

dôchodOK

POLROČNÁ SPRÁVA 2016

KLASIK,
dlhopisový garantovaný dôchodkový fond
VÚB Generali d.s.s., a.s.

VÚB GENERALI
DÔCHODKOVÁ SPRÁVCOVSKÁ SPOLOČNOSŤ, a.s.

Dof (PAS) 31-02

Výkaz pasív dôchodkového fondu

Názov dôchodkového fondu

KLASIK, dlhopisový garantovaný dôchodkový fond VÚB Generali d.s.s., a.s.

Identifikačný kód

S2203060004

Stav ku dňu

30.06.2016

Označenie	Položka	č. r.	Hodnota v tis. eur
a	b	c	1
1.	Závazky	1	5 401
a)	záväzky voči bankám	2	
b)	záväzky z ukončenia dôchodkového sporenia	3	
c)	záväzky voči dôchodkovej správcovskej spoločnosti	4	148
d)	záväzky z derivátových operácií	5	1 912
e)	záväzky voči bankám z repoobchodov	6	
f)	záväzky z vypožičania finančného majetku	7	
g)	ostatné záväzky	8	3 341
2.	Vlastné imanie	9	909 285
a)	dôchodkové jednotky na osobných dôchodkových účtoch sporiteľov	10	894 377
b)	zisk alebo strata za účtovné obdobie	11	14 908
3.	Pasíva spolu	12	914 686

Výkaz výnosov a nákladov dôchodkového fondu

Názov dôchodkového fondu

KLASIK, dlhopisový garantovaný dôchodkový fond VÚB Generali d.s.s., a.s.

Identifikačný kód

S2203060004

Stav ku dňu

30.06.2016

Označenie	Položka	č. r.	Hodnota v tis. eur
a	b	c	1
1.	Výnosy z úrokov a obdobné výnosy	1	7 513
a)	z peňažných prostriedkov na bežnom účte	2	4
b)	z peňažných prostriedkov na vkladovom účte	3	1 878
c)	z dlhopisov a obdobných dlhových cenných papierov	4	5 631
d)	z nástrojov peňažného trhu	5	
2.	Výnosy z podielových listov a obdobné výnosy	6	
3.	Výnosy z dividend a iných podielov na zisku	7	1 117
4.	Výnosy z operácií s cennými papiermi a podielmi	8	18 739
a)	z kapitálových cenných papierov a obdobných cenných papierov	9	
b)	z dlhopisov a iných dlhových cenných papierov	10	13 642
c)	z nástrojov peňažného trhu	11	
d)	z podielových listov a obdobných cenných papierov	12	5 097
5.	Náklady na operácie s cennými papiermi a podielmi	13	6 859
a)	kapitálové cenné papiere a obdobné cenné papiere	14	
b)	dlhopisy a iné dlhové cenné papiere	15	4 615
c)	nástroje peňažného trhu	16	
d)	podielové listy a obdobné cenné papiere	17	2 244
6.	Zisk/strata z operácií s cennými papiermi a podielmi	18	11 880
7.	Zisk/strata z operácií s devízami	19	-1 882
8.	Zisk/strata z derivátov	20	-734
9.	Zisk/strata z operácií s drahými kovmi	21	
10.	Zisk/strata z operácií s iným majetkom	22	
I.	Výnos z majetku	23	17 894
11.	Transakčné náklady	24	8
a)	náklady na transakcie s CP platené depozitárovi	25	8
b)	poplatky pri nákupe a predaji CP platené tretej strane	26	
12.	Bankové a iné poplatky	27	0
a)	bankové odplaty a poplatky	28	
b)	burzové odplaty a poplatky	29	
II.	Čistý výnos z majetku vo fonde	30	17 886
13.	Náklady na financovanie dôchodkového fondu	31	209
III.	Čistý zisk/strata zo správy majetku	32	17 677
14.	Iné výnosy	33	
15.	Náklady na odplaty	34	2 769
a)	náklady na odplatu za správu DF	35	1 325
b)	náklady na odplatu za zhodnotenie majetku v DF	36	1 288
c)	náklady na iné odplaty	37	156
IV.	Zisk/strata dôchodkového fondu za účtovné obdobie	38	14 908

Hlásenie o najvýznamnejších skutočnostiach dôchodkového fondu

Názov dôchodkového fondu

KLASIK, dlhopisový garantovaný dôchodkový fond VÚB Generali d.s.s., a.s.

