

POLOLETNÍ ZPRÁVA

FONDU S NÁZVEM:

CONSEQ STÁTNÍCH DLUHOPISŮ, OTEVŘENÝ PODÍLOVÝ FOND

(dále jen „Fond“)

INFORMACE KE DNI 30. června 2015

I. OBECNÉ ÚDAJE A SKUTEČNOSTI

podle zákona č. 240/2013 Sb. a vyhlášky č. 244/2013 Sb.

A. ÚDAJE O OSOBACH PROVÁDĚJÍCÍCH SPRÁVU MAJEKTU (PORTFOLIO MANAŽERECH) FONDU

Obchodní firma

Conseq Investment Management, a.s. (dále jen „Portfolio Manažer“) zapsaná v obchodním rejstříku vedeném Městským soudem v Praze, oddíl B, vložka 7153

IČO

264 42 671

Sídlo

Praha 1, Rybná 682/14, PSČ 110 05

Další údaje

Smlouva o svěření obhospodařování finančních aktiv v majetku Fondu byla se společností Conseq Funds investiční společnost, a.s. (dále jen „Společnost“) uzavřena s účinností ode dne 29. června 2011.

Stručný popis zkušeností a znalostí

Portfolio Manažer je obchodníkem s cennými papíry poskytující od roku 2001 mimo jiné i investiční službu obhospodařování majetku zákazníka, je-li jeho součástí investiční nástroj, na základě volné úvahy v rámci smluvního ujednání.

Hlavní osoby, podílející se u Portfolia manažera na řízení Fondu

Ing. Jan Vedral

Po absolvování Obchodní fakulty Vysoké školy ekonomické v Praze pracoval v Investiční bance. V roce 1992 nastoupil do Agrobanky Praha (dnes GE Money Bank) a ve funkci hlavního makléře se účastnil prvních transakcí na formujícím se českém primárním i sekundárním kapitálovém trhu. Koncem roku 1994 inicioval založení společnosti Conseq Finance, v jejímž čele působil až do roku 2003. Po celou dobu přímo zodpovídal za divizi operací, skupinu obchodování s akciemi a skupinu investičního managementu. V Conseq Investment Management pokračuje Jan Vedral jako hlavní investiční manažer, který vede investiční tým a stanovuje hlavní investiční strategie. Spolu s Hanou Blovskou se podílí na rozhodování o obchodní politice firmy a jejím operativním řízení.

Ing. Ondřej Matuška

Absolvoval Fakultu financí a účetnictví Vysoké školy ekonomické v Praze. Při studiu pracoval v Hospodářských novinách jako odborný redaktor pro oblast zahraničních kapitálových trhů. Po ukončení studia působil kratší dobu jako analytik v oddělení komerčního bankovníctví Erste Bank Sparkassen CR, později České spořitelny. Do společnosti Conseq Finance nastoupil v roce 2000. Jako junior portfolio manažer zodpovídal za řízení cash-flow klientských portfolií a exekuci investičních rozhodnutí. Od roku 2003 působí jako portfolio manažer v Conseq Investment Management, kde je primárně odpovědný za dluhopisové složky klientských portfolií a za fondy Conseq Invest Dluhopisový, Konzervativní dluhopisový a Dluhopisů Nové Evropy. V investičním týmu s Janem Vedralem se podílí na vytváření investičních strategií. V srpnu roku 2008 byl zvolen členem představenstva.

Ing. Jan Schiller

Absolvoval Fakultu financí a účetnictví Vysoké školy ekonomické v Praze, obor Finance, se zaměřením na analýzu finančních trhů. Dva roky před úspěšným ukončením oboru nastoupil do společnosti Conseq Investment Management na pozici junior analytika. Následně byl plnohodnotně začleněn do týmu na pozici junior portfolio manažera zodpovědného za implementaci investičních rozhodnutí dluhopisových částí portfolií a institucionálních mandátů a podílejícího se na asset alokaci a řízení klientských portfolií.

