

# Ocenění portfolia

dle data vypořádání obchodu k 30.08.2013  
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	100,02	49 488,89 CZK	<b>8 050 688,89</b>	1,12%
CZ0001000822 Česká republika	CZgb4.60/18	12 000 000 1 200 CZK	115,29	18 400,00 CZK	<b>13 853 500,00</b>	1,92%
CZ0001001903 Česká republika	CZgb4.00/17	12 000 000 1 200 CZK	110,56	185 333,33 CZK	<b>13 452 233,33</b>	1,87%
CZ0001002331 Česká republika	CZgbf/16	131 000 000 13 100 CZK	100,39	272 916,67 CZK	<b>131 789 056,67</b>	18,27%
CZ0001002471 Česká republika	CZgb5.00/19	10 000 000 1 000 CZK	117,96	193 055,56 CZK	<b>11 989 055,56</b>	1,66%
CZ0001002737 Česká republika	CZgb3.40/15	8 000 000 800 CZK	105,96	-755,56 CZK	<b>8 476 244,44</b>	1,18%
CZ0001002851 Česká republika	CZgb3.85/21	29 000 000 2 900 CZK	111,83	-89 940,28 CZK	<b>32 341 484,72</b>	4,48%
CZ0001002869 Česká republika	CZgb2.75/14	8 000 000 800 CZK	101,51	91 666,67 CZK	<b>8 212 666,67</b>	1,14%
CZ0001003123 Česká republika	CZgbf/23	45 000 000 4 500 CZK	104,76	236 175,00 CZK	<b>47 377 500,00</b>	6,57%
CZ0001003438 Česká republika	CZGBf/17	80 000 000 8 000 CZK	103,74	121 600,00 CZK	<b>83 111 200,00</b>	11,52%
CZ0001003834 Česká republika	CZgb1.5/19	14 000 000 1 400 CZK	98,16	131 833,33 CZK	<b>13 873 533,33</b>	1,92%
CZ0003501058 ČEZ, a. s.	CEZ1f/14	10 000 000 10 CZK	102,45	396 000,00 CZK	<b>10 641 000,00</b>	1,48%
CZ0003501462 Severomoravské vodovody a kanalizace	SMVAKb5/15	9 000 000 9 CZK	104,20	356 250,00 CZK	<b>9 734 250,00</b>	1,35%
CZ0003501736 CETELEM CR, a.s.	CETELEMf/14	8 000 000 4 CZK	100,40	35 908,89 CZK	<b>8 067 908,89</b>	1,12%
CZ0003501884 Český Aeroholding, a.s.	AEROHDb3.9/17	3 500 000 3 500 000 CZK	102,40	50 050,00 CZK	<b>3 634 050,00</b>	0,50%
CZ0003502155 Český Aeroholding, a.s.	AEROHDb2.7/14	10 000 000 10 000 000 CZK	101,25	240 000,00 CZK	<b>10 365 000,00</b>	1,44%
CZ0003510646 Czech Property Investments a. s.	CPIb6.05/16	12 450 000 1 245 CZK	99,00	-60 676,46 CZK	<b>12 264 823,54</b>	1,70%
CZ0003510885 České dráhy, a.s.	CDf/18	8 000 000 2 CZK	99,74	18 320,00 CZK	<b>7 997 920,00</b>	1,11%
XS0245704449 NIBC Bank NV	NIBCfe/16	5 000 000 1 CZK	89,51	15 750,00 CZK	<b>4 491 250,00</b>	0,62%
XS0259125945 SNS Bank Nederland NV	SNSbe4.05/14	14 000 000 14 CZK	101,75	79 224,66 CZK	<b>14 324 224,66</b>	1,99%
XS0305574682 Telefónica Emisiones SAU	TELEFObe4.623/14	14 000 000 7 CZK	102,80	127 670,79 CZK	<b>14 519 670,79</b>	2,01%
XS0490323580 General Electric Capital Corp	GE4fe/15	10 000 000 5 CZK	100,80	73 091,67 CZK	<b>10 153 091,67</b>	1,41%
XS0543083298 Citigroup Inc	Cfe3/15	14 000 000 7 CZK	101,70	44 345,00 CZK	<b>14 282 345,00</b>	1,98%
XS0620780147 LeasePlan Corporation N.V.	LPLNfe/14	10 000 000 5 CZK	100,70	16 533,33 CZK	<b>10 086 533,33</b>	1,40%
XS0638306406 UniCredit S.p.A.	UCGIMfe4/13	20 000 000 16 CZK	100,10	53 855,56 CZK	<b>20 073 855,56</b>	2,78%
XS0766345481 RCI Banque SA	RENAULfe/15	8 000 000 4 CZK	101,45	28 384,44 CZK	<b>8 144 384,44</b>	1,13%
XS0860033769 ING Bank N.V., Amsterdam	ING5fe/14	7 500 000 150 CZK	100,10	0,00 CZK	<b>7 507 500,00</b>	1,04%

