

POLOLETNÍ ZPRÁVA

FONDU S NÁZVEM:

CONSEQ TRANSFORMOVANÝ FOND CONSEQ PENZIJNÍ SPOLEČNOSTI, A. S.

INFORMACE KE DNI 30. června 2020

I. OBECNÉ ÚDAJE A SKUTEČNOSTI podle zákona č. 427/2011 Sb. a vyhlášky č. 117/2012 Sb.

A. ZÁKLADNÍ ÚDAJE O FONDU

Název transformovaného fondu

Conseq Transformovaný fond Conseq penzijní společnosti, a. s.
(dále jen „Fond“)

B. ÚDAJE O PENZIJNÍ SPOLEČNOSTI, KTERÁ FOND OBHOSPODAŘUJE, a případně o všech dalších penzijních společnostech, které Fond obhospodařovaly v rozhodném období, spolu s uvedením doby, po kterou každá penzijní společnost Fond obhospodařovala

Název penzijní společnosti:

Conseq penzijní společnost, a.s. (dále jen „Společnost“)
zapsaná v obchodním rejstříku vedeném Městským soudem v Praze, oddíl B, vložka
12020

IČO

279 16 430

Sídlo

Rybna 682/14, Staré Město, 110 00 Praha 1

Další údaje

Společnost obhospodařuje Fond na základě rozhodnutí ČNB ze dne 12. 10. 2012,
kterým jí bylo s účinností od 01. 01. 2013 uděleno povolení k provozování penzijního
připojištění prostřednictvím transformovaného fondu.

C. ÚDAJE O PORTFOLIO MANAŽERECH FONDU

Obchodní firma

Conseq Investment Management, a.s. (dále jen „Portfolio Manažer“)
zapsaná v obchodním rejstříku vedeném Městským soudem v Praze, oddíl B, vložka
7153

IČO

264 42 671

Sídlo

Rybna 682/14, Staré Město, 110 00 Praha 1

Další údaje

Smlouva o obhospodařování týkající se finančních aktiv v majetku Fondu byla
uzavřena mezi Portfolio Manažerem a Společností s účinností ode dne 2. ledna
2014, ve znění pozdějších dodatků.

Hlavní osoby podílející se u Portfolio Manažera na obhospodařování Fondu

Ing. Jan Vedral

Obchodní fakulty Vysoké školy ekonomické v Praze pracoval v Investiční bance.
V roce 1992 nastoupil do Agrobanky Praha 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 spol. s r.o.
(následně Conseq Finance, a.s.), 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., která vznikla v roce 2001 jako dceřiná společnost Conseq Finance spol. s r.o., s cílem rozvíjet služby portfolio managementu a které Společnost svěřila obhospodařování finančních aktiv v účastnických fondech a v transformovaném fondu, působí Jan Vedral jako předseda představenstva a hlavní investiční manažer. Zde vede investiční tým a stanovuje hlavní investiční strategie. Dnes patří Jan Vedral k předním českým investičním manažerům a je členem dozorčí rady Burzy cenných papírů Praha, a.s.

Ing. Ondřej Matuška

Absolvoval Fakultu financí a účetnictví, obor Finance, Vysoké školy ekonomické v Praze. Při studiu působil jako odborný redaktor v Hospodářských novinách, vydavatelství Economia, a.s. a následně jako analytik v Erste Bank Sparkassen (CR), a.s. V roce 2000 nastoupil jako junior portfolio manager do společnosti Conseq Finance spol. s r.o., odkud v roce 2001 přešel do společnosti Conseq Investment Management, a.s., kde působí dodnes jako senior portfolio manager, vedoucí oddělení portfolio managementu a člen představenstva společnosti. Je primárně odpovědný za obhospodařování dluhopisových složek klientských portfolií, tvorbu a schvalování investičních strategií a též řízení likvidity společnosti.

Ing. Martin Pavlík

Během studií na Fakultě financí a účetnictví na Vysoké škole ekonomické v Praze pracoval ve znaleckém ústavu VOX CONSULT, s.r.o. Po absolvování hlavní specializace Bankovníctví a Pojišťovnictví a vedlejší specializace Oceňování podniku, nastoupil v roce 2008 do společnosti Conseq Investment Management, a.s., kde působil na pozici portfolio manažera zodpovědného za fondová portfolia. Od roku 2012 je hlavním portfolio manažerem zodpovědným za akciová portfolia.

