

Ocenění portfolia

dle data vypořádání obchodu k 30.08.2013
pro klienta CONSEQ INVEST Fond dluhopisů nové Evropy

účet vlastníka: CSQNEBF

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

IČO/RČ: 8080088148

Dluhopisy

Instrument ID Emitent	Instrument	Nominální hodnota / ks	Kurz v %	AÚV	Celkem CZK	Váha
AT0000492996 Atrium European Real Estate Ltd.	MEL2fe/15	16 000 000 8 CZK	96,00	8 751,11 CZK	15 368 751,11	2,61%
CZ0000000260 Home Credit, a.s.	HCb6.25/16	6 000 000 2 CZK	105,00	70 833,33 CZK	6 370 833,33	1,08%
HU0000402664 Maďarsko	REPHUNfi/16	800 000 800 000 EUR	100,25	8 856,52 EUR	20 901 909,94	3,56%
SI0002102984	SLOREPb4.625/24	850 000 850 EUR	84,81	38 235,45 EUR	19 567 841,44	3,33%
XS0214084252 OTP Bank Rt.	OTPfe/15	550 000 11 EUR	92,79	996,88 EUR	13 181 434,02	2,24%
XS0541470075 Republika Černá Hora	MONTENbe7.875/15	300 000 300 EUR	105,00	22 654,11 EUR	8 704 211,44	1,48%
XS0731129747 Eileme 2 AB	POLKOMbe11.75/20	200 000 200 EUR	117,39	1 958,33 EUR	6 102 461,39	1,04%
XS0877986231 New World Resources Plc	NWRbe7.875/21	500 000 500 EUR	40,98	4 921,88 EUR	5 408 375,64	0,92%
PL0000102646 Polsko	PLGb5.75-09/22	1 660 000 1 660 PLN	109,75	89 175,20 PLN	11 538 301,54	1,96%
PL0000104543 Polsko	PLGb5.25-10/17	6 400 000 6 400 PLN	105,91	284 480,00 PLN	42 642 931,44	7,25%
PL0000105359 Polská republika	PLGb2.75-08/23	7 000 000 7 000 PLN	120,52	3 080,90 PLN	50 955 365,92	8,67%
PL0000105441 Polsko	PLGb5.5-10/19	10 501 000 10 501 PLN	107,94	488 926,56 PLN	71 388 602,41	12,14%
PL0000105953 Polsko	PLGb5.5-04/15	1 600 000 1 600 PLN	103,86	30 624,00 PLN	10 218 663,01	1,74%
PL0000107264 Polská republika	PLGb4-10/23	7 000 000 7 000 PLN	96,51	237 020,00 PLN	42 220 188,86	7,18%
RO0717DBN038 Rumunsko	ROMGB6.75/17	7 000 000 700 RON	106,88	103 561,64 RO	44 118 960,26	7,50%
RO1215DBN073 Rumunsko	ROMGB5.8/15	3 000 000 300 RON	102,87	146 827,40 RO	18 803 484,88	3,20%
RO1323DBN018 Rumunsko	ROMGB5.85/23	1 500 000 150 RON	105,03	30 291,78 RO	9 339 424,80	1,59%
TRSCRSIA1516 Boyner Büyük Magazacilik A.S.	BOYNRF/15	1 000 000 1 000 TRY	100,65	6 420,82 TRY	9 715 093,77	1,65%
TRSEVA61615 Deva Holding A.S.	DEVAf/16	120 000 120 TRY	100,05	964,93 TRY	1 160 770,45	0,20%
TRSERGL31517 Eregli Demir ve Çelik Fabrikalari T.A.S.	EREGLTf/15	700 000 7 000 TRY	98,65	23 183,01 TRY	6 845 533,21	1,16%
TRSFNF21416	ISLEASf/14	500 000 500 000 TRY	99,80	297,83 TRY	4 788 849,33	0,81%
TRSMCBF71511 Mercedes-Benz Finansman Turk A.S.	DAIGRb10.03/15	550 000 550 000 TRY	99,45	5 894,34 TRY	5 302 662,75	0,90%
TRSPKP61517 Pakpen Plastik Boru ve Yapi	PAKPENf/15	400 000 400 000 TRY	99,75	8 962,19 TRY	3 912 833,92	0,67%
TRSRNSHA1514 Rönesans Holding A.S.	RONHOLf/15	500 000 500 TRY	100,05	1 202,05 TRY	4 809 510,90	0,82%
TRSTISB11512 Türkiye Is Bankasi A.S.	ISBANKf/15	800 000 8 000 TRY	99,65	9 040,00 TRY	7 732 783,29	1,32%
TRSTPFCK1419 Creditwest Faktoring Hizmetleri A.S.	CRDFAfe/14	750 000 750 TRY	99,75	1 018,36 TRY	7 185 159,79	1,22%
TRT010420T19 Turecko	TURKGB4 04/20	1 425 000 14 250 TRY	128,38	0,00 TRY	17 545 929,70	2,98%

