

POLOLETNÍ ZPRÁVA

FONDU KOLEKTIVNÍHO INVESTOVÁNÍ S OZNAČENÍM:

CONSEQ MODEL PORTFOLIO AGGRESSIVE ESG, OTEVŘENÝ PODÍLOVÝ FOND

(dále jen „Fond“)

INFORMACE KE DNI 30. ČERVNA 2023

ÚDAJE A SKUTEČNOSTI

podle zákona č. 240/2013 Sb., o investičních společnostech a investičních fondech, a vyhlášky č. 244/2013 Sb., o bližší úpravě některých pravidel zákona o investičních společnostech a investičních fondech za rozhodné období 1. 1. 2023 až 30. 6. 2023

A. ÚDAJE O OSOBÁCH PROVÁDĚJÍCÍCH SPRÁVU MAJETKU (PORTFOLIO MANAŽERECH, PŘÍPADNĚ EXTERNÍCH SPRÁVCÍCH) FONDU

Obchodní firma

Conseq Funds investiční společnost, a.s. (dále jen „Obhospodařovatel“ nebo „Investiční společnost“),

IČO

248 37 202

Sídlo

Praha 1, Rybná 682/14, PSČ 110 05

Stručný popis zkušeností a znalostí

Obhospodařovatel je investiční společností vykonávající od roku 2011 mimo jiné činnost obhospodařování investičních fondů.

Hlavní osoby podílející se u Obhospodařovatele 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 MONETA 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 akcemi a skupinu investičního managementu. Ve společnosti Conseq Investment Management, a.s. a od roku 2018 v Investiční společnosti 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 Investiční společnosti a jejím operativním řízením.

Dipl.-Volksw. Anne-Françoise Blüher

Anne-Françoise Blüher studovala Trinity College v Dublinu a Christian-Albrechts-University v německém Kielu, kde získala diplom Volkswirtin (ekvivalent magisterského titulu) se specializací na kvantitativní metody. Anne-Françoise Blüher pracovala jako makroekonomka a analytička finančního trhu déle než 20 let v českém a německém finančním sektoru a to jak v investičním bankovníctví, tak i v portfolio managementu. Působila ve společnostech Union Investment ve Frankfurtě nad Mohanem, Conseq Finance, PPF a Komerční Banka. Od roku 2015 pokračovala Anne-Françoise Blüher ve společnosti Conseq Investment Management, a.s. a od roku 2018 v Investiční společnosti, kde se zabývá strategickým řízením fondových portfolií.

Ing. et Ing. Adam Šperl, CFA

Od roku 2017 působil jako portfolio manažer ve společnosti Conseq Investment Management, a.s., kde se věnoval řízení fondových portfolií a také portfolií institucionálních a retailových klientů. Od roku 2018 působil jako portfolio manažer v Investiční společnosti, kde se věnuje řízení fondových portfolií. Předtím pracoval v České pojišťovně, kde se podílel na řízení investičních rizik ve skupině Generali. Vystudoval obor Bankovnictví a pojišťovnictví na Fakultě financí a účetnictví a obor Ekonomická analýza na Národohospodářské fakultě Vysoké školy ekonomické v Praze. Je držitelem titulu Chartered Financial Analyst (CFA).

Ing. Roman Jiránek

Vystudoval obor Finance na Fakultě financí a účetnictví Vysoké školy ekonomické v Praze. Po absolvování Vysoké školy ekonomické nastoupil v roce 2016 do společnosti Conseq Investment Management, a.s. na oddělení Sales jako Investiční specialista a podpora distribučních sítí. V rámci obchodního oddělení působil jako investiční a datový analytik, poskytoval komplexní podporu pro Key Account Managery a pro distribuční sítě v ČR, na Slovensku a v Polsku. Od roku 2022 působil jako portfolio manažer v Investiční společnosti, kde se věnuje řízení fondových portfolií.

B. ÚDAJE O PODSTATNÝCH ZMĚNÁCH ÚDAJŮ UVEDENÝCH VE STATUTU FONDU

V rozhodném období došlo ke změnám údajů uvedených ve statutu Fondu v souvislosti se změnou Depozitáře a změnou vedoucích osob u Investiční společnosti, která obhospodařuje Fond.