Identifikačný kód

S2203060004

Stav ku dňu

30.6.2016**1. Informácie o najvýznamnejších skutočnostiach, ktoré ovplyvnili hospodárenie s majetkom v dôchodkovom fonde a informácie o jeho očakávanom vývoji v nasledujúcom období**

Turbulentný úvod roka spôsobený prepadosť akciových trhov v Číne a pokračujúci prepadosť ropy na začiatku roka priniesli so sebou neistotu ohľadom budúceho globálneho vývoja. To sa prejavilo v náraste kreditných spreadov rizikových aktív a dopyte investorov po bezpečnejších aktívach, najmä štátnych dlhopisoch. Na túto náladu zareagovali aj centrálné banky. ECB znížila kľúčové úrokové sadzby, zvýšila objem prostriedkov v rámci svojho QE programu a zahrnula do neho aj korporátne dlhopisy spoločností s investičným ratingom. To spôsobilo výrazný pokles výnosov na európskych dlhopisoch. FED zareagoval odložením zvyšovania sadzieb v USA, kým sa situácia na trhoch neupokojí. Postupné zlepšenie nálady na trhoch vystriedalo koncom júna referendum v Británii, v ktorom si obyvatelia Británie zvolili odchod z EÚ, čo viedlo k opätovnému výpredaju rizikových aktív na finančných trhoch. Po prvotnom šoku a z dôvodu očakávania ďalšieho uvoľňovania menových politik sa však dlhopisový trh vrátil na svoju rastovú dráhu.

Názov dôchodkového fondu

KLASIK, dlhopisový garantovaný dôchodkový fond VÚB Generali d.s.s., a.s.

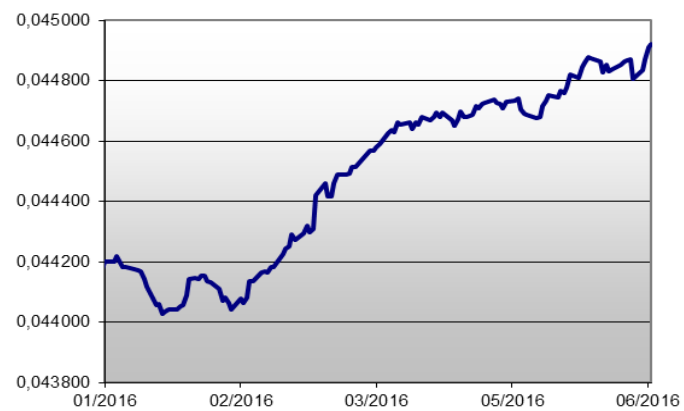
Identifikačný kód

S2203060004

Stav ku dňu

30.6.2016

2. Grafické znázornenie vývoja hodnoty dôchodkovej jednotky



Názov dôchodkového fondu

KLASIK, dlhopisový garantovaný dôchodkový fond VÚB Generali d.s.s., a.s.

Identifikačný kód

S2203060004

Stav ku dňu

30.6.2016**3. Informácie týkajúce sa merania a riadenia rizík v dôchodkovom fonde**

Dodatočné informácie k výpočtu rizika počas príslušného obdobia						
Použitý prístup k výpočtu celkového rizika:	prístup hodnoty v riziku (VaR)					
Metóda výpočtu:	parametrická metóda absolútnej VaR					
Jednostranný interval spoľahlivosti:	99%					
Obdobie výpočtu VaR (holding period):	10 obchodných dní					
Obdobie pozorovaní:	1 kalendárny rok (cca. 250 pracovných dní)					
Frekvencia výpočtu:	denne					
Mena výpočtu:	EUR					
Úroveň pákového efektu vo fonde:	nulová					

Obdobie 31.12.2015 - 30.06.2016	Hodnota	Absolútna VaR [%]	Relatívna VaR [%]	Využitie VaR limitu	Modifikovaná durácia portfólia	MD dlhopisovej časti
	30.6.2016	0,72%			2,573	3,750
Klasik	max	0,78%			2,649	4,001
	avg	0,67%			2,401	3,766
	min	0,57%			2,149	3,556

Dof (SP) 17-02

Hlásenie o vývoji počtu sporiteľov

Názov dôchodkového fondu

KLASIK, dlhopisový garantovaný dôchodkový fond VÚB Generali d.s.s., a.s.

Identifikačný kód

S2203060004

Stav ku dňu

30.06.2016

Počet sporiteľov spolu	Objem príspevkov v eurách spolu	Objem penále v eurách spolu	Počet sporiteľov podľa pohlavia		Počet sporiteľov podľa spôsobu prispievania		Zmena stavov sporiteľov				
			muži	ženy	aktívny	pasívny	medzi DF v rámci DSS		z DSS do inej DSS		úmrtnia
							prírastky	úbytky	prírastky	úbytky	
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12
188 269	29 732 431	984	95 078	93 191	145 463	42 806	639	856	745	997	89

Hlásenie o stave majetku v dôchodkovom fonde

Dof (HMF) 03-02
Strana 1/5

Názov dôchodkového fondu

KLASIK, dlhopisový garantovaný dôchodkový fond VÚB Generali d.s.s., a.s.

