

POLOLETNÍ ZPRÁVA

FONDU S NÁZVEM:

CONSEQ

TRANSFORMOVANÝ FOND

CONSEQ DŮCHODOVÉ

PENZIJNÍ SPOLEČNOSTI,

A. S.

INFORMACE KE DNI 30. června 2015

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

A. ZÁKLADNÍ ÚDAJE O FONDU

Název účastnického fondu

Conseq Transformovaný fond Conseq důchodové 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
12020¹

IČ

279 16 430

Sídlo

Rybná 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

IČ

264 42 671

Sídlo

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

Další údaje

Smlouva o svěřeni obhospodařování finančních aktiv v majetku Fondu byla uzavřena
se společností Conseq penzijní společnost, a.s. s účinností ode dne 2. ledna 2014.

Hlavní osoby podílející se u Portfolio Manažera na řízení Společnosti

Ing. Jan Vedral

Po absolvování Obchodní fakulty Vysoké školy ekonomické v Praze pracoval
v Investiční bance. V roce 1992 nastoupil do Agrobanky Praha (dnes GE 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 akciemi
a skupinu investičního managementu. V Conseq Investment Management pokračuje
Jan Vedral jako hlavní investiční manažer, který vede investiční tým a stanovuje

¹ Společnost byla na počátku rozhodného období, tedy od 1. ledna 2015, zapsána v obchodním rejstříku
pod obchodní firmou (název) Conseq důchodová penzijní společnost, a.s., avšak k datu 6. února 2015
svoji obchodní firmu (název) změnila na Conseq penzijní společnost, a.s.

hlavní investiční strategie. Spolu s Hanou Blovskou se podílí na rozhodování o obchodní politice firmy a jejím operativním řízení.

Ing. Ondřej Matuška

Absolvoval Fakultu financí a účetnictví Vysoké školy ekonomické v Praze. Při studiu pracoval v Hospodářských novinách jako odborný redaktor pro oblast zahraničních kapitálových trhů. Po ukončení studia působil kratší dobu jako analytik v oddělení komerčního bankovníctví Erste Bank Sparkassen CR, později České spořitelny. Do společnosti Conseq Finance nastoupil v roce 2000. Jako junior portfolio manažer zodpovídal za řízení cash-flow clientských portfolií a exekuci investičních rozhodnutí. Od roku 2003 působí jako portfolio manažer v Conseq Investment Management, kde je primárně odpovědný za dluhopisové složky clientských portfolií a za fondy Conseq Invest Dluhopisový, Konzervativní dluhopisový a Dluhopisů Nové Evropy. V investičním týmu s Janem Vedralem se podílí na vytváření investičních strategií. V srpnu roku 2008 byl zvolen členem představenstva.

Ing. Martin Pavlík

Během studií na fakultě Financí 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., IČ: 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 JINÉ OPATROVÁNÍ MAJETKU FONDU,

pokud je u této osoby uloženo nebo touto osobou jinak opatrováno více než 1 % majetku Fondu

Úschovu nebo jiné opatrování majetku Fondu zajišťuje pouze Depozitář Fondu.

F. IDENTIFIKACE MAJETKU, JEHOŽ HODNOTA PŘESAHUJE 1 % HODNOTY MAJETKU FONDU

ke dni 30. června 2015, s uvedením celkové pořizovací ceny a reálné hodnoty na konci rozhodného období:

Název		Požizovací cena	Reálná hodnota k 30. 6 2015
Pohledávky za bankami		-	788 077 214 Kč
Dlouhodobý hmotný majetek		167 839 997 Kč	192 867 320 Kč
Název	ISIN	Požizovací cena	Reálná hodnota k 30. 06.2015
CACIBfe/19	XS1040279462	50 000 000 Kč	50 062 583 Kč
CDf/18	CZ0003510885	99 855 888 Kč	101 853 472 Kč
CEBfe/16	XS0940439994	81 776 441 Kč	81 629 453 Kč
CEBfe/21	XS1082830255	68 702 900 Kč	69 020 873 Kč
CeFoPudyBCZK	MT7000011102	35 387 234 Kč	36 117 483 Kč
CETELEMf/16	CZ0003510844	50 050 000 Kč	50 008 917 Kč
CETELEMf/19	CZ0003511529	30 000 000 Kč	30 031 792 Kč
CZgb0.5/16	CZ0001003842	60 300 000 Kč	60 315 667 Kč
CZgb3.40/15	CZ0001002737	34 683 407 Kč	34 255 224 Kč
CZgbf/16	CZ0001002331	742 626 847 Kč	743 501 801 Kč
CZGBf/17	CZ0001003438	690 241 564 Kč	693 432 337 Kč
CZGBf/20	CZ0001004113	444 283 860 Kč	445 639 688 Kč
CZgbf/23	CZ0001003123	75 980 400 Kč	80 846 333 Kč
DTbe6/17	DE000A0T5X07	5 479 688 Kč	6 072 451 Kč
EIBfe/29	XS1057735018	30 075 000 Kč	30 930 933 Kč
EIBfe/34	XS1070715633	100 000 000 Kč	102 035 417 Kč
ENISPAbe5/16	XS0411044653	59 333 695 Kč	57 126 439 Kč
ERSTBKfe/17	XS0260783005	17 410 741 Kč	16 951 895 Kč
ERSTBKfe/19	AT0000A14QE4	100 000 000 Kč	100 524 250 Kč
ERSTBKfe/23	AT0000A1E879	60 000 000 Kč	60 343 583 Kč
GSfe/19	XS1130101931	27 676 870 Kč	27 380 904 Kč
GSfe/20	US38148LAB27	24 754 815 Kč	24 707 940 Kč
HEPbe6/17	XS0853036860	47 074 752 Kč	44 980 687 Kč
KBhf/18	CZ0002003064	69 999 761 Kč	70 924 000 Kč
LITGBbe3.75/16	XS0212170939	86 381 237 Kč	84 751 721 Kč
LLOYDSfe/21	XS1143451992	49 900 000 Kč	49 365 238 Kč
MBANKf/18	PLRHNHP00359	47 897 500 Kč	47 843 242 Kč
MF 04/09 698	CZ0001004360	124 911 590 Kč	124 993 125 Kč
MF 10/06 710	CZ0001004527	99 949 470 Kč	99 908 458 Kč