V rozhodném období byl podán návrh na změny podstatných údajů uvedených ve statutu Fondu z důvodu přeměny speciálního fondu Conseq Indexový ETF Aggressive ESG OPF na standardní fond Conseq Model portfolio Aggressive ESG, OPF, kdy rozhodnutí ČNB ze dne 27.6.2023 o povolení přeměny speciálního fondu na standardní fond nabylo právní moci dne 13.7.2023.

C. ÚDAJE O DEPOZITÁŘI FONDU

v rozhodném období a době, po kterou činnost depozitáře vykonával

Depozitářem Fondu byla v období od 1.1.2023 do 31.3.2023 UniCredit Bank Czech Republic and Slovakia, a.s., IČO: 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“).

Depozitářem Fondu byla v období od 1.4.2023 do 30.6.2023 Společnost Conseq Investment Management, a.s., IČO: 264 42 671, se sídlem Praha 1 – Staré Město, Rybná 682/14, PSČ 110 00, zapsaná v obchodním rejstříku vedeném Městským soudem v Praze, oddíl B, vložka 7153 (dále jen „Depozitář“).

D. ÚDAJE O OSOBĚ POVĚŘENÉ ÚSCHOVOU NEBO OPATROVÁNÍM MAJETKU FONDU,

pokud je u této osoby uloženo více než 1 % hodnoty majetku Fondu

Úschovu nebo jiné opatrování majetku Fondu zajišťuje Depozitář Fondu (viz bod D).

Depozitář (UniCredit Bank Czech Republic and Slovakia, a.s.) pověřil úschovou nebo jiným opatrováním zahraničních investičních nástrojů podle druhu investičního nástroje, země emitenta a trhu, na němž byl daný investiční nástroj nakoupen, následující společnosti: CLEARSTREAM BANKING, 42 Avenue JF Kennedy, L-1855 Luxembourg, VAT ID: LU 10294056, The Bank of New York Mellon SA/NV, 46 Rue Montoyerstraat, B-1000 Brussels, Belgium, company number 0806.743.159, a banky z bankovní skupiny UniCredit (zejména UniCredit Bank Austria AG, 1010 Wien, Schottengasse 6 – 8, Rakousko,

UniCredit Bank Hungary Zrt., Szabadság tér 5-6, H-1054 Budapest, Maďarsko, a Bank Polska Kasa Opieky S.A., ul. Grzybowska 53/57, 00-950, Warsaw, Polsko).

Depozitář (Conseq Investment Management, a.s.) pověřil úschovou nebo jiným opatrováním některých zahraničních investičních nástrojů a vypořádáním obchodů společnost UniCredit Bank Czech Republic and Slovakia, a.s., se sídlem Praha 4 – Michle, Želetavská 1525/1, PSČ 140 92, IČ: 649 48 242, zapsaná v obchodním rejstříku vedeném Městským soudem v Praze, oddíl B, vložka 3608. Depozitář má zřízen u uvedeného subjektu účet cenných papírů, na kterém jsou evidovány cenné papíry v majetku Fondu, tzn. odděleně od cenných papírů Depozitáře a jiných klientů. Depozitář o tom vede ve své evidenci nezbytné záznamy a písemnosti.

E. ÚDAJE O HLAVNÍM PODPŮRCI,
v rozhodném období a době, po kterou činnost hlavního podpůrce vykonával

Činnost hlavního podpůrce ve vztahu k majetku Fondu nevykonávala v rozhodném období žádná osoba.

F. IDENTIFIKACE MAJETKU FONDU
pokud jeho hodnota přesahuje 1 % hodnoty majetku Fondu ke dni 30. června 2023, s uvedením celkové pořizovací ceny a reálné hodnoty na konci rozhodného období

Dluhové CP v majetku Fondu:

