

POLOLETNÍ ZPRÁVA

ZA PODFOND SPOLEČNOSTI
BROKER CONSULTING SICAV, A.S. S NÁZVEM:

OK Smart ETF, podfond Broker Consulting SICAV

(dále jen „Podfond“)

INFORMACE KE DNI 30. ČERVNA 2020

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 Nařízení EU 231/2013, za rozhodné období 1. 1. 2020 až 30. 6. 2020

A. ÚDAJE O PODFONDU OK SMART ETF

Název podfondu

OK Smart ETF, podfond Broker Consulting SICAV (dále jen „Podfond“) zapsaný v seznamu podfondů vedeným Českou národní bankou dne 12. června 2018

ISIN

CZ0008043254

Sídlo

Bucharova 1423/6, Stodůlky, 158 00 Praha 5

Další údaje

Podfond vydává zaknihované investiční akcie. Cílem Podfondu je dosáhnout dlouhodobého zhodnocení svěřených prostředků investováním zejména do cenných papírů vydávaných ETF, tedy akciovými fondy a dále v nižší míře do akcií, dluhopisů, nástrojů peněžního trhu, cenných papírů vydávaných dluhopisovými fondy a jiných investičních nástrojů, jak jsou tyto dále specifikovány v příslušném statutu Podfondu.

B. ZÁKLADNÍ ÚDAJE O INVESTIČNÍM FONDU

Název fondu

Broker Consulting SICAV, a. s. (dále jen „Fond“) zapsaný v obchodním rejstříku vedeném u Městského soudu v Praze dne 6. června 2018, oddíl B, vložka 23502.

IČO

071 88 935

Sídlo

Bucharova 1423/6, Stodůlky, 158 00 Praha 5

Podfondy

OK Smart ETF, podfond Broker Consulting SICAV (dále jen „Podfond“)
OK Smart Bond, podfond Broker Consulting SICAV

Další údaje

Fond je speciálním fondem ve smyslu § 94 odst. 2 Zákona o investičních společnostech a investičních fondech (dále jen “ZISIF”), který není ani řídicím ani podřízeným fondem. Fond může v souladu se stanovami vytvářet Podfondy. Investiční akcie jsou vydávány na účet Podfondu. Fond nevydává investiční akcie. Předmět podnikání Fondu je v souladu s uděleným povolením k činnosti.

Fond je investičním fondem s právní osobností, který má individuální statutární orgán, jímž je právnická osoba oprávněná Fond obhospodařovat.

Vedoucí osoby Fondu

Statutárním ředitelem Fondu je Conseq Funds investiční společnost, a.s.

C. ZÁKLADNÍ ÚDAJE O OBHOSPODAŘUJÍCÍ INVESTIČNÍ SPOLEČNOSTI

Název společnosti

Conseq Funds investiční společnost, a. s. (dále jen „Společnost“) zapsaná v obchodním rejstříku vedeném Městským soudem v Praze, oddíl B, vložka 17126.

IČO

248 37 202

Sídlo

Rybná 682/14, Praha 1 - Staré Město, PSČ 110 05

Uzavřené smlouvy

Smlouva o výkonu funkce, prostřednictvím které byla Společnosti svěřena činnost obhospodařování a administrace Fondu, byla uzavřena dne 6. června 2018.

Dodatek č. 6 smlouvy o zastoupení při některých činnostech souvisejících s kolektivním investováním (ZISIF), prostřednictvím kterého byla distribucí Fondu pověřena společnost Conseq Investment Management, a. s., se sídlem Rybná 682/14, 110 00 Praha 1, IČO 264 42 671, byl uzavřen dne 13. července 2018.

D. ÚDAJE O PODSTATNÝCH ZMĚNÁCH ÚDAJŮ UVEDENÝCH VE STATUTU FONDU

V rozhodném období nedošlo ke změnám ve statutu.