B. ÚDAJE O DEPOZITÁŘI FONDU v rozhodném období a době, po kterou činnost depozitáře vykonávali

Depozitářem Fondu byla po celé rozhodné období UniCredit Bank Czech Republic and Slovakia, a.s., IČ: 649 48 242, se sídlem Praha 4 - Michle, Želetavská 1525/1, PSČ 140 92, zapsaná v obchodním rejstříku vedeném Městským soudem v Praze, oddíl B, vložka 3608 (dále jen „Depozitář“).

C. ÚDAJE O KAŽDÉ OSOBĚ, KTERÁ BYLA DEPOZITÁŘEM POVĚŘENA ÚSCHOVOU NEBO OPATROVÁNÍM MAJETKU FONDU, pokud je u této osoby uloženo více než 1 % hodnoty majetku fondu

Úschovu nebo jiné opatrování majetku Fondu zajišťuje pouze Depozitář Fondu.

D. ÚDAJE O KAŽDÉ OSOBĚ OPRÁVNĚNÉ POSKYTOVAT INVESTIČNÍ SLUŽBY, KTERÁ VYKONÁVALA ČINNOST HLAVNÍHO PODPŮRCE VE VZTAHU K MAJETKU FONDU, v rozhodném období, a údaj o době, po kterou tuto činnost vykonávala

V rozhodném období nevykonávala žádná osoba ve vztahu k majetku Fondu činnost hlavního podpůrce.

E. IDENTIFIKACE MAJETKU, JEHOŽ HODNOTA PŘESAHUJE 1 % HODNOTY MAJETKU FONDU ke dni 30. června 2015, s uvedením celkové pořizovací ceny a reálné hodnoty na konci rozhodného období:

Dluhové CP v majetku Fondu:

Název cenného papíru	ISIN	Celková pořizovací cena (v tis. Kč)	Celková reálná hodnota (v tis. Kč) k 30.6.2015
CZgbf/16	CZ0001002331	18 983	19 000
CZgb3.40/15	CZ0001002737	5 293	5 170
CZgbf/23	CZ0001003123	14 671	15 091
CZGBf/17	CZ0001003438	18 882	18 671
MF 04/09 698	CZ0001004360	1 999	2 000
LLOYDSfe/21	XS1143451992	6 000	5 936
MF 19/02 705	CZ0001004444	49 975	49 980
CZGBf/20	CZ0001004113	34 827	35 050
MF 22/04 707	CZ0001004493	24 997	24 984
MF 05/27 709	CZ0001004519	19 994	19 983
MF 10/06 710	CZ0001004527	13 993	13 987
MF 25/03 711	CZ0001004535	59 977	59 969

F. ÚDAJE O HODNOTĚ VŠECH VYPLACENÝCH PODÍLŮ NA ZISKU NA JEDEN PODÍLOVÝ LIST

Fond je fondem výnosovým, tj. používá zisk k výplatě podílů na zisku z výsledků hospodaření s majetkem Fondu podílníkům. Hodnota vyplacených podílů na zisku za účetní období roku 2014 byla 0,0017 Kč na jeden podílový list.

G. ÚDAJE O SKUTEČNĚ ZAPLACENÉ ÚPLATĚ OBHOSPODAŘOVATELI ZA OBHOSPODAŘOVÁNÍ FONDU,

s rozlišením na údaje o úplatě za výkon činnosti depozitáře, administrátora, hlavního podpůrce a auditora, a údaje o dalších nákladech či daních

Za období 1. 1. 2015 – 30. 6. 2015 činily náklady na úplatu obhospodařování majetku Fondu 476 tis. Kč.

