
	CZK-10irs -	31.07.2013	-70 000,00 EUR	0,00%	-1 803 330,34	-0,13%
	FX operace	03.05.2013	1 200 000,00 EUR	0,13%	-30 910 290,28	-2,17%
	CZK - Pohledávka	28.03.2013	3 090 229,47 CZK	0,00%	3 090 229,47	0,22%
	CZK - Záloha na poplatky	28.03.2013	-2 215 219,54 CZK	0,00%	-2 215 219,54	-0,16%
	FX operace	03.05.2013	70 000,00 EUR	0,13%	-1 803 100,27	-0,13%
	FX operace	28.03.2013	-26 490 193,93 CZK	0,00%	-26 490 193,93	-1,86%
	FX operace	03.05.2013	15 125 000,00 EUR	0,13%	-389 598 450,44	-27,40%
	FX operace	03.05.2013	388 227 743,75 CZK	0,32%	388 102 774,66	27,30%
	FX operace	03.05.2013	1 790 600,00 CZK	0,32%	1 790 023,61	0,13%
	FX operace	03.05.2013	30 856 920,00 CZK	0,32%	30 846 987,27	2,17%
Celkem za závazky a pohledávky					-2 049 532,58	-0,14%

Peněžní zůstatky

Měna	Zůstatek	Hodnota
CZK	110 822 044,95	110 822 044,95 CZK
USD	3 642,32	73 072,93 CZK
EUR	18 846,90	485 531,24 CZK
PLN	4 778,40	29 474,81 CZK
HUF	21 000,62	1 777,20 CZK
TRY	123 164,63	1 365 544,73 CZK
RON	61,82	360,63 CZK
Zůstatky celkem		112 777 806,49 CZK

Použité měnové kurzy

Měnový kurz	Kurz
CZK/EUR	25,7619
CZK/HUF	0,0846
CZK/PLN	6,1683
CZK/RON	5,8335
CZK/TRY	11,0872
CZK/USD	20,0622

Úrokové Swapy

Instrument ID Protistrana	Nominální hodnota	Měna	Vyplacený kupón	Obdržený kupón	Maturita	Tržní hodnota	Váha
SL5K2VDJ ING Bank N.V., Amsterdam	40 000 000,00	CZK	FIX 2.20%	FLOAT PRIBOR 6 Mont	17.04.2022	-4 228 101,07	-0,30%
SL5O2EPF ING Bank N.V., Amsterdam	30 000 000,00	CZK	FIX 2.10%	FLOAT PRIBOR 6 Mont	07.05.2021	-2 834 224,76	-0,20%
SL5O2EXZ ING Bank N.V., Amsterdam	35 000 000,00	CZK	FIX 1.78%	FLOAT PRIBOR 6 Mont	22.05.2021	-2 321 593,45	-0,16%
SL6S1T41 ING Bank N.V., Amsterdam	30 000 000,00	CZK	FIX 1.84%	FLOAT PRIBOR 6 Mont	29.05.2022	-2 103 027,60	-0,15%
SL6S1WE8 ING Bank N.V., Amsterdam	1 400 000,00	EUR	FIX 1.65%	FLOAT EURIBOR 6 Mo	04.10.2021	-769 336,57	-0,05%
Celkem za úrokové swapy						-12 256 283,45	

Souhrn

Typ Instrumentu	Tržní hodnota CZK	Váha
Dluhopisy CZK	861 292 835,70	60,58%
Dluhopisy EUR	270 317 897,91	19,01%
Dluhopisy TRY	94 017 307,01	6,61%
Dluhopisy PLN	67 615 564,03	4,76%
Směnky CZK	29 973 772,95	2,11%
Závazky a pohledávky	-2 049 532,58	-0,14%
Peněžní zůstatky	112 777 806,49	7,93%
Úrokové Swapy	-769 336,57	-0,05%
Úrokové Swapy	-11 486 946,88	-0,81%
Celková hodnota	1 421 689 368,04	100,00%