TRT060121T16 Turecko	TURKGB3 01/21	1 300 000 TRY 1 300 000	117,64	0,00 TRY	14 667 612,15	2,50%
TRT080323T10 Turecko	TURKGB7.1 03/23	1 125 000 TRY 1 125 000	82,59	35 768,20 TRY	9 254 842,43	1,57%
TRT110215T16 Turecko	TURKGB4.5 02/15	1 000 000 TRY 1 000 000	132,69	0,00 TRY	12 726 137,67	2,16%
TRT120122T17 Turecko	TURKGB9.5 01/22	1 750 000 TRY 1 750 000	96,97	22 136,55 TRY	16 488 203,75	2,80%
TRT150120T16 Turecko	TURKGB10.5 01/20	2 175 000 TRY 2 175 000	102,82	28 546,88 TRY	21 723 592,69	3,70%
TRT170615T16 Turecko	TURKGB10 06/15	1 000 000 TRY 1 000 000	100,73	20 218,58 TRY	9 855 055,36	1,68%
TRT210721T11 Turecko	TURKGB3 07/21	1 400 000 TRY 14 000	110,24	0,00 TRY	14 802 199,76	2,52%
XS0546767863 Yasar Holding A.S. (via Willow No.2 PLC	YASARbe9.625/15	350 000 USD 350	99,99	13 381,42 USD	7 103 062,03	1,21%
XS0853036860 Hrvatska Elektroprivreda	HEPbe6/17	200 000 USD 200	102,37	3 700,00 USD	4 074 990,81	0,69%
Celkem za dluhopisy					576 526 565,18	98,07%

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	1 500 000,00 CZK	0,00%	1 500 000,00	0,26%
XS0213064289 Landsbanki Islands HF	LANISLfe/10 - Pohledávka	31.12.2013	440 000,00 CZK	0,00%	440 000,00	0,07%
XS0214084252 OTP Bank Rt.	OTPfe/15 - Prodej	03.09.2013	140 534,38 EUR	0,10%	27 656,74	0,00%
	FX operace	30.08.2013	-648 825,61 CZK	0,00%	-648 825,61	-0,11%
	FX operace	03.09.2013	235 000,00 USD	0,13%	4 593 993,65	0,78%
	FX operace	07.10.2013	21 210 000,00 EUR	0,14%	-546 660 723,28	-92,99%
	CZK - Záloha na poplatky	30.08.2013	-1 154 883,96 CZK	0,00%	-1 154 883,96	-0,20%
	CZK - Pohledávka	30.08.2013	1 130 644,97 CZK	0,00%	1 130 644,97	0,19%
	FX operace	07.10.2013	546 798 678,30 CZK	0,32%	546 616 351,38	92,98%
	FX operace	03.09.2013	4 571 001,45 CZK	0,19%	-4 570 904,95	-0,78%
Celkem za závazky a pohledávky					1 273 308,94	0,22%

Peněžní zůstatky

Měna	Zůstatek	Hodnota
CZK	7 621 893,31	7 621 893,31 CZK
USD	12 394,45	242 301,53 CZK
EUR	11 196,21	288 611,08 CZK
PLN	222 434,11	1 343 031,78 CZK
HUF	45 758,01	3 910,57 CZK
TRY	56 712,40	543 938,16 CZK
RON	5 362,61	31 190,23 CZK
Zůstatky celkem		10 074 876,65 CZK

Použité měnové kursy

Měnový kurz	Kurz
CZK/EUR	25,7776
CZK/HUF	0,0855
CZK/PLN	6,0379
CZK/RON	5,8162
CZK/TRY	9,5912
CZK/USD	19,5492

Souhrn

Typ Instrumentu	Tržní hodnota CZK	Váha
Dluhopisy PLN	228 964 053,17	38,95%
Dluhopisy TRY	168 516 770,92	28,67%
Dluhopisy EUR	73 866 233,86	12,56%
Dluhopisy RON	72 261 869,94	12,29%
Dluhopisy CZK	21 739 584,44	3,70%
Dluhopisy USD	11 178 052,84	1,90%
Závazky a pohledávky	1 273 308,94	0,22%
Peněžní zůstatky	10 074 876,65	1,71%
Celková hodnota	587 874 750,77	100,00%