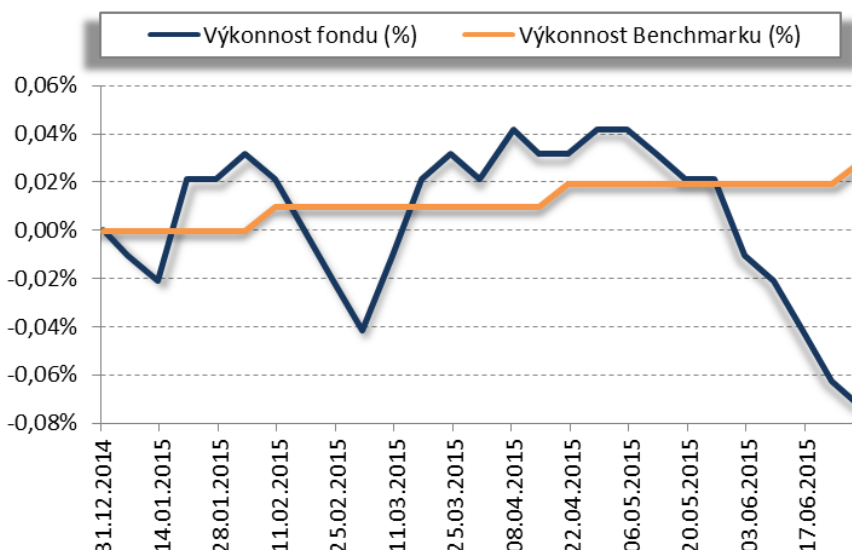
Za období 1. 1. 2015 – 30. 6. 2015 činily náklady na výkon funkce depozitáře 72 tis. Kč a náklady na ostatní služby depozitáře 34 tis. Kč.

Za období 1. 1. 2015 – 30. 6. 2015 činily náklady na služby auditora 36 tis. Kč.

H. ROČNÍ ODCHYLKA SLEDOVÁNÍ MEZI VÝKONNOSTÍ FONDU A VÝKONNOSTÍ SLEDOVANÉHO INDEXU (BENCHMARK),

včetně vysvětlení rozdílů mezi očekávanou a skutečnou odchylkou sledování za příslušné období

Skutečná roční odchylka mezi výkonností Fondu a výkonností sledovaného indexu (Benchmarku) činí -0,10 %. Očekávaná odchylka sledování za příslušné období není pro Fond explicitně stanovena.



I. ÚDAJE O CELKOVÉM POČTU PODÍLOVÝCH LISTŮ VYDANÝCH FONDEM,

kteří jsou v oběhu ke dni 30.6.2015

V rozhodném období Fond emitoval 72 346 376 podílových listů z celkového počtu 808 907 286 vydaných podílových listů a zároveň odkoupil 17 058 605 podílových listů z 523 952 812 kusů celkem odkoupených.

J. ÚDAJE O FONDOVÉM KAPITÁLU NA PODÍLOVÝ LIST TOHOTO FONDU

K 30. červnu 2015 připadl na jeden podílový list fondový kapitál ve výši 0,9546.

K. ÚDAJE O SKLADBĚ A ZMĚNÁCH SKLADBY MAJETKU FONDU

Podíl v % na aktivech celkem	30. června 2014	30. června 2015
Pohledávky za bankami	5,35 %	0,66 %
Dluhové cenné papíry	93,14 %	99,14 %
v tom: a) vydané vládními institucemi	90,22 %	96,96 %
b) vydané ostatními osobami	2,92 %	2,18 %
Ostatní aktiva	1,51 %	0,20 %

ROZVAHA K 30. ČERVNU 2015

Aktiva

tis. Kč	30. června 2015
Pohledávky za bankami	1 788
v tom: a) splatné na požádání	1 788
b) ostatní pohledávky	0
Dluhové cenné papíry	269 820
v tom: a) vydané vládními institucemi	263 884
b) vydané ostatními osobami	5 936
Ostatní aktiva	558
Aktiva celkem	272 166

Pasiva

tis. Kč	30. června 2015
Ostatní pasiva	139
Emisní ážio	-12 753
Kapitálové fondy	284 955
Zisk/ztráta za účetní období	-175
Pasiva celkem	272 166

V Praze dne 24. srpna 2015

 Mgr. Hana Blovká
 místopředsedkyně představenstva