Název CP (popř. emitent CP)	ISIN	Celková pořizovací cena v tis. Kč	Celková reálná hodnota v tis. Kč k 30. 6. 2023
iShares_EM_SRI	IE00BYVJRP78	7 696	7 186
iShares_EMU_ESG_EN	IE00BHZPJ015	1 054	1 076
iShares_EMU_SRI	IE00BJLKK341	2 414	2 399
iShares_EU_QualDiv	IE00BYYHSM20	3 622	3 664
iShares_EUR_Infl_B	IE00B0M62X26	1 702	1 559
iShares_EURGovB0_1	IE00B3FH7618	2 726	2 702
iShares_Europe_SRI	IE00B52VJ196	11 128	11 469
iShares_GloCIE_Acc	IE000U58J0M1	5 261	4 608
iShares_Japan_SRI	IE00BYX8XC17	3 828	3 680
iShares_S&P500MinV	IE00B6SPMN59	7 014	7 171
iShares_US_ESG_EN	IE00BHZPJ890	10 841	10 973
iShares_US_ESG_SCR	IE00BFNM3G45	5 579	5 919
iShares_US_Gov20Y	IE00BFM6TC58	2 414	1 993
iShares_US_SRI	IE00BYVJRR92	15 537	16 616
iShares_US_TIPS	IE00B1FZSC47	2 518	2 308
iShares_USTres7_10	IE00B1FZS798	1 853	1 687

Majetek	Požizovací cena v tis. Kč	Reálná hodnota v tis. Kč k 30. 6. 2023
Pohledávky za bankami	1 525	1 525

G. HODNOTA VŠECH VYPLACENÝCH PODÍLŮ NA ZISKU NA JEDEN PODÍLOVÝ LIST

Fond od svého vzniku emitoval podílové listy třídy A a třídy B. Zisk připadající na podílové listy Fondu třídy A a třídy B se odráží ve zvýšené hodnotě podílových listů těchto tříd.

H. ÚDAJE O SKUTEČNĚ ZAPLACENÉ ÚPLATĚ OBHOSPODAŘOVATELI ZA OBHOSPODAŘOVÁNÍ MAJETKU 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. ledna – 30. června 2023 činily náklady na úplatu za obhospodařování majetku Fondu 457 tis. Kč.

Za období 1. ledna – 30. června 2023 nevznikly Fondu žádné náklady za výkon funkce depozitáře ani za náklady na ostatní služby depozitáře, ani náklady na služby auditora, protože byla přeúčtovány Obhospodařovateli.

Za období 1. ledna – 30. června 2023 byla vyčíslena splatná daň z příjmů ve výši 0 tis. Kč.

I. RIZIKA SOUVISEJÍCÍ S DERIVÁTY, KVANTITATIVNÍ OMEZENÍ A METODY HODNOCENÍ RIZIK, které byly zvoleny pro hodnocení rizik spojených s technikami obhospodařování Fondu za rozhodné období, včetně údajů o protistranách obchodů, druhu a výši přijatého zajištění, výnosech a nákladech spojených s použitím těchto technik, a informace o investičních limitech ve vztahu k derivátům sjednaným na účet tohoto Fondu

Rizika související s deriváty

Rizika spojená s finančními typy derivátů jsou v zásadě rizika tržní, a to buď měnová či úroková podle podkladového aktiva derivátu, a úvěrové riziko protistrany. V případě derivátů je třeba upozornit na důsledky pákového efektu, které obecně znamenají, že i mírná změna ceny podkladového nástroje, od kterého je derivát odvozen, znamená relativně velkou změnu ceny derivátu.

Kvantitativní omezení

zvolené pro hodnocení rizik spojených s technikami obhospodařování Fondu

Fond může používat finanční deriváty pouze za účelem snížení rizik z investování Fondu, zejména pak rizik směnných kurzů Fondu. Dluhy Fondu vyplývající z použití finančních derivátů musí být vždy plně kryty jeho majetkem. Fond může uzavírat repo obchody za účelem snížení rizika z investování Fondu, snížení nákladů Fondu, nebo dosažení dodatečných výnosů pro Fond.

Kvantitativní omezení

zvolené pro hodnocení rizik spojených s řízením portfolia Fondu

Kvantitativní omezení jsou vymezena ve statutu Fondu v souladu s nařízením vlády č. 243/2013 Sb., o investování investičních fondů a o technikách k jejich obhospodařování (dále jen „Nařízení vlády“).

