

dôchodOK

POLROČNÁ SPRÁVA 2017

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

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

30.06.2017

Označenie	Položka	č. r.	Hodnota v tis. eur
a	b	c	1
1.	Závazky	1	19 345
a)	záväzky voči bankám	2	
b)	záväzky z ukončenia dôchodkového sporenia	3	1
c)	záväzky voči dôchodkovej správcovskej spoločnosti	4	56
d)	záväzky z derivátových operácií	5	1 630
e)	záväzky voči bankám z repoobchodov	6	
f)	záväzky z vypožičania finančného majetku	7	
	ostatné záväzky	8	17 658
2.	Vlastné imanie	9	978 849
a)	dôchodkové jednotky na osobných dôchodkových účtoch sporiteľov	10	967 430
b)	zisk alebo strata za účtovné obdobie	11	11 419
3.	Pasíva spolu	12	998 194

Výkaz výnosov a nákladov dôchodkového fondu

Názov dôchodkového fondu

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

Identifikačný kód

S2203060004

Stav ku dňu

30.06.2017

Označenie	Položka	č. r.	Hodnota v tis. eur
a	b	c	1
1.	Výnosy z úrokov a obdobné výnosy	1	6 366
a)	z peňažných prostriedkov na bežnom účte	2	
b)	z peňažných prostriedkov na vkladovom účte	3	786
c)	z dlhopisov a obdobných dlhových cenných papierov	4	5 580
d)	z nástrojov peňažného trhu	5	
2.	Výnosy z podielových listov a obdobné výnosy	6	19
3.	Výnosy z dividend a iných podielov na zisku	7	909
4.	Výnosy z operácií s cennými papiermi a podielmi	8	13 274
a)	z kapitálových cenných papierov a obdobných cenných papierov	9	
b)	z dlhopisov a iných dlhových cenných papierov	10	10 417
c)	z nástrojov peňažného trhu	11	
d)	z podielových listov a obdobných cenných papierov	12	2 857
5.	Náklady na operácie s cennými papiermi a podielmi	13	7 945
a)	kapitálové cenné papiere a obdobné cenné papiere	14	
b)	dlhopisy a iné dlhové cenné papiere	15	5 220
c)	nástroje peňažného trhu	16	
d)	podielové listy a obdobné cenné papiere	17	2 725
6.	Zisk/strata z operácií s cennými papiermi a podielmi	18	5 329
7.	Zisk/strata z operácií s devízami	19	-786
8.	Zisk/strata z derivátov	20	2 168
9.	Zisk/strata z operácií s drahými kovmi	21	
10.	Zisk/strata z operácií s iným majetkom	22	
I.	Výnos z majetku	23	14 005
11.	Transakčné náklady	24	5
a)	náklady na transakcie s CP platené depozitárovi	25	5
b)	poplatky pri nákupe a predaji CP platené tretej strane	26	
12.	Bankové a iné poplatky	27	115
a)	bankové odplaty a poplatky	28	115
b)	burzové odplaty a poplatky	29	
II.	Čistý výnos z majetku vo fonde	30	13 885
13.	Náklady na financovanie dôchodkového fondu	31	45
III.	Čistý zisk/strata zo správy majetku	32	13 840
14.	Iné výnosy	33	
15.	Náklady na odplaty	34	2 421
a)	náklady na odplatu za správu DF	35	1 430
b)	náklady na odplatu za zhodnotenie majetku v DF	36	937
c)	náklady na iné odplaty	37	54
IV.	Zisk/strata dôchodkového fondu za účtovné obdobie	38	11 419