E. ÚDAJE O DEPOZITÁŘI FONDU A JEHO PODFONDU

v rozhodném období a době, po kterou činnost depozitáře vykonával

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

F. ÚDAJE O OSOBĚ POVĚŘENÉ ÚSCHOVOU NEBO JINÉ OPATR. MAJETKU PODFONDU OK SMART ETF, pokud je u této osoby uloženo více než 1 % hodnoty majetku Podfondu OK Smart ETF

Úschovu nebo jiné opatrování majetku Podfondu zajišťuje pouze Depozitář.

G. ÚDAJE O HLAVNÍM PODPŮRCI

v rozhodném období, a údaj o době, po kterou tuto činnost vykonával

Majetek Podfondu nebyl v rozhodném období svěřen hlavnímu podpůrci.

H. IDENTIFIKACE MAJETKU FONDU

pokud jeho hodnota přesahuje 1 % hodnoty majetku Fondu ke dni 30. června 2020, s uvedením celkové pořizovací ceny a reálné hodnoty na konci rozhodného období

Majetkové CP v majetku Fondu:

Název CP (popř. emitent CP)	ISIN	Celková pořizovací cena v tis. Kč	Celková reálná hodnota v tis. Kč k 30.06.2020
ALLStruRetITUSD	LU1529949155	17 717	13 310
Amundi_MSCI_EM ETF	LU1437017350	93 741	97 474
Amundi_MSCI_EU ETF	LU1437015735	78 755	81 087
Amundi_MSCI_World	LU1437016972	111 500	117 422
BondFundB	IE0031282886	97 328	99 659
ConservativeBFA	IE0034074827	21 556	21 824
iShareGlobREITETF	US46434V6478	37 237	32 404
iShareMSCIWorldCor	IE00B4L5Y983	107 240	116 881
iShares_EM_HC_Bond	IE00BYXYK40	31 089	31 783
iShareCorpBondEUR	IE00BF11F565	62 358	63 608
iSharesGHYCoBoAcc	IE00BYWZ0440	10 409	10 490
LOYSFCPGlobEUR	LU0720542298	21 251	19 661

Majetek	Požizovací cena v tis. Kč	Reálná hodnota v tis. Kč k 30. 6. 2020
Pohledávky za bankami	22 046	22 046

I. SOUDNÍ NEBO ROZHODČÍ SPORY

kteří se týkají majetku nebo nároku vlastníků cenných papírů nebo zaknihovaných cenných papírů vydávaných Podfondem, jestliže hodnota předmětu sporu převyšuje 5 % hodnoty majetku Podfondu v rozhodném období

Podfond nebyl za rozhodné období účastníkem žádného soudního nebo rozhodčího sporu, jehož hodnota by převyšovala 5 % hodnoty majetku Podfondu.

J. HODNOTA VŠECH VYPLACENÝCH PODÍLŮ NA ZISKU NA JEDNU INVESTIČNÍ AKCII

Podfond v rozhodném období nevyplácel podíly na zisku.

K. 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 2020 činily náklady na úplatu za obhospodařování majetku Fondu 4 505 tis. Kč.

Za období 1. ledna – 30. června 2020 činily náklady na výkon funkce depozitáře 361 tis. Kč a náklady na ostatní služby depozitáře 142 tis. Kč.

Za období 1. ledna – 30. června 2020 činily náklady na služby auditora 63 tis. Kč.

Za období 1. ledna – 30. června 2020 činily náklady na vedení evidence podílových listů Fondu 286 tis. Kč.

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

kteřé byly zvoleny pro hodnocení rizik spojených s řízením portfolia a 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, akciová 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.

V Podfondu jsou v současnosti prováděny operace typu FX Swap a FX Forward, a to výhradě k zajištění měnového rizika v portfoliu Podfondu (nákladem užití této techniky jsou pouze forwardové body). Protistranami jsou stabilně Česká spořitelna, a.s., která rovněž provádí funkci depozitáře, případně UniCredit Bank Czech Republic and Slovakia, a.s. nebo PPF Bank, a.s.