Identifikačný kód

S2203060004

Stav ku dňu

30.06.2016

Členenie podľa trhov

Druh majetku	Členenie	č.r.	Hodnota v tis. eur	Podiel na majetku v dôchodkovom fonde v %
a	b	c	1	2
Kapitálové cenné papiere a obdobné cenné papiere	Prijaté na obchodovanie na trhu kótovaných cenných papierov burzy cenných papierov	1		
	Prijaté na obchodovanie na trhu kótovaných cenných papierov zahraničnej burzy cenných papierov so sídlom v členskom štáte	2		
	Prijaté na obchodovanie na inom regulovanom trhu so sídlom v štáte, ktorý je súčasťou Európskeho hospodárskeho priestoru, a ktorý je uvedený v zozname zverejnenom Európskou komisiou	3		
	Z nových emisií cenných papierov, ak emisné podmienky obsahujú záväzok, že bude podaná žiadosť o prijatie cenných papierov na obchodovanie na regulovanom trhu a zo všetkých okolností je zrejme, že sa toto prijatie uskutoční do jedného roka od dátumu vydania emisie cenných papierov	4		
Dlhopisy a iné dlhové cenné papiere	Prijaté na obchodovanie na trhu kótovaných cenných papierov burzy cenných papierov	5	16 432	1,7965
	Prijaté na obchodovanie na trhu kótovaných cenných papierov zahraničnej burzy cenných papierov so sídlom v členskom štáte	6	603 201	65,9462
	Prijaté na obchodovanie na inom regulovanom trhu so sídlom v štáte, ktorý je súčasťou Európskeho hospodárskeho priestoru, a ktorý je uvedený v zozname zverejnenom Európskou komisiou	7	5 048	0,5519
	Z nových emisií cenných papierov, ak emisné podmienky obsahujú záväzok, že bude podaná žiadosť o prijatie cenných papierov na obchodovanie na regulovanom trhu a zo všetkých okolností je zrejme, že sa toto prijatie uskutoční do jedného roka od dátumu vydania emisie cenných papierov	8		
Podielové listy otvorených podielových fondov a cenné papiere zahraničných subjektov kolektívneho investovania podľa § 81 ods. 1 písm. c) zákona	Prijaté na obchodovanie na trhu kótovaných cenných papierov burzy cenných papierov	9		
	Prijaté na obchodovanie na trhu kótovaných cenných papierov zahraničnej burzy cenných papierov so sídlom v členskom štáte	10		
	Prijaté na obchodovanie na inom regulovanom trhu so sídlom v štáte, ktorý je súčasťou Európskeho hospodárskeho priestoru, a ktorý je uvedený v zozname zverejnenom Európskou komisiou	11		
	Z nových emisií cenných papierov, ak emisné podmienky obsahujú záväzok, že bude podaná žiadosť o prijatie cenných papierov na obchodovanie na regulovanom trhu a zo všetkých okolností je zrejme, že sa toto prijatie uskutoční do jedného roka od dátumu vydania emisie cenných papierov	12		
Cenné papiere iných zahraničných subjektov kolektívneho investovania podľa § 81 ods. 1 písm. d) zákona	Prijaté na obchodovanie na trhu kótovaných cenných papierov burzy cenných papierov	13		
	Prijaté na obchodovanie na trhu kótovaných cenných papierov zahraničnej burzy cenných papierov so sídlom v členskom štáte	14	151 860	16,6024
	Prijaté na obchodovanie na inom regulovanom trhu so sídlom v štáte, ktorý je súčasťou Európskeho hospodárskeho priestoru, a ktorý je uvedený v zozname zverejnenom Európskou komisiou	15	19 252	2,1048
	Z nových emisií cenných papierov, ak emisné podmienky obsahujú záväzok, že bude podaná žiadosť o prijatie cenných papierov na obchodovanie na regulovanom trhu a zo všetkých okolností je zrejme, že sa toto prijatie uskutoční do jedného roka od dátumu vydania emisie cenných papierov	16		
Nástroje peňažného trhu podľa § 81 ods. 1 písm. e) zákona	Vydané alebo zaručené Ministerstvom financií SR alebo Národnou bankou Slovenska	17		
	Vydané alebo zaručené členským štátom a jeho centrálnymi orgánmi	18		
	Vydané alebo zaručené centrálnou bankou členského štátu	19		
	Vydané alebo zaručené orgánmi miestnej správy členského štátu	20		
	Vydané alebo zaručené ECB, EÚ, EIB, IBRD, IFA, CEB, IADB, ADB, AFDB, CDB, NIB, EBRD, EIF, IMF, BIS, MIGA	21		
	Vydané alebo zaručené emitentom, ktorého cenné papiere boli prijaté na obchodovanie na regulovanom trhu	22		
Peňažné prostriedky na bežných účtoch a vkladových účtoch podľa § 81 ods. 1 písm. f) zákona	Vydané alebo zaručené finančnými inštitúciami so sídlom v členskom štáte alebo nečlenskom štáte; to platí, ak za splatenie nástrojov peňažného trhu prevzala záruku finančná inštitúcia	23		
	na bežnom účte u depozitára	24	2 596	0,2838
	na vkladovom účte u depozitára	25		
	na bežnom účte v banke alebo zahraničnej banke konajúcej prostredníctvom pobočky zahraničnej banky so sídlom v SR, v inom členskom štáte alebo nečlenskom štáte, ak táto banka alebo zahraničná banka konajúca prostredníctvom pobočky zahraničnej banky podlieha dohľadu	26		
	prostriedky na vkladovom účte v banke alebo zahraničnej banke konajúcej prostredníctvom pobočky zahraničnej banky so sídlom v SR, v inom členskom štáte alebo nečlenskom štáte, ak táto banka alebo zahraničná banka konajúca prostredníctvom pobočky zahraničnej banky podlieha dohľadu	27	113 249	12,3812
Pohľadávky a záväzky vznikajúce pri obchodoch určených výlučne na obmedzenie úrokového rizika, menového rizika alebo iného rizika podľa § 81 ods. 1 písm. g) zákona		28		
Cenné papiere, s ktorými sa prestalo obchodovať na regulovanom trhu cenných papierov podľa § 83 ods. 1 zákona		29		
Cenné papiere z nových emisií, ktoré nespĺňali podmienku podľa § 81 ods. 1 písm. b) zákona a neboli prijaté na obchodovanie na regulovanom trhu do 1 roka		30		
Cenné papiere, ktoré nie sú prijaté na obchodovanie na regulovanom trhu		31		
Iný majetok		32		
Objem pohľadávok dôchodkového fondu celkom		33	3 048	0,3332
Hodnota majetku v dôchodkovom fonde		34	914 686	100,0000
Objem záväzkov dôchodkového fondu celkom		35	5 401	0,5905
Čistá hodnota majetku v dôchodkovom fonde		36	909 285	99,4095

