

POLOLETNÍ ZPRÁVA

FONDU KOLEKTIVNÍHO INVESTOVÁNÍ S OZNAČENÍM:

CYRRUS UDRŽITELNÁ BUDOUCNOST, OTEVŘENÝ PODÍLOVÝ FOND

(dále jen „Fond“)

INFORMACE KE DNI 30. ČERVNA 2023

I. 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 Bankovníctví 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 změně ve statutu Fondu, a to dne 29. června 2023, důvodem změny statutu byla implementace SFDR – Politiky integrace rizik udržitelnosti.

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 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

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

Název CP (popř. emitent CP)	ISIN	Celková pořizovací cena v tis. Kč	Celková reálná hodnota v tis. Kč k 30. 6. 2023
Amundi_MSCIWrldSRI	LU1861134382	4 346	4 804
ConseqRepoCZK	CZ0008477221	9 020	9 306
FT_Global_Wind ETF	US33736G1067	1 925	1 955
GS_FuturePlanetEq	US38149W7965	1 939	2 005
Inco_GlobCleanEn	US46138G8472	3 093	2 930
Inco_MSCI_SustFut	US46137V4077	2 461	2 311
iShares_GLSustGoal	US46435G5320	5 386	5 222
JPM_Europe_ResEnh	IE00BF4G7183	4 626	5 287
LG_Europe_RespExl	IE00BKLTRN76	4 969	5 697
LM_LrgCapUS_GroESG	US5246822002	1 904	2 309
Vacek_LowCarb ETF	US92189F5026	2 507	2 523
Xtf_MSCI_USA_ESG	IE00BFMNPS42	3 142	3 486

Majetek	Pořizovací cena v tis. Kč	Reálná hodnota v tis. Kč k 30. 6. 2023
Pohledávky za bankami	7 752	7 752

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

Fond v rozhodném období nevyplácel podíly na zisku.

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 bankovní poplatky 4 tis. Kč.

Za období 1. ledna – 30. června 2023 činily náklady na úplatu za obhospodařování majetku Fondu 490 tis. Kč a náklady na administraci fondu 369 tis. Kč.

Za období 1. ledna – 30. června 2023 činily náklady na výkon funkce depozitáře 218 tis. Kč a náklady na ostatní služby depozitáře 21 tis. Kč.

Za období 1. ledna – 30. června 2023 činily náklady na služby auditora 54 tis. Kč.

Za období 1. ledna – 30. června 2023 byla vyčíslena splatná daň z příjmů ve výši 131 tis. Kč.

I. RIZIKA SOUVISEJÍCÍ S DERIVÁTY, KVANTITATIVNÍ OMEZENÍ A METODY HODNOCENÍ RIZIK,

kteřé 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.

Riziko protistrany plynoucí z finančních derivátů vyjádřené jako součet kladných reálných hodnot těchto derivátů nesmí u jedné smluvní strany překročit:

- 10 % upraveného fondového kapitálu, je-li touto smluvní stranou osoba, za kterou může Fond podle statutu nabýt pohledávku z bankovního vkladu, nebo
- 5 % upraveného fondového kapitálu, je-li touto smluvní stranou jiná osoba než uvedená v předchozí odrážce.

Kvantitativní omezení

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

Fond může používat finanční deriváty a provádět repo obchody pouze ve vztahu k investičním cenným papírům nebo nástrojům peněžního trhu a pouze za účelem snížení rizik z investování Fondu, snížení nákladů Fondu, získání dodatečného kapitálu nebo dosažení dodatečných výnosů pro Fond. Fond musí být v každém okamžiku schopen splnit svou povinnost převést peněžní prostředky nebo dodat podkladové aktivum plynoucí z finančního derivátu sjednaného na účet Fondu.

Fond investuje především do cenných papírů vydávaných fondy kolektivního investování. Cenné papíry vydávané fondy kolektivního investování musí tvořit v souhrnu více než 49 % upraveného Fondového kapitálu. Avšak cenné papíry vydané fondem kolektivního investování, jejichž obhospodařovatel nemá povolení orgánu dohledu státu svého sídla nebo nepodléhá dohledu tohoto orgánu dohledu anebo které nejsou odkupovány ve lhůtě kratší než 1 rok, nesmí v souhrnu tvořit více než 10 % Fondového kapitálu. Investiční cenné papíry a nástroje peněžního trhu vydané jedním emitentem nesmí tvořit více než 20 % fondového kapitálu.

Zde uvedená kvantitativní omezení jsou podrobněji 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.

K. CELKOVÝ POČET PODÍLOVÝCH LISTŮ FONDU,
které jsou v oběhu ke dni 30. 6. 2023 a které byly vydány a odkoupeny v rozhodném období

Fond v rozhodném období emitoval 10 909 913 podílových listů a zároveň odkoupil 110 000 podílových listů Fondu. K 30. červnu 2023 bylo tedy v oběhu 50 478 996 podílových listů Fondu.

L. FONDOVÝ KAPITÁL PŘIPADAJÍCÍ NA JEDEN PODÍLOVÝ LIST

K 30. červnu 2023 připadl na jeden podílový list Fondu fondový kapitál ve výši 1,0980 Kč.

M. SKLADBA A ZMĚNY SKLADBY MAJETKU FONDU

Podíl v % na aktivech celkem	30. června 2023	30. června 2022
Pohledávky za bankami	13,86 %	100 %
Akcie, Podílové listy a ostatní podíly	85,53 %	0 %
Ostatní aktiva	0,61 %	0 %

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	7 752	- 2
v tom: a) splatné na požádání	0	0
Akcie, podílové listy, ostatní podíly	47 835	0
Ostatní aktiva	338	0
Aktiva celkem	55 925	- 2

Pasiva

tis. Kč	30. června 2023	30. června 2022
Ostatní pasiva	368	67
Rezervy	131	0
v tom: b) na daně	131	0
Kapitálové fondy	51 492	0
Nerozdělený zisk/neuhrazená ztráta z předchozích období	1 352	0
Zisk/ztráta za účetní období	2 582	- 69
Pasiva celkem	55 925	- 2

Datum sestavení

29. srpna 2023

Podpis statutárního zástupce



Ing. Jan Vědral