Kvantitativní omezení

zvolené pro hodnocení rizik spojených s technikami obhospodařování Podfondu

Technikami obhospodařování Podfondu jsou pouze finanční deriváty a repo obchody. Tyto techniky lze používat pouze za podmínek a při dodržení limitů stanovených pro standardní fond Zákonem o investičních společnostech a investičních fondech a nařízením vlády č. 243/2013 Sb. O investování investičních fondů a o technikách k jejich obhospodařování (dále jen „Nařízení vlády“) v platném znění.

Kvantitativní omezení

zvolené pro hodnocení rizik spojených s řízením portfolia Podfondu

Podfond investuje především do cenných papírů vydaných akciovými fondy, v menší míře pak do cenných papírů vydaných jinými fondy kolektivního investování, dluhopisů a nástrojů peněžního trhu.

Zde uvedená kvantitativní omezení jsou podrobněji vymezena ve statutu Podfondu 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 Podfondu

Při řízení rizik vyplývajících z použití investičních nástrojů, které jsou součástí majetku Podfondu, 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 Podfondu,
- b) monitorování vývoje volatility výkonnosti Podfondu vyjádřené směrodatnou odchylkou vypočtenou z 36 měsíčních výkonností podílových listů Podfondu v ročním vyjádření,
- c) monitorování událostí operačního rizika.

Společnost zajišťuje úvěrové riziko u derivátů resp. repo obchodů dle pravidel stanovených statutem Podfondu a Nařízením vlády. Společnost dále sleduje vývoj úvěrových ratingů investičních nástrojů.

M. ODCHYLKA SLEDOVÁNÍ MEZI VÝKONNOSTÍ PODFONDU A VÝKONNOSTÍ SLEDOVANÉHO INDEXU,

pokud Podfond sleduje určitý index nebo jiný finanční kvantitativně vyjádřený ukazatel (benchmark), včetně vysvětlení rozdílů mezi očekávanou a skutečnou odchylkou sledování za příslušné období

Skutečná odchylka mezi výkonností Podfondu a výkonností sledovaného indexu (benchmarku) za příslušné období činí - 1,93 %. Očekávaná odchylka sledování za příslušné období není pro Podfond explicitně stanovena.

N. CELKOVÝ POČET INVESTIČNÍCH AKCIÍ PODFONDU,

kteří jsou v oběhu ke dni 30. 6. 2020 a které byly vydány a odkoupeny v rozhodném období

V rozhodném období bylo vydáno 268 262 337 investičních akcií a odkoupeno 14 010 629 investičních akcií Podfondu. K 30. červnu 2020 bylo v oběhu 725 685 178 investičních akcií Podfondu.

O. FONDOVÝ KAPITÁL PŘIPADAJÍCÍ NA JEDNU INVESTIČNÍ AKCII

K 30. červnu 2020 připadl na jednu investiční akci Podfondu fondový kapitál ve výši 0,9970 Kč.

P. SKLADBA A ZMĚNY SKLADBY MAJETKU PODFONDU

Podíl v % na aktivech celkem	30. června 2019	30. června 2020
Pohledávky za bankami	2,83 %	3,03 %
Akcie, podílové listy a ostatní podíly	97,05 %	96,96 %
Ostatní aktiva	0,12 %	0,01 %

Q. INFORMACE TÝKAJÍCÍ SE SFT A SWAPŮ VEŠKERÝCH VÝNOSŮ


Na účet Podfondu nebyly v rozhodném období uskutečněny žádné SFT ani swapy veškerých výnosů.

ROZVAHA K 30. ČERVNU 2020

Aktiva	
tis. Kč	30. června 2020
Pohledávky za bankami	22 046
v tom: a) splatné na požádání	22 046
Akcie, podílové listy a ostatní podíly	705 603
Ostatní aktiva	70
Aktiva celkem	727 719

Pasiva	
tis. Kč	30. června 2020
Ostatní pasiva	4 236
Kapitálové fondy	723 917
Nerozdělený zisk/neuhrazená ztráta z předchozích období	21 269
Zisk/ztráta za účetní období	- 21 703
Pasiva celkem	727 719

V Praze dne 21. srpna 2020



Conseq Funds investiční společnost a.s.
Individuální statutární orgán Fondu