

Ocenění portfolia

dle data vypořádání obchodu k 31.01.2014
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
AT0000A0ZZD8 Slovenska Izvovzna Razvojna Banka, d.d	SEDABIfe/16	700 000 7 EUR	99,31	8 459,32 EUR	19 397 045,38	3,70%
HU0000402664 Maďarsko	REPHUNfi/16	800 000 800 000 EUR	100,25	5 330,39 EUR	22 255 675,96	4,24%
SI0002102984 Ministerstvo financí Slovinsko	SLOREPb4.625/24	650 000 650 EUR	98,42	11 860,27 EUR	17 961 940,47	3,42%
XS0541470075 Republika Černá Hora	MONTENbe7.875/15	300 000 300 EUR	105,41	8 996,92 EUR	8 965 612,82	1,71%
XS0877986231 New World Resources Plc	NWRbe7.875/21	500 000 500 EUR	17,49	1 640,63 EUR	2 456 374,68	0,47%
PL0000102646 Polsko	PLGb5.75-09/22	1 660 000 1 660 PLN	107,39	33 996,80 PLN	11 780 893,95	2,25%
PL0000104543 Polsko	PLGb5.25-10/17	4 650 000 4 650 PLN	104,66	65 565,00 PLN	31 983 579,00	6,10%
PL0000105359 Polská republika	PLGb2.75-08/23	9 000 000 9 000 PLN	120,66	125 012,00 PLN	71 231 589,97	13,58%
PL0000105441 Polsko	PLGb5.5-10/19	9 001 000 9 001 PLN	105,97	132 944,77 PLN	62 720 177,12	11,95%
PL0000105953 Polsko	PLGb5.5-04/15	1 600 000 1 600 PLN	103,14	67 744,00 PLN	11 140 921,80	2,12%
PL0000107264 Polská republika	PLGb4-10/23	4 500 000 4 500 PLN	94,49	48 330,00 PLN	27 886 723,01	5,31%
RO0717DBN038 Rumunsko	ROMGB6.75/17	5 000 000 500 RON	108,03	216 369,86 RO	34 407 420,85	6,56%
RO1215DBN073 Rumunsko	ROMGB5.8/15	3 000 000 300 RON	103,79	46 241,10 RO	19 352 078,07	3,69%
RO1323DBN018 Rumunsko	ROMGB5.85/23	1 500 000 150 RON	101,97	67 315,07 RO	9 779 737,38	1,86%
TRSCKB11511 Bank Pozitif Ve Kalkinma Ban	BNKPOZb10.4/15	800 000 800 TRY	99,83	6 610,41 TRY	7 280 324,42	1,39%
TRSCRSIA1516 Boyner Büyük Magazacilik A.S.	BOYNRF/15	1 000 000 1 000 TRY	100,70	2 842,74 TRY	9 130 511,31	1,74%
TRSEVA61615 Deva Holding A.S.	DEVAf/16	120 000 120 TRY	99,20	781,15 TRY	1 083 365,09	0,21%
TRSERGL31517 Eregli Demir ve Çelik Fabrikalari T.A.S.	EREGLTf/15	700 000 7 000 TRY	100,05	29 131,55 TRY	6 595 620,59	1,26%
TRSMCBF71511 Mercedes-Benz Finansman Turk A.S.	DAIGRb10.03/15	550 000 550 000 TRY	96,20	2 115,92 TRY	4 802 998,28	0,92%
TRSPKB61517 Pakpen Plastik Boru ve Yapi	PAKPENf/15	400 000 400 000 TRY	98,90	8 250,30 TRY	3 651 419,77	0,70%
TRSRNSHA1514 Rönesans Holding A.S.	RONHOLf/15	500 000 500 TRY	98,45	1 809,73 TRY	4 467 049,91	0,85%
TRSTPFCK1419 Creditwest Faktoring Hizmetleri A.S.	CRDFAfe/14	750 000 750 TRY	100,10	1 695,82 TRY	6 803 252,44	1,30%
TRT010420T19 Turecko	TURKGB4 04/20	1 425 000 14 250 TRY	133,71	23 168,84 TRY	17 437 045,39	3,32%
TRT060121T16 Turecko	TURKGB3 01/21	1 300 000 1 300 000 TRY	120,83	2 136,85 TRY	14 221 702,11	2,71%
TRT080323T10 Turecko	TURKGB7.1 03/23	3 000 000 3 000 000 TRY	83,10	78 780,82 TRY	23 254 158,82	4,43%
TRT110215T16 Turecko	TURKGB4.5 02/15	500 000 500 000 TRY	135,20	14 009,08 TRY	6 238 914,53	1,19%
TRT120122T17 Turecko	TURKGB9.5 01/22	1 300 000 1 300 000 TRY	97,12	3 045,21 TRY	11 442 639,63	2,18%