Název	ISIN	Pořizovací cena	Reálná hodnota k 30. 06.2015
MF 10/07 696	CZ0001004345	249 797 941 Kč	249 998 314 Kč
MF 12/02 708	CZ0001004501	149 977 253 Kč	149 942 851 Kč
MF 19/02 705	CZ0001004444	449 772 615 Kč	449 818 723 Kč
MF 22/04 707	CZ0001004493	149 984 835 Kč	149 902 301 Kč
MF 25/03 711	CZ0001004535	109 958 307 Kč	109 942 676 Kč
NETGASbe2.25/21	XS1090620730	69 470 800 Kč	72 312 205 Kč
PEGASb2.85/18	CZ0000000559	59 749 800 Kč	61 811 500 Kč
PLgb0-01/24	PL0000107454	22 101 589 Kč	22 323 479 Kč
PLgb3.25-07/25	PL0000108197	85 121 138 Kč	79 503 052 Kč
PLgb4-10/23	PL0000107264	62 014 699 Kč	58 392 459 Kč
PRAHAb4.25/21	CZ0001500110	19 935 031 Kč	23 549 694 Kč
SantanUKfe/19	XS1070235004	54 980 000 Kč	54 793 459 Kč
SKDATRb3/20	CZ0003512683	29 739 000 Kč	29 869 000 Kč
SLOVGBf/15	SK4120008400	50 172 744 Kč	50 466 667 Kč
VOESTb2.25/21	AT0000A19S18	54 499 469 Kč	55 099 095 Kč
VWfe/19	XS1054089609	55 000 000 Kč	55 164 924 Kč
YASARbe8.875/20	XS1132450427	42 185 060 Kč	43 383 574 Kč
CZgb2.5/28	CZ0001003859	91 006 300 Kč	93 532 107 Kč

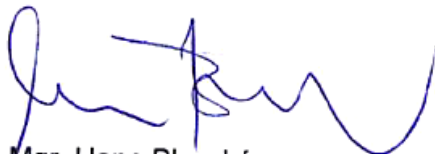
G. ÚDAJE O SKLADBĚ A ZMĚNÁCH MAJETKU FONDU

Podíl v % na aktivech celkem	30. června 2014	30. června 2015
Pokladní hotovost	0,00 %	0,00 %
Pohledávky za bankami	9,81 %	12,65 %
Pohledávky za nebankovními subjekty	0,00 %	0,00 %
Dluhové cenné papíry	90,03 %	83,48 %
v tom: a) vydané vládními institucemi	70,99 %	60,72 %
b) vydané ostatními osobami	19,03 %	22,76 %
Akcie, podílové listy	0,00 %	0,58 %
Účasti s rozhodujícím vlivem	0,00 %	0,00 %
Dlouhodobý majetek	0,00 %	3,10 %
Náklady a příjmy příštích období	0,00 %	0,00 %
Ostatní aktiva	0,16 %	0,19 %

H. ÚDAJE O ÚPLATĚ URČENÉ SPOLEČNOSTI ZA OBHOSPODAŘOVÁNÍ MAJETKU FONDU

Za období 1. 1. 2015 – 30. 6. 2015 činily náklady na obhospodařování majetku Fondu 18 312 tis. Kč a náklady za zhodnocení majetku Fondu 2 518 tis. Kč

V Praze dne 31. 7. 2015



Mgr. Hana Blovká
místopředsedkyně představenstva