Názov dôchodkového fondu

KLASIK, dlhopisový garantovaný dôchodkový fond VUB Generali d.s.s., a.s.

Identifikačný kód

S2203060004

Stay ku dň

30.06.2016

Clenenie podľa emitentov

Očíslenie podľa emitentov																					
č. r.	Emitenti/Banky	Spolu		Kapitálové CP a obdobné CP		Dlhopisy a iné dlhové CP		PL OPF a CP ZSKI		CP IZSKI		NPT		Peňažné prostriedky na BÚ a VÚ		Pohľadávky a záväzky vznikajúce pri obchodoch určených výlučne na obmedzenie úrokového rizika, menového rizika alebo iného rizika		Iný majetok		Pohľadávky dôchodkového fondu	
		objem v tis. eur	podiel v %	objem v tis. eur	podiel v %	objem v tis. eur	podiel v %	objem v tis. eur	podiel v %	objem v tis. eur	podiel v %	objem v tis. eur	podiel v %	objem v tis. eur	podiel v %	reálna hodnota v tis. eur	podiel v %	objem v tis. eur	podiel v %	objem v tis. eur	podiel v %
a	b	1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13	14	15	16	17	18	19	20
	CELKOM	914 686	100,0000			624 681	68,2946			171 112	18,7072			115 845	12,6650					3 048	0,3332
1	Achmea Bank NV	10 658	1,1652			10 658	1,1652														
2	Alstria Office Reit -AG	3 158	0,3453			3 158	0,3453														
3	American International Group	3 515	0,3843			3 515	0,3843														
4	Amundi ETF	13 966	1,5269							13 966	1,5269										
5	Arion Banki HF	3 033	0,3316			3 033	0,3316														
6	Atrium European Real Estate	1 659	0,1814			1 659	0,1814														
7	Bank Of Ireland	2 051	0,2242			2 051	0,2242														
8	Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ	2 775	0,3034			2 775	0,3034														
9	Bank Ochrony Środowiska S.A.	25 723	2,8122											25 723	2,8122						
10	Barclays Bank plc	6 756	0,7386			6 756	0,7386														
11	Bharti Airtel International	6 488	0,7093			6 488	0,7093														
12	Black Rock	111 439	12,1833							111 439	12,1833										
13	Bulgaria	9 990	1,0922			9 990	1,0922														
14	Bunge Finance Europe BV	2 849	0,3115			2 849	0,3115														
15	Casino Guichard Perrachon	2 806	0,3068			2 806	0,3068														
16	CESKE DRAHY AS	17 542	1,9178			17 542	1,9178														
17	Citigroup Inc	10 012	1,0946			10 012	1,0946														
18	CK Hutchison Finance 16 LTD	3 514	0,3842			3 514	0,3842														
19	Credit Agricole SA	5 147	0,5627			5 147	0,5627														
20	Deutsche PfandBriefBank AG	5 642	0,6168			5 642	0,6168														
21	Distribudora Internacional de Alimentaci	506	0,0553			506	0,0553														
22	DVB BANK SE	5 437	0,5944			5 437	0,5944														
23	Edenred	1 953	0,2135			1 953	0,2135														
24	EESTI ENERGIA AS	7 008	0,7662			7 008	0,7662														
25	EP ENERGY AS	4 251	0,4647			4 251	0,4647														
26	F VAN Lanschot Bankiers NV	9 461	1,0343			9 461	1,0343														
27	FCE Bank PLC	2 094	0,2289			2 094	0,2289														
28	Fondy VUB Generali d.s.s.	44	0,0048																	44	0,0048
29	Goldman Sachs Group INC	5 319	0,5815			5 319	0,5815														
30	Government of Romania	17 609	1,9251			17 609	1,9251														
31	Hammerson PLC	2 013	0,2201			2 013	0,2201														
32	HSBC Holdings PLC	3 268	0,3573			3 268	0,3573														
33	Icap Group Holdings PLC	516	0,0564			516	0,0564														
34	International Investment Bank	4 882	0,5337			4 882	0,5337														
35	Islandsbanki HF	2 082	0,2276			2 082	0,2276														
36	JAB Holdings BV	6 010	0,6571			6 010	0,6571														
37	KBC Goep NV	1 018	0,1113			1 018	0,1113														
38	Kingdom Of Morocco	4 979	0,5443			4 979	0,5443														
39	Landesbank Berlin AG	1 274	0,1393			1 274	0,1393														
40	Leaseplan Corporation NV	8 023	0,8771			8 023	0,8771														
41	Leeds Building Society	10 438	1,1412			10 438	1,1412														
42	Macquarie Group LTD	9 527	1,0416			9 527	1,0416														
43	Met Life Global Funding	2 025	0,2214			2 025	0,2214														
44	Metso OYJ	2 698	0,2950			2 698	0,2950														
45	MFINANCE FRANCE SA	14 838	1,6222			14 838	1,6222														
46	MFSR	44 162	4,8281			44 162	4,8281														