TRT150120T16 Turecko	TURKGB10.5 01/20	475 000 TRY 475 000	101,27	1 229,79 TRY	4 360 512,06	0,83%
TRT210721T11 Turecko	TURKGB3 07/21	1 400 000 TRY 14 000	115,60	275,20 TRY	14 635 364,10	2,79%
XS0546767863 Yasar Holding A.S. (via Willow No.2 PLC)	YASARbe9.625/15	650 000 USD 650	98,06	19 637,67 USD	13 431 129,45	2,56%
XS0853036860 Hrvatska Elektroprivreda	HEPbe6/17	200 000 USD 200	102,53	2 700,00 USD	4 246 918,36	0,81%
XS0995679619 Ministerstvo financí Srbsko	SERBIAb5.875/18	200 000 USD 200	102,15	1 860,42 USD	4 214 505,94	0,80%
Celkem za dluhopisy					508 617 202,67	96,93%

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	0,29%
PL0000102646 Polsko	PLGb5.75-09/22 - Nákup	03.02.2014	1 655 175,00 PLN	2,58%	-85 916,60	-0,02%
TRSTISB21511 Türkiye İs Bankası A.S.	ISBANK0 02/15 - Nákup	04.02.2014	447 920,00 TRY	0,50%	4 718,12	0,00%
	CZK-10irs - Pohledávka	31.01.2014	165 000,00 USD	0,00%	3 372 922,58	0,64%
	FX operace	31.01.2014	-7 179 460,99 CZK	0,00%	-7 179 460,99	-1,37%
	CZK - Pohledávka	31.01.2014	20 105 861,94 CZK	0,00%	20 105 861,94	3,83%
	CZK - Záloha na poplatky	31.01.2014	-1 773 444,65 CZK	0,00%	-1 773 444,65	-0,34%
	FX operace	21.02.2014	18 853 000,00 EUR	0,21%	-519 655 686,01	-99,04%
	FX operace	21.02.2014	193 000,00 EUR	0,21%	5 319 765,95	1,01%
	FX operace	21.02.2014	195 000,00 EUR	0,21%	5 374 893,06	1,02%
	FX operace	21.02.2014	200 000,00 EUR	0,21%	5 512 710,83	1,05%
	FX operace	21.02.2014	212 000,00 EUR	0,21%	5 843 473,48	1,11%
	FX operace	21.02.2014	264 000,00 EUR	0,21%	7 276 778,29	1,39%
	FX operace	21.02.2014	200 000,00 EUR	0,21%	5 512 710,83	1,05%
	FX operace	03.02.2014	1 655 000,00 PLN	2,58%	10 730 168,09	2,04%
	FX operace	21.02.2014	5 361 228,60 CZK	0,22%	-5 360 546,53	-1,02%
	FX operace	21.02.2014	5 498 192,00 CZK	0,22%	-5 497 492,50	-1,05%
	FX operace	21.02.2014	5 820 733,48 CZK	0,22%	-5 819 992,95	-1,11%
	FX operace	21.02.2014	7 263 534,96 CZK	0,22%	-7 262 610,87	-1,38%
	FX operace	21.02.2014	5 502 692,00 CZK	0,22%	-5 501 991,93	-1,05%
	FX operace	21.02.2014	516 172 516,40 CZK	0,22%	516 106 847,18	98,36%
	FX operace	21.02.2014	5 319 215,10 CZK	0,22%	-5 318 538,37	-1,01%
	FX operace	03.02.2014	10 807 977,50 CZK	0,16%	-10 807 836,40	-2,06%
Celkem za závazky a pohledávky					12 397 332,53	2,36%

Peněžní zůstatky

Měna	Zůstatek	Hodnota
CZK	2 535 026,26	2 535 026,26 CZK
USD	24 880,24	508 600,75 CZK
EUR	768,49	21 184,96 CZK
PLN	3 545,55	22 992,47 CZK
HUF	45 758,01	4 040,71 CZK
TRY	61 300,88	554 253,01 CZK
RON	7 853,38	48 097,19 CZK
Zůstatky celkem		3 694 195,34 CZK

Použité měnové kursy

Měnový kurz	Kurz
CZK/EUR	27,5670
CZK/HUF	0,0883
CZK/PLN	6,4849
CZK/RON	6,1244
CZK/TRY	9,0415
CZK/USD	20,4420

Souhrn

Typ Instrumentu	Tržní hodnota CZK	Váha
Dluhopisy PLN	216 743 884,85	41,31%
Dluhopisy TRY	135 404 878,47	25,81%
Dluhopisy EUR	71 036 649,31	13,54%
Dluhopisy RON	63 539 236,30	12,11%
Dluhopisy USD	21 892 553,75	4,17%
Závazky a pohledávky	12 397 332,53	2,36%
Peněžní zůstatky	3 694 195,34	0,70%
Celková hodnota	524 708 730,55	100,00%