

Ocenění portfolia

dle data vypořádání obchodu k 28.03.2013
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
AT0000492996 Atrium European Real Estate Ltd.	MEL2fe/15	16 000 000 8 CZK	94,50	30 906,67 CZK	15 150 906,67	2,51%
CZ000000260 Home Credit, a.s.	HCb6.25/16	6 000 000 2 CZK	106,00	287 500,00 CZK	6 647 500,00	1,10%
XS0214084252 OTP Bank Rt.	OTPfe/15	550 000 11 EUR	90,17	278,30 EUR	12 783 024,35	2,12%
XS0541470075 Republika Černá Hora	MONTENbe7.875/15	300 000 300 EUR	104,76	12 621,58 EUR	8 421 670,57	1,40%
XS0731129747 Eileme 2 AB	POLKOMbe11.75/20	200 000 200 EUR	116,17	3 786,11 EUR	6 083 177,11	1,01%
XS0877986231 New World Resources Plc	NWRbe7.875/21	500 000 500 EUR	90,95	7 109,38 EUR	11 898 164,28	1,97%
HU0000402318 Maďarsko	HUgb5.5-02/16	135 000 000 13 500 HUF	101,63	895 068,49 HUF	11 686 713,74	1,94%
HU0000402433 Maďarsko	HUgb6.5-06/19	222 000 000 22 200 HUF	103,98	10 950 986,30 HUF	20 460 978,90	3,39%
PL0000102646 Polsko	PLgb5.75-09/22	6 310 000 6 310 PLN	114,40	184 883,00 PLN	45 665 522,86	7,57%
PL0000104543 Polsko	PLgb5.25-10/17	6 400 000 6 400 PLN	107,94	141 760,00 PLN	43 484 350,53	7,21%
PL0000105359 Polská republika	PLgb2.75-08/23	7 000 000 7 000 PLN	125,40	130 673,05 PLN	54 949 774,13	9,11%
PL0000105441 Polsko	PLgb5.5-10/19	10 501 000 10 501 PLN	111,35	243 728,21 PLN	73 628 991,44	12,20%
RO0717DBN038 Rumunsko	ROMGB6.75/17	2 500 000 250 RON	104,49	134 075,34 RO	16 021 042,24	2,66%
RO1215DBN073 Rumunsko	ROMGB5.8/15	3 000 000 300 RON	100,75	72 936,99 RO	18 057 208,36	2,99%
TRSCCKBE1316 Bank Pozitif Ve Kalkinma Ban	BNKPOZb10.08/13	400 000 400 000 TRY	101,70	19 552,44 TRY	4 727 033,45	0,78%
TRSCRSIA1516 Boyner Büyük Magazacilik A.S.	BOYNRF/15	1 000 000 1 000 TRY	105,30	6 029,03 TRY	11 741 613,77	1,95%
TRSIINGB11411 ING Bank N.V., Amsterdam	INGTURb0/14	1 100 000 1 100 000 TRY	93,85	0,00 TRY	11 445 819,33	1,90%
TRSIISFN21416	ISLEASf/14	500 000 500 000 TRY	100,10	2 812,60 TRY	5 580 302,34	0,92%
TRSKFTF81311 Koc Fiat Kredi Tuketicli Finansman AS	KFKb11.68/13	500 000 500 000 TRY	101,75	33 760,00 TRY	6 014 889,76	1,00%
TRSRNSHA1514 Rönesans Holding A.S.	RONHOLF/15	500 000 500 TRY	101,90	0,00 TRY	5 648 902,94	0,94%
TRSRSGY71318	ROGYASfe/13	500 000 500 000 TRY	100,80	7 630,00 TRY	5 672 518,57	0,94%
TRSTISB11512 Türkiye Is Bankasi A.S.	ISBANKf/15	1 000 000 10 000 TRY	100,28	13 680,00 TRY	11 269 866,26	1,87%
TRSTPFC51310 Creditwest Faktoring Hizmetleri A.S.	CRDFAfe/13	400 000 400 000 TRY	100,70	12 332,05 TRY	4 602 631,37	0,76%
TRSTPFCK1419 Creditwest Faktoring Hizmetleri A.S.	CRDFAfe/14	750 000 750 TRY	101,85	177,53 TRY	8 471 165,08	1,40%
TRT010420T19 Turecko	TURKGB4 04/20	1 425 000 14 250 TRY	146,32	32 677,66 TRY	23 479 961,18	3,89%
TRT050314T14 Turecko	TURKGB9 03/14	1 000 000 1 000 TRY	102,56	5 625,00 TRY	11 432 847,37	1,89%
TRT060121T16 Turecko	TURKGB3 01/21	1 300 000 1 300 000 TRY	133,80	9 071,31 TRY	19 385 783,07	3,21%