47	Ministerstwo finansii Polsko	25 331	2,7694			25 331	2,7694												
48	Morgan Stanley	1 084	0,1185			1 084	0,1185												
49	Nasdaq INC	4 333	0,4737			4 333	0,4737												
50	Nationwide Building Society	3 449	0,3771			3 449	0,3771												
51	Ne Property Cooperatief UA	1 578	0,1725			1 578	0,1725												
52	NET4GAS SRO	4 437	0,4851			4 437	0,4851												
53	NIBC Bank NV	3 059	0,3344			3 059	0,3344												
54	Nomura Europe Finance NV	11 681	1,2771			11 681	1,2771												
55	Nordea Bank AB	3 116	0,3407			3 116	0,3407												
56	OP Corporate Bank PLC	3 484	0,3809			3 484	0,3809												
57	Orlen Capital AB	8 183	0,8946			8 183	0,8946												
58	Petrol DD Ljubljana	2 154	0,2355			2 154	0,2355												
59	PGE Sweden AB	4 076	0,4456			4 076	0,4456												
60	PIMCO Low Dur Euro Corp Bond	19 823	2,1672						19 823	2,1672									
61	PKO FINANCE AB	11 878	1,2986			11 878	1,2986												
62	Polskie Koleje Państwowe	15 588	1,7042			15 588	1,7042												
63	Procredit Holding AG & CO KG	7 947	0,8688			7 947	0,8688												
64	PZU Finance AB	10 353	1,1319			10 353	1,1319												
65	Rabobank Nederland	3 501	0,3828			3 501	0,3828												
66	RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	17 007	1,8593			17 007	1,8593												
67	Republic of Chile	9 545	1,0435			9 545	1,0435												
68	Republic of Iceland	8 341	0,9119			8 341	0,9119												
69	Republic of Indonesia	7 516	0,8217			7 516	0,8217												
70	Republic of Latvia	8 798	0,9619			8 798	0,9619												
71	Republic of Lithuania	12 934	1,4140			12 934	1,4140												
72	Republic of Peru	6 940	0,7587			6 940	0,7587												
73	Republic of Turkey	2 810	0,3072			2 810	0,3072												
74	Republika Slovenija	14 104	1,5419			14 104	1,5419												
75	Royal Bank of Scotland PLC	8 404	0,9188			8 404	0,9188												
76	RWE Finance B.V.	2 676	0,2926			2 676	0,2926												
77	Sabic Capital I BV	6 165	0,6740			6 165	0,6740												
78	Santander Consumer Finance	17 373	1,8993			17 373	1,8993												
79	Slovenská sporiteľňa (Erste Bank)	11 550	1,2627			11 550	1,2627												
80	Sparebank 1 SR Bank ASA	5 381	0,5883			5 381	0,5883												
81	SPP - Distribucia AS	3 213	0,3513			3 213	0,3513												
82	SPP Infrastructure Financing	12 050	1,3174			12 050	1,3174												
83	Standard Chartered PLC	9 717	1,0623			9 717	1,0623												
84	State Grid Europe Development	2 049	0,2240			2 049	0,2240												
85	State Street Corp	19 252	2,1048						19 252	2,1048									
86	T.C.Ziraat Bankasi - London Branch	10 240	1,1195										10 240	1,1195					
87	Turkiye Garanti Bankasi	4 954	0,5416			4 954	0,5416												
88	Turkiye Vakiflar Bankasi	3 516	0,3844			3 516	0,3844												
89	Ubi Banca Spa	2 892	0,3162			2 892	0,3162												
90	UBS ETF	8 480	0,9271			1 848	0,2020			6 632	0,7251								
91	UniCredit SpA	103 944	11,3639			21 058	2,3022						79 882	8,7333				3 004	0,3284
92	United Mexican States	13 743	1,5025			13 743	1,5025												
93	Volkswagen AG	8 113	0,8870			8 113	0,8870												
94	Wells Fargo & Co	3 247	0,3550			3 247	0,3550												
95	Wendel SA	4 519	0,4940			4 519	0,4940												