D. ÚDAJE O DEPOZITÁŘI FONDU

v rozhodném období a době, po kterou činnost depozitáře vykonávali

Depozitářem byla po celou dobu existence Fondu Česká spořitelna, a.s., IČO 452 44 782, se sídlem Praha 4, Olbrachtova 1929/62, PSČ 140 00, zapsaná v obchodním rejstříku vedeném Městským soudem v Praze, oddíl B, vložka 1171 (dále jen „Depozitář“).

E. ÚDAJE O OSOBĚ ZAJIŠŤUJÍCÍ ÚSCHOVU NEBO KONTROLU STAVU MAJETKU FONDU,

pokud je u této osoby uloženo nebo je touto osobou kontrolován stav více než 1 % majetku Fondu

Úschovu nebo kontrolu stavu majetku Fondu zajišťuje pouze Depozitář Fondu.

F. IDENTIFIKACE MAJETKU FONDU, JEHOŽ HODNOTA PŘESAHUJE 1 % HODNOTY MAJETKU FONDU KE DNI 30. ČERVNA 2020, s uvedením celkové pořizovací ceny a reálné hodnoty na konci rozhodného období:

| Název | | Zůstatek v tis. Kč | |
|-----------------------|--------------|---------------------------|--------------------------|
| Pohledávky za bankami | | 3 209 525 | |
| Název | ISIN | Pořizovací cena v tis. Kč | Reálná hodnota v tis. Kč |
| CEBfe/21 | XS1082830255 | 98 453 | 96 138 |
| CeFoPudyBCZK | MT7000011102 | 56 210 | 84 905 |
| CZgb0.10/22 | CZ0001005946 | 128 226 | 130 073 |
| CZgb2.5/28 | CZ0001003859 | 134 942 | 95 443 |
| CZGBf/20 | CZ0001004113 | 981 639 | 977 731 |
| CZgbf/27 | CZ0001004105 | 100 271 | 99 613 |
| EIBfe/34 | XS1070715633 | 100 000 | 101 038 |
| HYPONOEfe/20 | AT0000A1GD94 | 109 026 | 109 056 |
| MF 10/07 I 814 | CZ0001005953 | 748 523 | 749 975 |
| MF 26/03 I 813 | CZ0001005938 | 513 510 | 519 882 |

G. ÚDAJE O SKLADBĚ A ZMĚNÁCH MAJETKU FONDU

| Podíl v % na aktivech celkem | 30. června 2020 | 30. června 2019 |
|---------------------------------------|-----------------|-----------------|
| Pokladní hotovost | 0,00% | 0,00% |
| Pohledávky za bankami | 37,89% | 39,37% |
| Pohledávky za nebankovními subjekty | 0,00% | 0,00% |
| Dluhové cenné papíry | 58,39% | 56,80% |
| v tom: a) vydané vládními institucemi | 33,12% | 27,85% |
| b) vydané ostatními osobami | 25,28% | 28,95% |
| Akcie, podílové listy | 1,00% | 1,03% |
| Účasti s rozhodujícím vlivem | 0,00% | 0,00% |
| Dlouhodobý majetek | 2,63% | 2,71% |
| Náklady a příjmy příštích období | 0,01% | 0,00% |
| Ostatní aktiva | 0,08% | 0,09% |

H. ÚDAJE O ÚPLATĚ URČENÉ SPOLEČNOSTI ZA OBHOSPODAŘOVÁNÍ MAJETKU FONDU

Za období 01.01.2020 – 30.06.2020 činily náklady na obhospodařování majetku Fondu 33 486 tis. Kč a náklady za zhodnocení majetku Fondu 2 003 tis. Kč

I. ÚDAJE O FONDOVÉM VLASTNÍM KAPITÁLU FONDU A FONDOVÉM VLASTNÍM KAPITÁLU PŘIPADAJÍCÍM NA JEDNU PENZIJNÍ JEDNOTKU k 30. červnu 2020 a za poslední tři uplynulá období

| | NAV |
|------------|------------------|
| 30.06.2020 | 8 435 999 157,36 |
| 31.12.2019 | 8 274 409 326,30 |
| 30.06.2019 | 8 010 373 912,60 |
| 31.12.2018 | 7 760 468 312,14 |

Fond neeviduje penzijní jednotky, proto zde není uvedena žádná hodnota.

V Praze dne 24.8.2020


Conseq penzijní společnost, a.s.
Ing. Jan Vedral
předseda představenstva