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

30.6.2017

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

Globálne trhy podporené silnými ekonomickými dátami a očakávanými fiškálnymi stimulmi z kabinetu nového amerického prezidenta D. Trumpa udržiavali prorizikovú náladu investorov aj v prvom štvrtroku 2017, čo sa prejavilo v náraste akciových trhov naprieč všetkými regiónmi, zatiaľ čo výnosy na bezpečných nemeckých dlhopisoch rástli. Obavy ohľadom politického vývoja v Taliansku (hrozba predčasných volieb) a vo Francúzsku (potenciálne víťazstvo ultrapravicovej kandidátky Le Pen) negatívne pôsobili na rozširovanie kreditných spreadov krajín periférie. Tieto obavy sa rozplynuli jasným víťazstvom proeurópskeho kandidáta E. Macrona, čo spolu s poklesom pravdepodobnosti predčasných volieb v Taliansku a s uvoľnením ďalšej pomoci pre Grécko vrátilo kreditné spready týchto krajín na pôvodné úrovne zo začiatku roka. Pozitívny vývoj v Európe sa v druhom kvartáli 2017 prejavil výraznejšie aj na posilnení eura voči doláru, keď za 1H 2017 posilnilo o viac ako 8%. O rozruch na trhoch sa koncom júna postaral guvernér ECB M.Draghi, po ktorého vyjadreniach sa na adresu rastúcich inflačných tlakov výnosy európskych štátnych dlhopisov posunuli výraznejšie smerom nahor. Celkovo za toto obdobie tak výnosy na 10-ročných nemeckých štátnych dlhopisoch narástli o 26bps, zatiaľ čo výnosy na 10-ročných amerických štátnych dlhopisoch poklesli o 14bps.

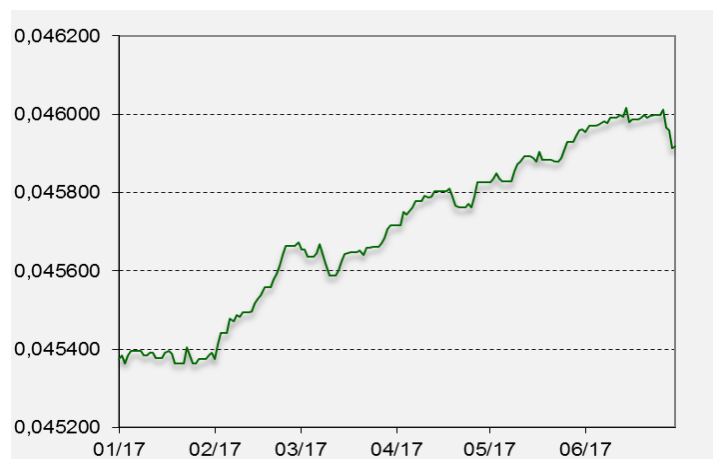
Názov dôchodkového fondu

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

Identifikačný kód

S2203060004

Stav ku dňu

30.6.2017**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

30.6.2017**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 31.12.2016 - 30.6.2017	Hodnota	Absolútna VaR [%]	Relatívna VaR [%]	Využitie VaR limitu	Modifikovaná durácia portfólia
Klasik	30.6.2017	0,45%			1,827
	max	0,58%			2,210
	avg	0,49%			1,974
	min	0,44%			1,827

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

30.06.2017

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		úmrtia
							prírastky	úbytky	prírastky	úbytky	
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12
190 587	33 462 661	377	96 119	94 468	152 359	38 228	1 281	1 809	912	1 464	111

Hlásenie o stave majetku v dôchodkovom fonde

Názov dôchodkového fondu

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

Identifikačný kód

S2203060004

Stav ku dnu

30.06.2017

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	7 981	0,7995
	Prijaté na obchodovanie na trhu kótovaných cenných papierov zahraničnej burzy cenných papierov so sídlom v členskom štáte	6	627 863	62,8999
	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	21 868	2,1908
	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	9 491	0,9508
	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	143 013	14,3272
	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		
	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		
	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		
Peňažné prostriedky na bežných účtoch a vkladových účtoch podľa § 81 ods. 1 písm. f) zákona	na bežnom účte u depozitára	24	3 959	0,3966
	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	167 017	16,7319
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	1 225	0,1227
Cenné papiere, s ktorými sa prestalo obchodovať na regulovanom trhu cenných papierov podľa § 83 ods. 1 zákona		29		
Cenné papiere z nových emisií, ktoré nespĺnili 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	15 777	1,5806
Hodnota majetku v dôchodkovom fonde		34	998 194	100,0000
Objem záväzkov dôchodkového fondu celkom		35	19 345	1,9380
Čistá hodnota majetku v dôchodkovom fonde		36	978 849	98,0620