TRT120122T17 Turecko	TURKGB9.5 01/22	1 750 000 TRY 1 750 000	116,30	34 444,06 TRY	22 946 814,54	3,80%
TRT150120T16 Turecko	TURKGB10.5 01/20	1 175 000 TRY 1 175 000	119,94	24 538,67 TRY	15 896 803,38	2,63%
TRT170615T16 Turecko	TURKGB10 06/15	2 000 000 TRY 2 000 000	107,60	55 494,51 TRY	24 475 709,74	4,06%
TRT210721T11 Turecko	TURKGB3 07/21	1 400 000 TRY 14 000	128,97	7 503,19 TRY	20 102 239,30	3,33%
XS0546767863 Yasar Holding A.S. (via Willow No.2 PLC	YASARbe9.625/15	350 000 USD 350	106,00	16 001,56 USD	7 764 065,27	1,29%
XS0853036860 Hrvatska Elektroprivreda	HEPbe6/17	200 000 USD 200	103,69	4 633,33 USD	4 253 552,91	0,70%
Celkem za dluhopisy					569 851 544,81	94,44%

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	31.07.2013	1 500 000,00 CZK	0,00%	1 500 000,00	0,25%
XS0213064289 Landsbanki Islands HF	LANISLfe/10 - Pohledávka	31.07.2013	400 000,00 CZK	0,00%	400 000,00	0,07%
	FX operace	28.03.2013	-586 479,91 CZK	0,00%	-586 479,91	-0,10%
	FX operace	03.05.2013	18 980 000,00 EUR	0,13%	-488 897 757,98	-81,03%
	CZK - Záloha na poplatky	28.03.2013	-1 599 301,66 CZK	0,00%	-1 599 301,66	-0,27%
	CZK - Pohledávka	28.03.2013	7 226 442,72 CZK	0,00%	7 226 442,72	1,20%
	FX operace	03.05.2013	487 177 691,00 CZK	0,32%	487 020 870,28	80,71%
Celkem za závazky a pohledávky					5 063 773,45	0,84%

Peněžní zůstatky

Měna	Zůstatek	Hodnota
CZK	21 310 523,02	21 310 523,02 CZK
USD	257 407,29	5 164 154,96 CZK
EUR	14 617,36	376 570,41 CZK
PLN	4 182,95	25 801,87 CZK
HUF	7 444 232,55	629 976,14 CZK
TRY	86 561,30	959 718,12 CZK
RON	1 468,36	8 565,75 CZK
Zůstatky celkem		28 475 310,27 CZK

Použité měnové kursy

Měnový kurz	Kurz
CZK/EUR	25,7619
CZK/HUF	0,0846
CZK/PLN	6,1683
CZK/RON	5,8335
CZK/TRY	11,0872
CZK/USD	20,0622

Souhrn

Typ Instrumentu	Tržní hodnota CZK	Váha
Dluhopisy PLN	217 728 638,97	36,08%
Dluhopisy TRY	212 894 901,45	35,28%
Dluhopisy EUR	39 186 036,30	6,49%
Dluhopisy RON	34 078 250,60	5,65%
Dluhopisy HUF	32 147 692,64	5,33%
Dluhopisy CZK	21 798 406,67	3,61%
Dluhopisy USD	12 017 618,18	1,99%
Závazky a pohledávky	5 063 773,45	0,84%
Peněžní zůstatky	28 475 310,27	4,72%
Celková hodnota	603 390 628,54	100,00%