

Ocenění portfolia

dle data vypořádání obchodu k 31.01.2014
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
AT0000492996 Atrium European Real Estate Ltd.	MEL2fe/15	16 000 000 8 CZK	98,00	131 266,67 CZK	15 811 266,67	1,85%
AT0000A14QE4 Erste Group Bank AG	ERSTBKfe/19	10 000 000 100 CZK	99,76	641,67 CZK	9 976 641,67	1,17%
CZ0001001903 Česká republika	CZgb4.00/17	12 000 000 1 200 CZK	110,63	385 333,33 CZK	13 661 533,33	1,60%
CZ0001002331 Česká republika	CZgbf/16	151 000 000 15 100 CZK	100,33	225 493,33 CZK	151 721 528,33	17,76%
CZ0001002471 Česká republika	CZgb5.00/19	10 000 000 1 000 CZK	119,20	401 388,89 CZK	12 321 638,89	1,44%
CZ0001002737 Česká republika	CZgb3.40/15	8 000 000 800 CZK	105,10	112 577,78 CZK	8 520 177,78	1,00%
CZ0001002851 Česká republika	CZgb3.85/21	10 000 000 1 000 CZK	113,34	129 402,78 CZK	11 463 152,78	1,34%
CZ0001003123 Česká republika	CZgbf/23	45 000 000 4 500 CZK	104,79	507 600,00 CZK	47 665 125,00	5,58%
CZ0001003438 Česká republika	CZGBf/17	115 000 000 11 500 CZK	103,36	33 733,33 CZK	118 897 158,33	13,91%
CZ0001003834 Česká republika	CZgb1.5/19	14 000 000 1 400 CZK	100,32	53 083,33 CZK	14 098 233,33	1,65%
CZ0001500110 Hlavní město Praha	PRAHAb4.25/21	48 000 000 48 CZK	113,00	1 467 666,67 CZK	55 707 666,67	6,52%
CZ0003501462 Severomoravské vodovody a kanalizace	SMVAKb5/15	9 000 000 9 CZK	104,80	93 750,00 CZK	9 525 750,00	1,11%
CZ0003501736 CETELEM CR, a.s.	CETELEMf/14	8 000 000 4 CZK	100,22	25 637,78 CZK	8 043 237,78	0,94%
CZ0003501884 Český Aeroholding, a.s.	AEROHDb3.9/17	3 500 000 3 500 000 CZK	103,80	106 925,00 CZK	3 739 925,00	0,44%
CZ0003502155 Český Aeroholding, a.s.	AEROHDb2.7/14	10 000 000 10 000 000 CZK	101,05	82 500,00 CZK	10 187 500,00	1,19%
CZ0003510646 Czech Property Investments a. s.	CPib6.05/16	12 450 000 1 245 CZK	99,00	253 167,29 CZK	12 578 667,29	1,47%
CZ0003510885 České dráhy, a.s.	CDf/18	8 000 000 2 CZK	99,88	2 893,33 CZK	7 992 893,33	0,94%
CZ0003511008 Český Aeroholding, a.s.	AEROHDb0/15	9 000 000 90 CZK	96,30	0,00 CZK	8 667 000,00	1,01%
XS0245704449 NIBC Bank NV	NIBCfe/16	5 000 000 1 CZK	93,90	9 348,61 CZK	4 704 348,61	0,55%
XS0259125945 SNS Bank Nederland NV	SNSbe4.05/14	14 000 000 14 CZK	101,35	318 452,05 CZK	14 507 452,05	1,70%
XS0305574682 Telefónica Emisiones SAU	TELEFObe4.623/14	24 000 000 12 CZK	101,75	686 990,47 CZK	25 106 990,47	2,94%
XS0490323580 General Electric Capital Corp	GE4fe/15	10 000 000 5 CZK	100,55	59 583,33 CZK	10 114 583,33	1,18%
XS0543083298 Citigroup Inc	Cfe3/15	14 000 000 7 CZK	101,55	21 404,44 CZK	14 238 404,44	1,67%
XS0620780147 LeasePlan Corporation N.V.	LPLNfe/14	14 000 000 7 CZK	100,32	2 065,00 CZK	14 046 865,00	1,64%
XS0761852556 Telefónica Emisiones SAU	TELEFObe3.934/17	5 000 000 1 CZK	106,90	165 443,56 CZK	5 510 443,56	0,64%
XS0766345481 RCI Banque SA	RENAULfe/15	8 000 000 4 CZK	101,50	12 944,44 CZK	8 132 944,44	0,95%
XS0860033769 ING Bank N.V., Amsterdam	ING5fe/14	7 500 000 150 CZK	100,07	9 056,25 CZK	7 514 306,25	0,88%