Gčlenenie podľa emitentov																						
čís.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 %	objem 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	998 194	100,0000			657 712	65,8902	9491	0,9508	143 013	14,3272			170 976	17,1285	1 225	0,1227			15 777	1,5806	
1	Alstria Office Reit -AG	3 191	0,3197			3 191	0,3197															
2	American International Group	4 583	0,4591			4 583	0,4591															
3	Amundi ETF	11 455	1,1476							11 455	1,1476											
4	AT&T Inc	7 470	0,7484			7 470	0,7484															
5	ATF Netherlands BV	4 076	0,4083			4 076	0,4083															
6	Atrium European Real Estate	1 644	0,1647			1 644	0,1647															
7	Azimut Holding Spa	4 143	0,4150			4 143	0,4150															
8	Bank of China Luxembourg SA	5 430	0,5440			5 430	0,5440															
9	Bank Ochrony Srodowiska S.A.	26 129	2,6176											26 129	2,6176							
10	Banque Fed du Credit Mutuel	3 271	0,3277			3 271	0,3277															
11	Barclays Bank plc	7 928	0,7942			7 928	0,7942															
12	Bharti Airtel International	2 179	0,2183			2 179	0,2183															
13	Black Rock	147 330	14,7597							131 558	13,1796									15 772	1,5801	
14	Black Sea Trade AND Development	2 797	0,2802			2 797	0,2802															
15	BNP Paribas	7 111	0,7124			7 111	0,7124															
16	BPCE SA	3 064	0,3070			3 064	0,3070															
17	Bulgaria	21 042	2,1080			21 042	2,1080															
18	Bunne Finance Europe BV	2 874	0,2879			2 874	0,2879															
19	ČESKE DRAHY AS	17 738	1,7770			17 738	1,7771															
20	Cetin Finance BV	8 679	0,8695			8 679	0,8695															
21	CK Hutchison Finance LTD	3 545	0,3551			3 545	0,3551															
22	CNRC Capital LTD	3 665	0,3672			3 665	0,3672															
23	Corp Nacional Del Cobre	3 209	0,3215			3 209	0,3215															
24	Credit Agricole London	4 457	0,4465			4 457	0,4465															
25	Credit Agricole SA	5 003	0,5012			5 003	0,5012															
26	Československá obchodná banka	11 452	1,1473											11 452	1,1473							
27	Deutsche PfandBriefBank AG	7 403	0,7416			7 403	0,7416															
28	DVB BANK SE	9 086	0,9102			9 086	0,9102															
29	EESTI ENERGIA AS	7 224	0,7237			7 224	0,7237															
30	Emirates NBD PJSC	5 166	0,5175			5 166	0,5175															
31	EP ENERGY AS	4 598	0,4606			4 598	0,4606															
32	Erste Sparinvest KAG	9 491	0,9508					9 491	0,9508													
33	FCA Bank Spa Ireland	3 014	0,3019			3 014	0,3019															
34	FCE Bank PLC	4 292	0,4300			4 292	0,4300															
35	Fidelity National Information	493	0,0494			493	0,0494															
36	Flowerserve Corporation	3 000	0,3005			3 000	0,3005															
37	General Motors Financial Co	2 390	0,2403			2 390	0,2403															
38	Global Switch Holdings LTD	4 011	0,4018			4 011	0,4018															
39	Goldman Sachs Group INC	11 012	1,1032			11 012	1,1032															
40	Government of Romania	24 028	2,4071			24 028	2,4071															
41	Hammerson PLC	2 809	0,2814			2 809	0,2814															
42	HSBC Holdings PLC	1 363	0,1365			1 363	0,1365															
43	Industrial AND Commercial Bank	4 407	0,4415			4 407	0,4415															
44	International Investment Bank	5 019	0,5028			5 019	0,5028															
45	Islandsbanki HF	35 176	3,5240											35 176	3,5240							
46	Italy	8 045	0,8060			8 045	0,8060															
47	ITV Plc	4 223	0,4231			4 223	0,4231															
48	KBC Goep NV	1 022	0,1024			1 022	0,1024															
49	Kingdom Of Morocco	5 073	0,5082			5 073	0,5082															
50	Landesbank Berlin AG	4 450	0,4458			4 450	0,4458															
51	Landsbankinn HF	9 400	0,9417			9 400	0,9417															
52	Leaseplan Corporation NV	8 109	0,8124			8 109	0,8124															
53	Leeds Building Society	10 719	1,0738			10 719	1,0738															
54	LYB International Finance II	2 085	0,2089			2 085	0,2089															
55	Macquarie Group LTD	9 539	0,9556			9 539	0,9556															
56	Magyar Export - Import Bank Zrt	2 170	0,2175			2 170	0,2175															
57	Mediabanca SpA	11 007	1,1027			11 007	1,1027															
58	Merlin Properties Socimi SA	3 174	0,3180			3 174	0,3180															
59	Met Life Global Funding	2 041	0,2045			2 041	0,2045															
60	MFB Magyar Felesztési Bank	3 373	0,3379			3 373	0,3379															
61	MFINANCE FRANCE SA	18 375	1,8408			18 375	1,8408															
62	MFSR	46 938	4,7023			46 938	4,7023															
63	Ministerstwo finansíi Polsko	29 368	2,9421			29 368	2,9421															
64	MOL Hungarian Oil AND Gas PLC	1 069	0,1071			1 069	0,1071															
65	Morgan Stanley	1 076	0,1078			1 076	0,1078															
66	Nasdaq INC	2 266	0,2270			2 266	0,2270															
67	Nationwide Building Society	3 498	0,3504			3 498	0,3504															
68	Ne Property Cooperatief UA	1 648	0,1651			1 648	0,1651															
69	NET4GAS SRO	4 511	0,4519			4 511	0,4519															
70	NEX Group Holdings PLC	1 583	0,1586			1 583	0,1586															
71	NIIBC Bank NV	5 485	0,5495			5 485	0,5495															
72	Nomura Europe Finance NV	11 783	1,1804			11 783	1,1804															
73	OP Corporate Bank PLC	3 500	0,3506			3 500	0,3506															
74	Orlen Capital AB	9 073	0,9089			9 073	0,9089															
75	Petróleos Mexicanos	2 132	0,2136			2 132	0,2136															
76	PKO FINANCE AB	13 039	1,3063			13 039	1,3063															
77	Procredit Holding AG AND CO KG	7 876	0,7890			7 876	0,7890															
78	PZU Finance AB	11 236	1,1256			11 236	1,1256															
79	Rabobank Nederland	4 468	0,4476			4 468	0,4476															
80	RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	17 107	1,7138			17 107	1,7138															
81	Republic of Chile	9 574	0,9591			9 574	0,9591															

