

Ocenění portfolia

dle data vypořádání obchodu k 30.08.2013
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	96,00	9 845,00 CZK	17 289 845,00	1,17%
CZ000000260 Home Credit, a.s.	HCb6.25/16	18 000 000 6 CZK	105,00	212 500,00 CZK	19 112 500,00	1,30%
CZ0001000822 Česká republika	CZgb4.60/18	18 000 000 1 800 CZK	115,29	27 600,00 CZK	20 780 250,00	1,41%
CZ0001001317 Česká republika	CZgb3.75/20	74 000 000 7 400 CZK	111,11	-92 500,00 CZK	82 130 750,00	5,57%
CZ0001001796 Česká republika	CZgb4.20/36	22 500 000 2 250 CZK	114,06	698 250,00 CZK	26 362 312,50	1,79%
CZ0001001903 Česká republika	CZgb4.00/17	16 000 000 1 600 CZK	110,56	247 111,11 CZK	17 936 311,11	1,22%
CZ0001001945 Česká republika	CZgb4.70/22	93 000 000 9 300 CZK	118,97	-145 700,00 CZK	110 496 400,00	7,50%
CZ0001002331 Česká republika	CZgbf/16	32 000 000 3 200 CZK	100,39	66 666,67 CZK	32 192 746,67	2,18%
CZ0001002471 Česká republika	CZgb5.00/19	27 000 000 2 700 CZK	117,96	521 250,00 CZK	32 370 450,00	2,20%
CZ0001002851 Česká republika	CZgb3.85/21	82 000 000 8 200 CZK	111,83	-254 313,89 CZK	91 448 336,11	6,21%
CZ0001003859 Česká republika	CZgb2.5/28	58 000 000 5 800 CZK	93,77	20 138,89 CZK	54 408 188,89	3,69%
CZ0001500110 Hlavní město Praha	PRAHAb4.25/21	18 000 000 18 CZK	109,50	231 625,00 CZK	19 941 625,00	1,35%
CZ0002000664 Komerční banka, a. s.	Kbh4.4/15	130 000 000 13 000 CZK	107,00	4 909 666,67 CZK	144 009 666,67	9,77%
CZ0003501058 ČEZ, a. s.	CEZ1f/14	82 000 000 82 CZK	102,45	3 247 200,00 CZK	87 256 200,00	5,92%
CZ0003501462 Severomoravské vodovody a kanalizace	SMVAKb5/15	25 000 000 25 CZK	104,20	989 583,33 CZK	27 039 583,33	1,83%
CZ0003501884 Český Aeroholding, a.s.	AEROHDb3.9/17	20 000 000 20 000 000 CZK	102,40	286 000,00 CZK	20 766 000,00	1,41%
CZ0003502155 Český Aeroholding, a.s.	AEROHDb2.7/14	7 000 000 7 000 000 CZK	101,25	168 000,00 CZK	7 255 500,00	0,49%
CZ0003510646 Czech Property Investments a. s.	CPIb6.05/16	27 000 000 2 700 CZK	99,00	-131 587,50 CZK	26 598 412,50	1,80%
XS0219645222 KBC IFIMA NV	KBCbe3.87/16	6 000 000 600 CZK	102,00	66 161,10 CZK	6 186 161,10	0,42%
XS0245704449 NIBC Bank NV	NIBCfe/16	5 000 000 1 CZK	89,51	15 750,00 CZK	4 491 250,00	0,30%
XS0259125945 SNS Bank Nederland NV	SNSbe4.05/14	19 000 000 19 CZK	101,75	107 519,18 CZK	19 440 019,18	1,32%
XS030574682 Telefónica Emisiones SAU	TELEFObe4.623/14	12 000 000 6 CZK	102,80	109 432,11 CZK	12 445 432,11	0,84%
XS0490323580 General Electric Capital Corp	GE4fe/15	12 000 000 6 CZK	100,80	87 710,00 CZK	12 183 710,00	0,83%
XS0543083298 Citigroup Inc	Cfe3/15	30 000 000 15 CZK	101,70	95 025,00 CZK	30 605 025,00	2,08%
XS0620780147 LeasePlan Corporation N.V.	LPLNfe/14	10 000 000 5 CZK	100,70	16 533,33 CZK	10 086 533,33	0,68%
XS0622499787 ČEZ, a. s.	CEZbe4.6/23	15 000 000 3 CZK	114,50	224 958,90 CZK	17 399 958,90	1,18%
XS0761852556 Telefónica Emisiones SAU	TELEFObe3.934/17	10 000 000 2 CZK	103,60	164 904,66 CZK	10 524 904,66	0,71%

