

Ocenění portfolia

dle data vypořádání obchodu k 28.03.2013
pro klienta Conseq Invest konzervativní dluhopisový fond

účet vlastníka: **CSQCBF**

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

IČO/RČ: **8080076840**

Dluhopisy

Instrument ID Emitent	Instrument	Nominální hodnota / ks	Kurz v %	AÚV	Celkem CZK	Váha
AT000B004973 Erste Group Bank AG	ERSTBKfe/13	8 000 000 4 CZK	100,25	4 366,67 CZK	8 024 366,67	1,37%
CZ0001000822 Česká republika	CZgb4.60/18	12 000 000 1 200 CZK	117,75	337 333,33 CZK	14 467 633,33	2,47%
CZ0001001903 Česká republika	CZgb4.00/17	12 000 000 1 200 CZK	112,30	-17 333,33 CZK	13 458 966,67	2,30%
CZ0001002331 Česká republika	CZgbf/16	131 000 000 13 100 CZK	100,14	-96 066,67 CZK	131 087 333,33	22,41%
CZ0001002471 Česká republika	CZgb5.00/19	10 000 000 1 000 CZK	121,00	-18 055,56 CZK	12 082 194,44	2,07%
CZ0001002737 Česká republika	CZgb3.40/15	8 000 000 800 CZK	107,40	156 400,00 CZK	8 748 600,00	1,50%
CZ0001002851 Česká republika	CZgb3.85/21	29 000 000 2 900 CZK	116,48	555 148,61 CZK	34 335 073,61	5,87%
CZ0001002869 Česká republika	CZgb2.75/14	8 000 000 800 CZK	102,68	-1 222,22 CZK	8 213 377,78	1,40%
CZ0001003123 Česká republika	CZgbf/23	31 000 000 3 100 CZK	103,88	-43 942,50 CZK	32 157 617,50	5,50%
CZ0001003438 Česká republika	CZGBf/17	30 000 000 3 000 CZK	103,66	80 000,00 CZK	31 176 650,00	5,33%
CZ0003501058 ČEZ, a. s.	CEZ1f/14	10 000 000 10 CZK	104,95	111 833,33 CZK	10 606 833,33	1,81%
CZ0003501462 Severomoravské vodovody a kanalizace	SMVAKb5/15	9 000 000 9 CZK	105,20	166 250,00 CZK	9 634 250,00	1,65%
CZ0003501736 CETELEM CR, a.s.	CETELEMf/14	8 000 000 4 CZK	100,45	47 877,78 CZK	8 083 877,78	1,38%
CZ0003501884 Český Aeroholding, a.s.	AEROHDb3.9/17	3 500 000 3 500 000 CZK	101,85	-7 583,33 CZK	3 557 166,67	0,61%
CZ0003502155 Český Aeroholding, a.s.	AEROHDb2.7/14	10 000 000 10 000 000 CZK	101,20	126 000,00 CZK	10 246 000,00	1,75%
XS0245704449 NIBC Bank NV	NIBCfe/16	5 000 000 1 CZK	89,20	4 054,17 CZK	4 464 054,17	0,76%
XS0259125945 SNS Bank Nederland NV	SNSbe4.05/14	14 000 000 14 CZK	100,65	405 443,84 CZK	14 496 443,84	2,48%
XS0305574682 Telefónica Emisiones SAU	TELEFObe4.623/14	14 000 000 7 CZK	104,10	500 043,95 CZK	15 074 043,95	2,58%
XS0490323580 General Electric Capital Corp	GE4fe/15	10 000 000 5 CZK	100,85	9 800,00 CZK	10 094 800,00	1,73%
XS0504445387 Royal Bank of Scotland PLC	RBSbe3.02/13	22 500 000 15 CZK	100,15	634 200,00 CZK	23 167 950,00	3,96%
XS0543083298 Citigroup Inc	Cfe3/15	14 000 000 7 CZK	102,00	0,00 CZK	14 280 000,00	2,44%
XS0620780147 LeasePlan Corporation N.V.	LPLNfe/14	10 000 000 5 CZK	100,80	31 138,89 CZK	10 111 138,89	1,73%
XS0638306406 UniCredit S.p.A.	UCGIMfe4/13	16 250 000 13 CZK	100,10	6 048,61 CZK	16 272 298,61	2,78%
XS0766345481 RCI Banque SA	RENAULfe/15	8 000 000 4 CZK	101,00	43 555,56 CZK	8 123 555,56	1,39%
XS0860033769 ING Bank N.V., Amsterdam	ING5fe/14	7 500 000 150 CZK	100,05	4 725,00 CZK	7 508 475,00	1,28%
XS0860033843 ING Bank N.V., Amsterdam	ING6fe/17	5 000 000 100 CZK	100,00	5 172,22 CZK	5 005 172,22	0,86%
XS0880210702 Crédit Agricole CIB	CACIBfe/18	15 000 000 15 CZK	101,15	34 375,00 CZK	15 206 875,00	2,60%