82	Republic of Indonesia	7 717	0,7731			7 717	0,7731													
83	Republic of Peru	10 469	1,0488			10 469	1,0488													
84	Royal Bank Of Scotland Group	8 197	0,8212			8 197	0,8212													
85	Sabic Capital I BV	6 245	0,6256			6 245	0,6256													
86	Santander Consumer Finance	17 605	1,7637			17 605	1,7637													
87	Societe Generale	11 565	1,1586			11 565	1,1586													
88	SPP - Distribucia AS	4 307	0,4315			4 307	0,4315													
89	SPP Infrastructure Financing	12 074	1,2096			12 074	1,2096													
90	Standard Chartered PLC	9 895	0,9913			9 895	0,9913													
91	State Grid Europe Development	2 061	0,2065			2 061	0,2065													
92	State of Israel	6 060	0,6071			6 060	0,6071													
93	Sumitomo Mitsui Financial Group	1 786	0,1789			1 786	0,1789													
94	TEVA Pharmaceutical Finance	3 964	0,3971			3 964	0,3971													
95	Trinity Acquisition PLC	4 164	0,4172			4 164	0,4172													
96	Türkiye Garanti Bankası	4 978	0,4987			4 978	0,4987													
97	Türkiye Vakıflar Bankası	3 508	0,3514			3 508	0,3514													
98	UBS ETF	2 735	0,2740			2 735	0,2740													
99	UniCredit Bank Czech Republic and Slovak	3 959	0,3966										3 959	0,3966						
100	UniCredit SpA	6 892	0,6904			5 667	0,5677								1 225	0,1227				
101	United Mexican States	16 553	1,6583			16 553	1,6584													
102	Volkswagen AG	1 104	0,1106			1 104	0,1106													
103	Všeobecná úverová banka	62 581	6,2694										62 581	6,2694						
104	VUB Generali d.s.s., a.s.	5	0,0005																5	0,0005
105	Zagrebačka banka d.d.	31 679	3,1736										31 679	3,1736						