Hlásenie o stave majetku v dôchodkovom fonde

Názov dôchodkového fondu

KLASIK, dlhopisový garantovaný dôchodkový fond VÚB Generali d.s. s., a.s.

Identifikačný kód

S2203060004

Stav ku dňu

30.06.2016

Členenie podľa sektorového hľadiska

[illegible]

Názov dôchodkového fondu

KLASIK, dlhopisový garantovaný dôchodkový fond VÚB Generali d.s.s., a.s.Identifikačný kód

S2203060004

Stav ku dňu

30.06.2016

Členenie podľa geografického hľadiska

č. r.	Štáty	Spolu		Kapitálové CP a obdobné CP		Dlhopisy a iné dlhové CP		PL OPF a CP ZSKI		CP IZSKI		NPT		Peňažné prostriedky na BÚ a VÚ		Pohľadávky a záväzky vznikajúce pri obchodoch určených výlučne na obmedzenie úrokového rizika, menového rizika alebo iného rizika		Iný majetok		Pohľadávky dôchodkového fondu	
		objem v tis. eur	podiel v %	objem v tis. eur	podiel v %	objem v tis. eur	podiel v %	objem v tis. eur	podiel v %	objem v tis. eur	podiel v %	objem v tis. eur	podiel v %	objem v tis. eur	podiel v %	reálna hodnota v tis. eur	podiel v %	objem v tis. eur	podiel v %	objem v tis. eur	podiel v %
a	b	1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13	14	15	16	17	18	19	20
a	Členské štáty	768 854	84,0566			498 101	54,4560			151 860	16,6024			115 845	12,6650					3 048	0,3332
b	Nečlenské štáty	145 832	15,9434			126 580	13,8386			19 252	2,1048										
	CELKOM	914 686	100,0000			624 681	68,2946			171 112	18,7072			115 845	12,6650					3 048	0,3332
1	SK	4 882	0,5337			4 882	0,5337														
2	AT	20 011	2,1877			17 007	1,8593													3 004	0,3284
3	AU	9 527	1,0416			9 527	1,0416														
4	BE	1 018	0,1113			1 018	0,1113														
5	BG	9 990	1,0922			9 990	1,0922														
6	CL	9 545	1,0435			9 545	1,0435														
7	CZ	26 230	2,8677			26 230	2,8677														
8	DE	25 449	2,7823			25 449	2,7823														
9	EE	7 008	0,7662			7 008	0,7662														
10	ES	17 879	1,9547			17 879	1,9547														
11	FI	6 182	0,6759			6 182	0,6759														
12	FR	43 229	4,7261			29 263	3,1992			13 966	1,5269										
13	GB	58 944	6,4442			48 704	5,3247							10 240	1,1195						
14	HR	77 286	8,4495											77 286	8,4495						
15	ID	7 516	0,8217			7 516	0,8217														
16	IE	133 313	14,5747			2 051	0,2242			131 262	14,3505										
17	IS	13 456	1,4711			13 456	1,4711														
18	IT	23 950	2,6184			23 950	2,6184														
19	JE	3 507	0,3834			3 507	0,3834														
20	JP	2 775	0,3034			2 775	0,3034														
21	KY	3 514	0,3842			3 514	0,3842														
22	LT	12 934	1,4140			12 934	1,4140														
23	LU	6 632	0,7251							6 632	0,7251										
24	LV	8 798	0,9619			8 798	0,9619														
25	MA	4 979	0,5443			4 979	0,5443														
26	MX	13 743	1,5025			13 743	1,5025														
27	NL	90 321	9,8745			90 321	9,8745														
28	NO	5 381	0,5883			5 381	0,5883														
29	PE	6 940	0,7587			6 940	0,7587														
30	PL	66 642	7,2858			40 919	4,4736							25 723	2,8122						
31	RO	17 609	1,9251			17 609	1,9251							0							
32	SE	37 606	4,1114			37 606	4,1114														
33	SI	16 258	1,7774			16 258	1,7774														
34	SK	61 565	6,7307			58 925	6,4421							2 596	0,2838					44	0,0048
35	TR	11 280	1,2332			11 280	1,2332														
36	US	48 787	5,3337			29 535	3,2290			19 252	2,1048										