XS0766345481 RCI Banque SA	RENAULfe/15	6 000 000 3	CZK	101,45	21 288,33 CZK	6 108 288,33	0,41%
XS0860033769 ING Bank N.V., Amsterdam	ING5fe/14	15 000 000 300	CZK	100,10	0,00 CZK	15 015 000,00	1,02%
XS0860033843 ING Bank N.V., Amsterdam	ING6fe/17	12 000 000 240	CZK	100,50	0,00 CZK	12 060 000,00	0,82%
XS0880210702 Crédit Agricole CIB	CACIBfe/18	19 000 000 19	CZK	101,75	22 346,11 CZK	19 354 846,11	1,31%
XS0884604728 General Electric Capital Corp	GE6fe/18	20 000 000 10	CZK	99,80	12 638,89 CZK	19 972 638,89	1,36%
XS0885329614 LeasePlan Corporation N.V.	LPLNfe/18	20 000 000 10	CZK	101,50	24 027,78 CZK	20 324 027,78	1,38%
AT0000496633 Atrium European Real Estate Ltd.	MEL1fe/17	500 000 10	EUR	100,05	1 388,89 EUR	12 931 031,07	0,88%
AT0000A0ZZD8 Slovenska Izvozná Razvojna Banka, d.d.	SEDABfe/16	1 200 000 12	EUR	97,42	18 274,50 EUR	30 606 236,11	2,08%
HU0000402664 Maďarsko	REPHUNfi/16	1 200 000 1 200 000	EUR	100,25	13 284,78 EUR	31 352 864,91	2,13%
XS0214084252 OTP Bank Rt.	OTPfe/15	1 300 000 26	EUR	92,79	2 356,25 EUR	31 156 116,77	2,11%
XS0260783005 Erste Group Bank AG	ERSTBKfe/17	1 750 000 35	EUR	94,97	2 286,67 EUR	42 900 845,50	2,91%
XS0503453275 MOL Hungarian Oil and Gas Company	MOLHBbe5.875/17	400 000 400	EUR	105,82	8 498,63 EUR	11 129 945,66	0,76%
XS0504814509 New World Resources Plc	NWRbe7.875/18	750 000 750	EUR	70,40	19 523,44 EUR	14 114 499,85	0,96%
XS0626282783 BOS Finance AB	BOSPWbe6/16	250 000 250	EUR	109,50	4 561,64 EUR	7 173 875,38	0,49%
XS0731129747 Eileme 2 AB	POLKOMbe11.75/20	300 000 300	EUR	117,39	2 937,50 EUR	9 153 692,08	0,62%
XS0750894577 Česká republika	CZECHbe3.875/22	1 400 000 1 400	EUR	111,24	14 565,75 EUR	40 522 048,56	2,75%
XS0877986231 New World Resources Plc	NWRbe7.875/21	400 000 400	EUR	40,98	3 937,50 EUR	4 326 700,51	0,29%
PL0000102646 Polsko	PLGb5.75-09/22	1 000 000 1 000	PLN	109,75	53 720,00 PLN	6 950 784,06	0,47%
PL0000104543 Polsko	PLGb5.25-10/17	2 600 000 2 600	PLN	105,91	115 570,00 PLN	17 323 690,90	1,18%
PL0000105359 Polská republika	PLGb2.75-08/23	1 650 000 1 650	PLN	120,52	726,21 PLN	12 010 907,68	0,82%
PL0000105441 Polsko	PLGb5.5-10/19	2 335 000 2 335	PLN	107,94	108 717,60 PLN	15 873 953,59	1,08%
PL0000107264 Polská republika	PLGb4-10/23	3 450 000 3 450	PLN	96,51	116 817,00 PLN	20 808 521,65	1,41%
TRSCRSIA1516 Boyner Büyük Magazacılık A.S.	BOYNRf/15	1 500 000 1 500	TRY	100,65	9 631,23 TRY	14 572 640,66	0,99%
TRSERGL31517 Ereğli Demir ve Çelik Fabrikaları T.A.S.	EREGLTf/15	700 000 7 000	TRY	98,65	23 183,01 TRY	6 845 533,21	0,46%
TRSMCBF71511 Mercedes-Benz Finansman Turk A.S.	DAIGRb10.03/15	1 250 000 1 250 000	TRY	99,45	13 396,23 TRY	12 051 506,24	0,82%
TRSPKPB61517 Pakpen Plastik Boru ve Yapı	PAKPENf/15	500 000 500 000	TRY	99,75	11 202,74 TRY	4 891 042,40	0,33%
TRSRNSHA1514 Rönesans Holding A.S.	RONHOLf/15	800 000 800	TRY	100,05	1 923,29 TRY	7 695 217,44	0,52%
TRSTISB11512 Türkiye İs Bankası A.S.	ISBANKf/15	400 000 4 000	TRY	99,65	4 520,00 TRY	3 866 391,64	0,26%
TRSTPFCK1419 Creditwest Faktoring Hizmetleri A.S.	CRDFAfe/14	1 300 000 1 300	TRY	99,75	1 765,15 TRY	12 454 276,96	0,85%
Celkem za dluhopisy						1 424 305 196,02	96,65%