XS0860033843 ING Bank N.V., Amsterdam	ING6fe/17	5 000 000 100	CZK	100,50	0,00 CZK	<b>5 025 000,00</b>	0,70%
XS0880210702 Crédit Agricole CIB	CACIBfe/18	15 000 000 15	CZK	101,75	17 641,67 CZK	<b>15 280 141,67</b>	2,12%
XS0884604728 General Electric Capital Corp	GE6fe/18	4 000 000 2	CZK	99,80	2 527,78 CZK	<b>3 994 527,78</b>	0,55%
AT0000A0ZZD8 Slovenska Izvovzna Razvojna Banka, d.d	SEDABlfe/16	400 000 4	EUR	97,42	6 091,50 EUR	<b>10 202 078,70</b>	1,41%
XS0197079972 Merrill Lynch & Co Inc	BAC3fe/14	500 000 500	EUR	100,10	362,92 EUR	<b>12 911 092,84</b>	1,79%
XS0211034466 Goldman Sachs Group Inc	GSfe/15	400 000 400	EUR	99,97	210,93 EUR	<b>10 313 113,86</b>	1,43%
XS0214084252 OTP Bank Rt.	OTPfe/15	550 000 11	EUR	92,79	996,88 EUR	<b>13 181 434,02</b>	1,83%
XS0260783005 Erste Group Bank AG	ERSTBKfe/17	450 000 9	EUR	94,97	588,00 EUR	<b>11 031 645,99</b>	1,53%
XS0626282783 BOS Finance AB	BOSPWbe6/16	350 000 350	EUR	109,50	6 386,30 EUR	<b>10 043 425,54</b>	1,39%
<b>Celkem za dluhopisy</b>						<b>630 797 431,89</b>	<b>87,47%</b>

## Poukázky MF

Instrument ID Emitent	Instrument	Nominální hodnota / ks	Splatnost	Výnos %	Celkem CZK	Váha	
CZ0001003958 Česká republika	MF 24/01   675	10 000 000 10	CZK	24.01.2014	0,53	<b>9 978 161,13</b>	1,38%
CZ0001003974 Česká republika	MF 16/05   676	50 000 000 50	CZK	16.05.2014	0,66	<b>49 760 934,04</b>	6,90%
<b>Celkem za poukázky</b>						<b>59 739 095,17</b>	<b>8,28%</b>

## Závazky a pohledávky vyplývající z investičních operací

Instrument ID Emitent	Instrument	Splatnost	Nominální hodnota	Dis. sazba	Celkem CZK	Váha	
CZ0003510646 Czech Property Investments a. s.	CPIb6.05/16 - výplata úroku	30.09.2013	376 612,50 CZK	0,30%	<b>376 514,59</b>	0,05%	
CZ0001002737 Česká republika	CZgb3.40/15 - výplata úroku	02.09.2013	272 000,00 CZK	0,19%	<b>271 995,77</b>	0,04%	
CZ0001002851 Česká republika	CZgb3.85/21 - výplata úroku	30.09.2013	1 116 500,00 CZK	0,30%	<b>1 116 209,72</b>	0,15%	
XS0213064289 Landsbanki Islands HF	LANISLfe/10 - Pohledávka	31.12.2013	880 000,00 CZK	0,00%	<b>880 000,00</b>	0,12%	
XS0214084252 OTP Bank Rt.	OTPfe/15 - Prodej	03.09.2013	93 689,58 EUR	0,10%	<b>18 437,83</b>	0,00%	
	FX operace	30.08.2013	-232 938,49 CZK	0,00%	<b>-232 938,49</b>	-0,03%	
	FX operace	07.10.2013	2 410 000,00 EUR	0,14%	<b>-62 114 679,07</b>	-8,61%	
	CZK - Záloha na poplatky	30.08.2013	-1 144 706,13 CZK	0,00%	<b>-1 144 706,13</b>	-0,16%	
	CZK - Pohledávka	30.08.2013	2 034 658,35 CZK	0,00%	<b>2 034 658,35</b>	0,28%	
	FX operace	07.10.2013	62 130 354,30 CZK	0,32%	<b>62 109 637,29</b>	8,61%	
<b>Celkem za závazky a pohledávky</b>						<b>3 315 129,85</b>	<b>0,46%</b>

## Peněžní zůstatky

Měna	Zůstatek	Hodnota
CZK	26 900 434,50	<b>26 900 434,50 CZK</b>
USD	7 228,45	<b>141 310,39 CZK</b>
EUR	11 122,47	<b>286 710,24 CZK</b>
PLN	1,65	<b>9,96 CZK</b>
<b>Zůstatky celkem</b>		<b>27 328 465,09 CZK</b>

## Použité měnové kursy

Měnový kurz	Kurz
CZK/EUR	25,7776
CZK/PLN	6,0379
CZK/USD	19,5492

## Souhrn

Typ Instrumentu	Tržní hodnota CZK	Váha
Dluhopisy CZK	563 114 640,94	78,08%
Dluhopisy EUR	67 682 790,95	9,39%
Pokladniční poukázky CZK	59 739 095,17	8,28%
Závazky a pohledávky	3 315 129,85	0,46%
Peněžní zůstatky	27 328 465,09	3,79%
<b>Celková hodnota</b>	<b>721 180 121,99</b>	<b>100,00%</b>