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	891 424	89,3037			582 621	58,3675	9 491	0,9508	143 013	14,3272			139 297	13,9549	1 225	0,1227			15 777	1,5806
b	Nečlenské štáty	106 770	10,6963			75 091	7,5227							31 679	3,1736						
	CELKOM	998 194	100,0000			657 712	65,8902	9 491	0,9508	143 013	14,3272			170 976	17,1285	1 225	0,1227			15 777	1,5806
1	SK	5 019	0,5028			5 019	0,5028														
2	7G	2 797	0,2802			2 797	0,2802														
3	AE	5 166	0,5175			5 166	0,5175														
4	AT	26 598	2,6646			17 107	1,7138	9 491	0,9508												
5	AU	9 539	0,9556			9 539	0,9556														
6	BE	1 022	0,1024			1 022	0,1024														
7	BG	21 042	2,1080			21 042	2,1080														
8	CL	12 783	1,2806			12 783	1,2806														
9	CN	4 407	0,4415			4 407	0,4415														
10	CZ	26 847	2,6896			26 847	2,6896														
11	DE	33 110	3,3170			33 110	3,3170														
12	EE	7 224	0,7237			7 224	0,7237														
13	ES	20 779	2,0817			20 779	2,0817														
14	FI	3 500	0,3506			3 500	0,3506														
15	FR	59 844	5,9952			48 389	4,8477			11 455	1,1476										
16	GB	65 189	6,5307			65 189	6,5307														
17	HK	3 665	0,3672			3 665	0,3672														
18	HR	31 679	3,1736											31 679	3,1736						
19	HU	7 212	0,7225			7 212	0,7225														
20	ID	7 717	0,7731			7 717	0,7731														
21	IE	134 572	13,4815			3 014	0,3019			131 558	13,1796										
22	IL	6 060	0,6071			6 060	0,6071														
23	IS	44 576	4,4657			9 400	0,9417							35 176</							