Závazky a pohledávky vyplývající z investičních operací

Instrument ID Emitent	Instrument	Splatnost	Nominální hodnota	Dis. sazba	Celkem CZK	Váha
CZ0003501058 ČEZ, a. s.	CEZ1f/14 - Prodej	05.09.2013	86 753 702,88 CZK	0,20%	-505 340,62	-0,03%
CZ0003510646 Czech Property Investments a. s.	CPIb6.05/16 - výplata úroku	30.09.2013	816 750,00 CZK	0,30%	816 537,65	0,06%
CZ0001003834 Česká republika	CZgb1.5/19 - Nákup	05.09.2013	39 345 161,54 CZK	0,20%	294 794,73	0,02%
CZ0001001317 Česká republika	CZgb3.75/20 - výplata úroku	12.09.2013	2 775 000,00 CZK	0,23%	2 774 773,83	0,19%
CZ0001002851 Česká republika	CZgb3.85/21 - výplata úroku	30.09.2013	3 157 000,00 CZK	0,30%	3 156 179,22	0,21%
CZ0001001945 Česká republika	CZgb4.70/22 - výplata úroku	12.09.2013	4 371 000,00 CZK	0,23%	4 370 643,76	0,30%
CZ0001002471 Česká republika	CZgb5.00/19 - Nákup	05.09.2013	73 602 675,78 CZK	0,20%	731 881,12	0,05%
CZ0001003438 Česká republika	CZGBf/17 - Nákup	05.09.2013	41 231 448,71 CZK	0,20%	325 502,72	0,02%
CZ0001003123 Česká republika	CZgbf/23 - Nákup	05.09.2013	46 891 723,07 CZK	0,20%	487 313,89	0,03%
CZ0000000211 ECM Real Estate Investments AG	ECMf/12 - Pohledávka	31.01.2014	3 450 000,00 CZK	0,00%	3 450 000,00	0,23%
CZ0002000664 Komerční banka, a. s.	Kbh4.4/15 - Prodej	05.09.2013	138 472 038,69 CZK	0,20%	-5 542 166,63	-0,38%
XS0215426957 Gltinir Banki HF	ISFBAb3/10 - Pohledávka	31.12.2013	5 100 000,00 CZK	0,00%	5 100 000,00	0,35%
XS0214084252 OTP Bank Rt.	OTPfe/15 - Prodej	03.09.2013	281 068,75 EUR	0,10%	55 313,48	0,00%
	FX operace	30.08.2013	-2 966 792,91 CZK	0,00%	-2 966 792,91	-0,20%
	FX operace	07.10.2013	14 160 000,00 EUR	0,14%	-364 955 956,70	-24,76%
	CZK - Záloha na poplatky	30.08.2013	-2 763 161,96 CZK	0,00%	-2 763 161,96	-0,19%
	CZK - Pohledávka	30.08.2013	1 679 210,62 CZK	0,00%	1 679 210,62	0,11%
	FX operace	07.10.2013	365 048 056,80 CZK	0,32%	364 926 333,59	24,76%
Celkem za závazky a pohledávky					11 435 065,80	0,78%

Peněžní zůstatky

Měna	Zůstatek	Hodnota
CZK	36 758 408,27	36 758 408,27 CZK
USD	10 446,92	204 228,89 CZK
EUR	17 961,48	463 003,29 CZK
PLN	54 128,76	326 823,28 CZK
HUF	21 000,62	1 794,75 CZK
TRY	24 193,80	232 046,80 CZK
RON	61,82	359,56 CZK
Zůstatky celkem		37 986 664,84 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 CZK	1 053 592 873,17	71,49%
Dluhopisy EUR	235 367 856,41	15,97%
Dluhopisy PLN	72 967 857,88	4,95%
Dluhopisy TRY	62 376 608,56	4,23%
Závazky a pohledávky	11 435 065,80	0,78%
Peněžní zůstatky	37 986 664,84	2,58%
Celková hodnota	1 473 726 926,65	100,00%