Hlásenie o stave majetku v dôchodkovom fonde

Názov dôchodkového fondu

KLÁSIK, dlhopisový garantovaný dôchodkový fond VUB Generali d.s.s., a.s.

Identifikačný kód

S2203060004

Stav ku dňu

30.06.2016

Členenie podľa menového hľadiska

Cieľenie podľa menového triediska																							
č. r.	Mena D	Zostatková fixácia úrokových mier	Spolu		Kapitálové CP a obdobné CP		Dlhopisy a iné dlhové CP		PL OPF a CP ZSKI		CP IZSKI		NPT		Peňažné prostriedky na BÚ a VÚ		Pohľadávky a záväzky vznikajúce pri obchodoch určených výlučne na obmedzenie úrokového rizika, menového rizika alebo iného rizika			Iný majetok		Pohľadávky dôchodkového fondu	
			objem v tis. eur	podiel v %	objem v tis. eur	podiel v %	objem v tis. eur	podiel v %	objem v tis. eur	podiel v %	objem v tis. eur	podiel v %	objem v tis. eur	podiel v %	objem v tis. eur	podiel v %	reálna hodnota v tis. eur	hodnota podkladového nástroja v tis. eur	podiel v %	objem v tis. eur	podiel v %	objem v tis. eur	podiel v %
a	1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13	14	15	16	17	18	19	20	21	22	23
1		Majetok denominovaný v EUR																					
2		do 1 mesiaca vrátane	3 851	0,4210			1 652	0,1806							2 155	0,2356						44	0,0048
3		od 1 do 3 mesiacov vrátane	11 462	1,2531			1 222	0,1336							10 240	1,1195							
4		od 3 do 6 mesiacov vrátane	16 706	1,8264			16 706	1,8264															
5		od 6 mesiacov do 1 roka vrátane	59 496	6,5045			13 212	1,4444							46 284	5,0601							
6		od 1 do 3 rokov vrátane	137 730	15,0576			81 005	8,8560							56 725	6,2016							
7		od 3 do 5 rokov vrátane	246 588	26,9588			246 588	26,9588															
8		od 5 do 10 rokov vrátane	158 187	17,2941			158 187	17,2941															
9		od 10 do 15 rokov vrátane	21 995	2,4047			21 995	2,4047															
10		nad 15 rokov	23 342	2,5519			23 342	2,5519															
11		nedefinované	151 860	16,6024					151 860	16,6024													
12		CELKOM	831 217	90,8746			563 909	61,6506			151 860	16,6024			115 404	12,6168						44	0,0048
13		Majetok denominovaný v USD																					
14		do 1 mesiaca vrátane	461	0,0504			23	0,0025							438	0,0479							
15		od 1 do 3 mesiacov vrátane	378	0,0413			378	0,0413															
16		od 3 do 6 mesiacov vrátane	24	0,0026			24	0,0026															
17		od 6 mesiacov do 1 roka vrátane																					
18		od 1 do 3 rokov vrátane	3 981	0,4352			3 981	0,4352															
19		od 3 do 5 rokov vrátane	18 388	2,0103			18 388	2,0103															
20		od 5 do 10 rokov vrátane	12 647	1,3827			12 647	1,3827															
21		od 10 do 15 rokov vrátane																					
22		nad 15 rokov																					
23		nedefinované	19 252	2,1048					19 252	2,1048													
24		CELKOM	55 131	6,0273			35 441	3,8747			19 252	2,1048			438	0,0479							
49		Majetok denominovaný v PLN																					
50		do 1 mesiaca vrátane	3 007	0,3287											3	0,0003						3 004	0,3284
51		od 1 do 3 mesiacov vrátane																					
52		od 3 do 6 mesiacov vrátane	315	0,0344			315	0,0344															
53		od 6 mesiacov do 1 roka vrátane	40	0,0044			40	0,0044															
54		od 1 do 3 rokov vrátane																					
55		od 3 do 5 rokov vrátane	13 314	1,4556			13 314	1,4556															
56		od 5 do 10 rokov vrátane	11 662	1,2750			11 662	1,2750															
57		od 10 do 15 rokov vrátane																					
58		nad 15 rokov																					
59		nedefinované																					
60		CELKOM	28 338	3,0981			25 331	2,7694							3	0,0003						3 004	0,3284

Skrátená verzia ročnej správy a polročnej správy o hospodárení s majetkom v dôchodkovom fonde

Názov dôchodkového fondu

KLASIK, dlhopisový garantovaný dôchodkový fond VÚB Generali d.s.s., a.s.