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

S2203060004

Stay ku dňu

30.06.2017

Členenie podľa menového hľadiska

Stavanie podľa menového nariadenia																							
č. r.	Mena	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 %	objem v tis. eur	podiel v %	reálna hodnota v tis. eur	hodnota podkladových o nástroja v tis. eur	podiel v %	objem v tis. eur	podiel v %
a	b	c	1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13	14	15	16	17	18	19	20	21
a	CELKOM EUR		882 933	88,4531			606 174	60,7271			143 013	14,3272			116 744	11,6955	1 225	0,00	0,1227			15 777	1,5806
b	CELKOM USD		33 163	3,3223			17 159	1,7190	9 491	0,9508					6 513	0,6525							
c	CELKOM CZK		47 559	4,7645											47 559	4,7645							
d	CELKOM HUF																						
e	CELKOM PLN		29 369	2,9422			29 368	2,9421							1	0,0001							
f	CELKOM JPY																						
g	CELKOM OSTATNÉ		5 170	0,5179			5 011	0,5020							159	0,0159							
	CELKOM		998 194	100,0000			657 712	65,8902	9 491	0,9508	143 013	14,3272			170 976	17,1285	1 225	0,00	0,1227			15 777	1,5806
1	CZK	6M1R	47 559	4,7645											47 559	4,7645							
2	EUR	6M1R	61 388	6,1499			8 624	0,8640							52 764	5,2859							
3	EUR	M1	21 181	2,1219			1 335	0,1337							3 719	0,3726	350		0,0351			15 777	1,5806
4	EUR	NA	143 013	14,3272							143 013	14,3272											
5	EUR	O1M3M	27 706	2,7756			1 530	0,1533							26 129	2,6176	47		0,0047				
6	EUR	O3M6M	35 309	3,5373			1 057	0,1059							34 132	3,4194	120		0,0120				
7	EUR	R10PR15	28 212	2,8263			28 212	2,8263															
8	EUR	R15P	32 165	3,2223			32 165	3,2223															
9	EUR	R1PR3	105 853	10,6045			105 853	10,6045															
10	EUR	R3PR5	286 741	28,7260			286 643	28,7162									98		0,0098				
11	EUR	R5PR10	141 365	14,1621			140 755	14,1010									610		0,0611				
12	PLN	6M1R	54	0,0054			54	0,0054															
13	PLN	M1	1	0,0001											1	0,0001							
14	PLN	O1M3M	189	0,0189			189	0,0189															
15	PLN	O3M6M	201	0,0201			201	0,0201															
16	PLN	R1PR3	9 807	0,9825			9 807	0,9825															
17	PLN	R3PR5	10 288	1,0307			10 288	1,0307															
18	PLN	R5PR10	8 829	0,8845			8 829	0,8845															
19	OCM8	6M1R	26	0,0026			26	0,0026															
20	OCM8	M1	159	0,0159											159	0,0159							
21	OCM8	R1PR3	969	0,0971			969	0,0971															
22	OCM8	R3PR5	4 016	0,4023			4 016	0,4023															
23	USD	6M1R	6 433	0,6445											6 433	0,6445							
24	USD	M1	112	0,0112			32	0,0032							80	0,0080							
25	USD	NA	9 491	0,9508					9 491	0,9508													
26	USD	O1M3M	56	0,0056			56	0,0056															
27	USD	O3M6M	50	0,0050			50	0,0050															
28	USD	R1PR3	2 726	0,2731			2 726	0,2731															
29	USD	R3PR5	14 295	1,4321			14 295	1,4321															

Skrátená verzia polročnej správy o hospodárení s majetkom v dôchodkovom fonde
KLASIK, dlhopisový garantovaný dôchodkový fond VÚB Generali dôchodková správcovská spoločnosť, a.s. ku dňu 30.6.2017