XS0884604728 General Electric Capital Corp	GE6fe/18	4 000 000 2	CZK	99,87	5 383,33 CZK	4 000 323,33	0,68%
AT0000A0ZZD8 Slovenska Izvovzna Razvojna Banka, d.d	SEDABfe/16	400 000 4	EUR	97,91	0,00 EUR	10 089 839,36	1,72%
XS0197079972 Merrill Lynch & Co Inc	BAC3fe/14	500 000 500	EUR	99,78	594,93 EUR	12 868 563,53	2,20%
XS0211034466 Goldman Sachs Group Inc	GSfe/15	400 000 400	EUR	99,37	394,04 EUR	10 249 924,71	1,75%
XS0214084252 OTP Bank Rt.	OTPfe/15	650 000 13	EUR	90,17	328,90 EUR	15 107 210,59	2,58%
XS0260783005 Erste Group Bank AG	ERSTBKfe/17	450 000 9	EUR	92,59	910,80 EUR	10 757 388,46	1,84%
XS0626282783 BOS Finance AB	BOSPWbe6/16	350 000 350	EUR	108,56	18 468,49 EUR	10 264 440,20	1,75%
Celkem za dluhopisy						553 022 438,53	94,52%

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	136 500,00 CZK	0,27%	136 478,90	0,02%
CZ0001002869 Česká republika	CZgb2.75/14 - výplata úroku	02.04.2013	220 000,00 CZK	0,21%	219 993,48	0,04%
CZ0001001903 Česká republika	CZgb4.00/17 - výplata úroku	11.04.2013	480 000,00 CZK	0,23%	479 957,07	0,08%
CZ0001002471 Česká republika	CZgb5.00/19 - výplata úroku	11.04.2013	500 000,00 CZK	0,23%	499 955,28	0,09%
CZ0001002331 Česká republika	CZgbf/16 - výplata úroku	29.04.2013	582 804,44 CZK	0,31%	582 641,82	0,10%
CZ0001003123 Česká republika	CZgbf/23 - výplata úroku	18.04.2013	763 762,50 CZK	0,27%	763 644,45	0,13%
XS0213064289 Landsbanki Islands HF	LANISLfe/10 - Pohledávka	31.07.2013	800 000,00 CZK	0,00%	800 000,00	0,14%
	CZK-10irs - Pohledávka	31.07.2013	-40 000,00 EUR	0,00%	-1 030 474,48	-0,18%
	CZK-10irs - Pohledávka	31.07.2013	60 000,00 EUR	0,00%	1 545 711,72	0,26%
	CZK-10irs - Pohledávka	31.07.2013	80 000,00 EUR	0,00%	2 060 948,96	0,35%
	CZK - Pohledávka	28.03.2013	13 357 207,64 CZK	0,00%	13 357 207,64	2,28%
	FX operace	28.03.2013	-112 136,69 CZK	0,00%	-112 136,69	-0,02%
	FX operace	03.05.2013	60 000,00 EUR	0,13%	-1 545 514,51	-0,26%
	FX operace	03.05.2013	400 000,00 EUR	0,13%	-10 303 430,09	-1,76%
	FX operace	03.05.2013	2 230 000,00 EUR	0,13%	-57 441 622,78	-9,82%
	CZK - Záloha na poplatky	28.03.2013	-809 243,08 CZK	0,00%	-809 243,08	-0,14%
	FX operace	03.05.2013	10 285 640,00 CZK	0,32%	10 282 329,09	1,76%
	FX operace	03.05.2013	1 545 900,00 CZK	0,32%	1 545 402,38	0,26%
	FX operace	03.05.2013	57 239 528,50 CZK	0,32%	57 221 103,30	9,78%
Celkem za závazky a pohledávky					18 252 952,47	3,12%

Peněžní zůstatky

Měna	Zůstatek	Hodnota
CZK	15 896 807,77	15 896 807,77 CZK
USD	6 250,65	125 401,75 CZK
EUR	73 006,44	1 880 781,83 CZK
PLN	1,65	10,18 CZK
Zůstatky celkem		17 903 001,53 CZK

Použité měnové kursy

Měnový kurz	Kurz
CZK/EUR	25,7619
CZK/PLN	6,1683
CZK/USD	20,0622

Úrokové Swapy

Instrument ID Protistrana	Nominální hodnota	Měna	Vyplacený kupón	Obdržený kupón	Maturita	Tržní hodnota	Váha
SL5K2VDG ING Bank N.V., Amsterdam	10 000 000,00	CZK	FIX 2.20%	FLOAT PRIBOR 6 Mont	17.04.2022	-1 057 025,27	-0,18%
SL5O2EXW ING Bank N.V., Amsterdam	30 000 000,00	CZK	FIX 1.78%	FLOAT PRIBOR 6 Mont	22.05.2021	-1 989 937,24	-0,34%
SL6S1T44 ING Bank N.V., Amsterdam	15 000 000,00	CZK	FIX 1.84%	FLOAT PRIBOR 6 Mont	29.05.2022	-1 051 513,80	-0,18%
Celkem za úrokové swapy						-4 098 476,31	

Souhrn

Typ Instrumentu	Tržní hodnota CZK	Váha
Dluhopisy CZK	483 685 071,67	82,67%
Dluhopisy EUR	69 337 366,86	11,85%
Závazky a pohledávky	18 252 952,47	3,12%
Peněžní zůstatky	17 903 001,53	3,06%
Úrokové Swapy	-4 098 476,31	-0,70%
Celková hodnota	585 079 916,23	100,00%