Metody

zvolené pro hodnocení rizik spojených s řízením portfolia a technikami obhospodařování Fondu

Při řízení rizik vyplývajících z použití investičních nástrojů, které jsou součástí majetku Fondu, uplatňuje Společnost následující metody:

- a) monitorování a kontrola dodržování relevantních pravidel rozložení a omezení rizik (investiční limity a pravidla) daných obecně závaznými právními předpisy a statutem Fondu,
- b) monitorování vývoje volatility výkonnosti Fondu vyjádřené směrodatnou odchylkou vypočtenou z 36 měsíčních výkonností podílových listů Fondu v ročním vyjádření,
- c) monitorování událostí operačního rizika.

Investiční společnost zajišťuje úvěrové riziko u derivátů a repo obchodů dle pravidel stanovených statutem Fondu a Nařízením vlády. Společnost dále sleduje vývoj úvěrových ratingů investičních nástrojů.

J. ROČNÍ ODCHYLKA SLEDOVÁNÍ MEZI VÝKONNOSTÍ FONDU A VÝKONNOSTÍ SLEDOVANÉHO INDEXU,

pokud Fond sleduje určitý index nebo jiný finanční kvantitativně vyjádřený ukazatel (benchmark), včetně vysvětlení rozdílů mezi očekávanou a skutečnou odchylkou sledování za příslušné období

Fond nekopíruje ani nehodlá kopírovat složení žádného indexu, resp. benchmarku. Fond kopíruje/sleduje složení skladby aktiv Modelového portfolia (dle Statutu).

K. CELKOVÝ POČET PODÍLOVÝCH LISTŮ FONDU,

kteřé jsou v oběhu ke dni 30. 6. 2023 a které byly vydány a odkoupeny v rozhodném období

Fond v rozhodném období emitoval v rámci třídy A (ISIN CZ0008476181) 18 410 628 podílových listů a zároveň odkoupil 2 819 794 podílových listů Fondu třídy A. K 30. červnu 2023 bylo tedy v oběhu 85 673 034 podílových listů Fondu třídy A.

Fond v rozhodném období emitoval v rámci třídy B (ISIN CZ0008476199) 288 880 podílových listů a zároveň odkoupil 0 podílových listů Fondu třídy B. K 30. červnu 2023 bylo tedy v oběhu 1 961 102 podílových listů Fondu třídy B.

L. FONDOVÝ KAPITÁL PŘIPADAJÍCÍ NA JEDEN PODÍLOVÝ LIST

K 30. červnu 2023 připadl na jeden podílový list Fondu třídy A (ISIN CZ0008476181) fondový kapitál ve výši 1,0421 Kč.

K 30. červnu 2023 připadl na jeden podílový list Fondu třídy B (ISIN CZ0008476199) fondový kapitál ve výši 1,0524 Kč.

M. SKLADBA A ZMĚNY SKLADBY MAJETKU FONDU

Podíl v % na aktivech celkem	30. června 2023	30. června 2022
Pohledávky za bankami	1,67 %	1,46 %
Akcie, Podílové listy a ostatní podíly	96,50 %	98,08 %
Ostatní aktiva	1,83 %	0,46 %

N. INFORMACE TÝKAJÍCÍ SE SFT A SWAPŮ VEŠKERÝCH VÝNOSŮ

Na účet Fondu nebyly v rozhodném období uskutečněny žádné SFT ani swapy veškerých výnosů.

O. VYBRANÉ FINANČNÍ ÚDAJE FONDU

ROZVAHA K 30. ČERVNU 2023

Aktiva

tis. Kč	30. června 2023	30. června 2022
Pohledávky za bankami	1 525	803
v tom: a) splatné na požádání	1 525	803
Akcie, podílové listy, ostatní podíly	88 267	53 854
Ostatní aktiva	1 678	250
Aktiva celkem	91 470	54 907

Pasiva

tis. Kč	30. června 2023	30. června 2022
Ostatní pasiva	129	483
Rezervy	0	0
v tom: b) na daně	0	0
Kapitálové fondy	90 161	61 526
Nerozdělený zisk/neuhrazená ztráta z předchozích období	- 6020	2 502
Zisk/ztráta za účetní období	7 200	- 9 604
Pasiva celkem	91 470	54 907

CONSEQ

Datum sestavení

29. srpna 2023

Podpis statutárního zástupce

Ing. Jan Vedral