VÝKAZ AKTÍV A PASÍV DÔCHODKOVÉHO FONDU

OZNA- ČENIE	POLOŽKA	HODNOTA V TIS. EUR K 30.6.2017	HODNOTA V TIS. EUR K 30.6.2016	HODNOTA V TIS. EUR K 30.6.2015
I.	Investičný majetok	978 458	909 042	840 833
1.	Dlhopisy oceňované umorovanou hodnotou	62 572	53 707	44 338
a)	bez kupónov			
b)	s kupónmi	62 572	53 707	44 338
2.	Dlhopisy oceňované reálnou hodnotou	595 140	570 974	322 926
a)	bez kupónov	9 567	13 648	15 576
b)	s kupónmi	585 573	557 326	307 350
3.	Akcie a podiely v obchodných spoločnostiach	143 013	171 112	112 928
a)	obchodovateľné	143 013	171 112	112 928
b)	neobchodovateľné			
c)	podiely v obchodných spoločnostiach, ktoré nemajú formu ceného papiera			
d)	obstaranie neobchodovateľných akcií a podielov v obchodných spoločnostiach			
4.	Podielové listy	9 491		
a)	otvorených podielových fondov	9 491		
b)	ostatné			
5.	Krátkodobé pohľadávky	94 178		
a)	krátkodobé vklady v bankách	94 178		
b)	krátkodobé pôžičky obchodným spoločnostiam, v ktorých má fond majetkový podiel			
c)	iné			
d)	obrátené repoobchody			
6.	Dlhodobé pohľadávky	72 839	113 249	359 795
a)	dlhodobé vklady v bankách	72 839	113 249	359 795
b)	dlhodobé pôžičky obchodným spoločnostiam, v ktorých má fond majetkový podiel			
7.	Deriváty	1 225		846
8.	Drahé kovy			
II.	Neinvestičný majetok	19 736	5 644	2 990
9.	Peňažné prostriedky a ekvivalenty peňažných prostriedkov	3 959	2 596	2 658
10.	Ostatný majetok	15 777	3 048	332
	Aktíva spolu	998 194	914 686	843 823
I.	Závazky	19 345	5 401	182
1.	Závazky voči bankám			
2.	Závazky z ukončenia dôchodkového sporenia	1		
3.	Závazky voči dôchodkovej správcovskej spoločnosti	56	148	7
4.	Závazky z derivátových operácií	1 630	1 912	
5.	Závazky z repoobchodov			
6.	Závazky z vypožičania finančného majetku			
7.	Ostatné záväzky	17 658	3 341	175
II.	Vlastné imanie	978 849	909 285	843 641
1.	Dôchodkové jednotky na osobných dôchodkových účtoch sporiteľov, z toho	978 849	909 285	843 641
a)	zisk / strata za účtovné obdobie	11 419	14 908	6 539
	Pasíva spolu	998 194	914 686	843 823

VÝKAZ VÝNOSOV A NÁKLADOV DÔCHODKOVÉHO FONDU

OZNA- ČENIE	POLOŽKA	HODNOTA V TIS. EUR K 30.6.2017	HODNOTA V TIS. EUR K 30.6.2016	HODNOTA V TIS. EUR K 30.6.2015
1.	Výnosy z úrokov	6 366	7 513	8 609
2.	Výnosy z podielových listov	19		
3.	Výnosy z dividend a z iných podielov na zisku	909	1 117	1 668
4.	Zisk / strata z operácií s cennými papiermi	5 329	11 880	-1 424
5.	Zisk / strata z operácií s devízami	-786	-1 882	107
6.	Zisk / strata z derivátov	2 168	-734	846
7.	Zisk / strata z operácií s drahými kovmi			
8.	Zisk / strata z operácií s iným majetkom			
I.	Výnos z majetku vo fonde	14 005	17 894	9 806
9.	Transakčné náklady	5	7	5
10.	Bankové a iné poplatky	115	107	84
II.	Čistý výnos z majetku vo fonde	13 885	17 780	9 717
11.	Náklady na financovanie fondu	45	209	76
III.	Čistý zisk/strata zo správy majetku vo fonde	13 840	17 571	9 641
12.	Náklad na odplaty	2 421	2 663	3 102
IV.	Zisk / strata dôchodkového fondu za účtovné obdobie	11 419	14 908	6 539