XS0860033843 ING Bank N.V., Amsterdam	ING6fe/17	5 000 000 100	CZK	100,70	10 587,50 CZK	5 045 587,50	0,59%
XS0880210702 Crédit Agricole ClB	CACIBfe/18	15 000 000 15	CZK	101,45	54 600,00 CZK	15 272 100,00	1,79%
XS0884604728 General Electric Capital Corp	GE6fe/18	4 000 000 2	CZK	99,40	8 603,33 CZK	3 984 603,33	0,47%
AT0000A0ZZD8 Slovenska Izvovzna Razvojna Banka, d.d	SEDABlfe/16	600 000 6	EUR	99,31	7 250,85 EUR	16 626 038,90	1,95%
XS0197079972 Bank of America Merrill Lynch	BAC3fe/14	500 000 500	EUR	100,11	94,00 EUR	13 801 114,81	1,62%
XS0211034466 Goldman Sachs Group Inc	GSfe/15	400 000 400	EUR	100,06	-15,11 EUR	11 032 447,77	1,29%
XS0214084252 OTP Bank Rt.	OTPfe/15	650 000 13	EUR	97,25	823,12 EUR	17 448 032,14	2,04%
XS0260783005 Erste Group Bank AG	ERSTBKfe/17	450 000 9	EUR	98,09	165,00 EUR	12 173 380,01	1,42%
XS0626282783 BOS Finance AB	BOSPWbe6/16	350 000 350	EUR	109,49	15 246,58 EUR	10 984 245,12	1,29%
XS0979598207 Západoslovenská energetika, a.s.	ZSEbe2.875/18	200 000 200	EUR	102,60	1 717,12 EUR	5 704 166,83	0,67%
Celkem za dluhopisy						736 527 150,76	86,20%

Poukázky MF

Instrument ID Emitent	Instrument	Nominální hodnota / ks	Splatnost	Výnos %	Celkem CZK	Váha	
CZ0001003974 Česká republika	MF 16/05 676	50 000 000 50	CZK	16.05.2014	0,38	49 943 674,63	5,84%
Celkem za poukázky						49 943 674,63	5,84%

Závazky a pohledávky vyplývající z investičních operací

Instrument ID Emitent	Instrument	Splatnost	Nominální hodnota	Dis. sazba	Celkem CZK	Váha	
CZ0001500110 Hlavní město Praha	PRAHAb4.25/21 - Prodej	28.02.2014	49 484 980,35 CZK	0,27%	-6 232 931,71	-0,73%	
XS0211034466 Goldman Sachs Group Inc	GSfe/15 - výplata úroku	03.02.2014	687,56 EUR	0,21%	18 953,63	0,00%	
	FX operace	31.01.2014	-301 426,42 CZK	0,00%	-301 426,42	-0,04%	
	FX operace	21.02.2014	193 000,00 EUR	0,21%	-5 319 765,95	-0,62%	
	FX operace	21.02.2014	2 930 000,00 EUR	0,21%	-80 761 213,60	-9,45%	
	CZK - Záloha na poplatky	31.01.2014	-2 245 424,25 CZK	0,00%	-2 245 424,25	-0,26%	
	CZK - Pohledávka	31.01.2014	62 856 585,97 CZK	0,00%	62 856 585,97	7,36%	
	FX operace	21.02.2014	5 319 215,10 CZK	0,22%	5 318 538,37	0,62%	
	FX operace	21.02.2014	80 219 884,00 CZK	0,22%	80 209 678,15	9,39%	
Celkem za závazky a pohledávky						53 542 994,19	6,27%

Peněžní zůstatky

Měna	Zůstatek	Hodnota
CZK	13 288 514,79	13 288 514,79 CZK
USD	56 331,38	1 151 523,54 CZK
EUR	1 207,17	33 278,05 CZK
PLN	1,65	10,70 CZK
Zůstatky celkem		14 473 327,08 CZK

Použité měnové kurzy

Měnový kurz	Kurz
CZK/EUR	27,5670
CZK/PLN	6,4849
CZK/USD	20,4420

Souhrn

Typ Instrumentu	Tržní hodnota CZK	Váha
Dluhopisy CZK	648 757 725,18	75,92%
Dluhopisy EUR	87 769 425,58	10,27%
Pokladniční poukázky CZK	49 943 674,63	5,84%
Závazky a pohledávky	53 542 994,19	6,27%
Peněžní zůstatky	14 473 327,08	1,69%
Celková hodnota	854 487 146,67	100,00%