Stav ku dňu

30.6.2016

Výkaz aktív a pasív dôchodkového fondu

Označenie	Položka	č. r.	Hodnota v tis. eur k 30.6.2016	Hodnota v tis. eur k 30.6.2016	Hodnota v tis. eur k 30.6.2016
a	b	c	1	2	3
I. Investičný majetok		1	909 042	840 833	841 111
1. Dlhopisy oceňované umorovanou hodnotou		2	53 707	44 338	36 419
a) bez kupónov		3			
b) s kupónmi		4	53 707	44 338	36 419
2. Dlhopisy oceňované reálnou hodnotou		5	570 974	322 926	369 121
a) bez kupónov		6	13 648	15 576	20 025
b) s kupónmi		7	557 326	307 350	349 096
3. Akcie a podiely v obchodných spoločnostiach		8	171 112	112 928	76 946
a) obchodovateľné		9	171 112	112 928	76 946
b) neobchodovateľné		10			
c) podiely v obchodných spoločnostiach, ktoré nemajú formu ceného papiera		11			
d) obstaranie neobchodovateľných akcií a podielov v obchodných spoločnostiach		12			
4. Podielové listy		13			
a) otvorených podielových fondov		14			
b) ostatné		15			
5. Krátkodobé pohľadávky		16			114 870
a) krátkodobé vklady v bankách		17			114 870
b) krátkodobé pôžičky obchodným spoločnostiam, v ktorých má fond majetkový podiel		18			
c) iné		19			
d) obrátené repoobchody		20			
6. Dlhodobé pohľadávky		21	113 249	359 795	243 755
a) dlhodobé vklady v bankách		22	113 249	359 795	243 755
b) dlhodobé pôžičky obchodným spoločnostiam, v ktorých má fond majetkový podiel		23			
7. Deriváty		24		846	
8. Drahé kovy		25			
II. Neinvestičný majetok		26	5 644	2 990	664
9. Peňažné prostriedky a ekvivalenty peňažných prostriedkov		27	2 596	2 658	599
10. Ostatný majetok		28	3 048	332	65
	Aktiva spolu	29	914 686	843 823	841 775
I. Záväzky		30	5 401	182	113
1. Záväzky voči bankám		31			
2. Záväzky z ukončenia dôchodkového sporenia		32			
3. Záväzky voči dôchodkovej správcovskej spoločnosti		33	148	7	21
4. Záväzky z derivátových operácií		34	1 912		
5. Záväzky z repoobchodov		35			
6. Záväzky z vypožičania finančného majetku		36			
7. Ostatné záväzky		37	3 341	175	92
II. Vlastné imanie		38	909 285	843 641	841 662
1. Dôchodkové jednotky na osobných dôchodkových účtoch sporiteľov, z toho		39	909 285	843 641	841 662
a) zisk / strata za účtovné obdobie		40	14 908	6 539	18 828
	Pasíva spolu	41	914 686	843 823	841 775

Výkaz výnosov a nákladov dôchodkového fondu

Označenie	Položka	č. r.	Hodnota v tis. eur k 30.6.2016	Hodnota v tis. eur k 30.6.2016	Hodnota v tis. eur k 30.6.2016
a	b	c	1	2	3
1. Výnosy z úrokov		1	7 513	8 609	8 951
2. Výnosy z podielových listov		2			
3. Výnosy z dividend a z iných podielov na zisku		3	1 117	1 668	1 488
4. Zisk / strata z operácií s cennými papiermi		4	11 880	-1 424	11 792
5. Zisk / strata z operácií s devízami		5	-1 882	107	58
6. Zisk / strata z derivátov		6	-734	846	
7. Zisk / strata z operácií s drahými kovmi		7			
8. Zisk / strata z operácií s iným majetkom		8			
I. Výnos z majetku vo fonde		9	17 894	9 806	22 289
9. Transakčné náklady		10	8	5	4
10. Bankové a iné poplatky		11			
II. Čistý výnos z majetku vo fonde		12	17 886	9 801	22 285
11. Náklady na financovanie fondu		13	209	76	20
III. Čistý zisk / strata zo správy majetku vo fonde		14	17 677	9 725	22 265
12. Náklad na odplatu		15	2 769	3 186	3 437
IV. Zisk / strata dôchodkového fondu za účtovné obdobie		16	14 908	6 539	18 828