

Ročná správa o hospodárení s majetkom v dôchodkovom fonde

k 31. 12. 2023

Solid – Dlhopisový garantovaný d.f.

NN dôchodková správcovská spoločnosť, a.s.



Hlásenie o najvýznamnejších skutočnostiach dôchodkového fondu

Názov dôchodkového fondu

Solid - Dlhopisový garantovaný d.f. NN d.s.s., a.s.

Identifikačný kód

S2203060010

Stav ku dňu

31.12.2023

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

Rok 2023 priniesol výrazné zlepšenie situácie na finančných trhoch. Globálne akcie merané indexom MSCI World vlni vzrástli o viac ako 17%. Z rastu sa tešili aj európske dlhopisové trhy, keď stúpili o takmer 5%. Podľa našich očakávaní začala vlni významne klesať inflácia po celom svete pri výraznom poklese najmä cien energií. Spolu s tým sa priblížil koniec zvyšovania úrokových sadzieb zo strany centrálnych bánk. Nepotvrdili sa ani negatívne scenáre o silnom ekonomickom poklese. Dlhopisové fondy dosiahli o niečo menšie zhodnotenie z dôvodu pokračujúcej politiky vysokých úrokových sadzieb.

Vstup do minulého roku bol poznačený očakávaním hospodárskej recesie po roku negatívneho výkonu akcií i dlhopisov. Vlni zhruba v tomto čase predseda americkej centrálnej banky (Fedu) Jerome Powell vyhlásil, že Fed bude držať kurz zvyšovania sadzieb, kým nebude práca hotová. Dnes sa inflácia v celom vyspelom svete pohybuje na oveľa priaznivejších úrovniach, to všetko pri zachovaní ekonomického rastu. Recesia, ktorej sa mnohí obávali, zatiaľ nenastala. Toto prostredie podnietilo Fed k tomu, aby na svojom poslednom zasadnutí v roku 2023 oznámil obrat vo svojej politike. Tvorcovia monetárnej politiky v USA uvádzajú, že v roku 2024 počítajú so znížením úrokových sadzieb.

V Európe bolo veľkým strašiakom zvýšenie cien energií a tiež verejné dlhy, najmä v kombinácii s rastom úrokových sadzieb. Európske akciové trhy ale končia rok v značne lepšej kondícii, než sa očakávalo. Jedným z rysov európskych finančných trhov v roku 2023 bola divergencia medzi ekonomikou a trhmi. To platí najmä pre Nemecko, najväčšiu európsku ekonomiku, ktorá zažila technickú recesiu s poklesom HDP o 0,4 %, ale jej akciový trh patril medzi najvýkonnejšie v regióne.

Pod rast hodnoty dôchodkovej jednotky fondu Solid - Dlhopisový garantovaný d.f. NN d.s.s., a.s., ktorý za uplynulý polrok činil + 4,69 %, sa podpísal mierny rast na svetových dlhopisových trhoch.

Náš výhľad pre rok 2024 je vcelku priaznivý. Po tom, čo globálna ekonomika dokázala relatívne úspešne absorbovať dopady strmej inflácie, vysokých úrokov a to na pozadí prebiehajúcich vojenských konfliktov, tento rok by sa mohla spotreba domácnosti zotavovať pri očakávanom raste reálnych miezd. Výsledkom by mohlo byť mierne oživenie ekonomického rastu vo svete, z čoho by mali ťažiť akcie. U dlhopisovej triedy aktív očakávame mierne kladné zisky v tomto roku, keď aj po výraznom poklese výnosov v závere minulého roka stále nesú na ročnej báze slušné výnosy. Zároveň by mal priaznivo pôsobiť očakávaný ďalší pokles úrokových sadzieb na ceny dlhopisov. Naiväčšou neistotou pre náš výhľad je vývoj na vojnových frontoch a výsledkv dôležitých volieb vo veľkej časti sveta v roku 2024. osobitne

Názov dôchodkového fondu

Solid - Dlhopisový garantovaný d.f. NN d.s.s., a.s.

Identifikačný kód

S2203060010

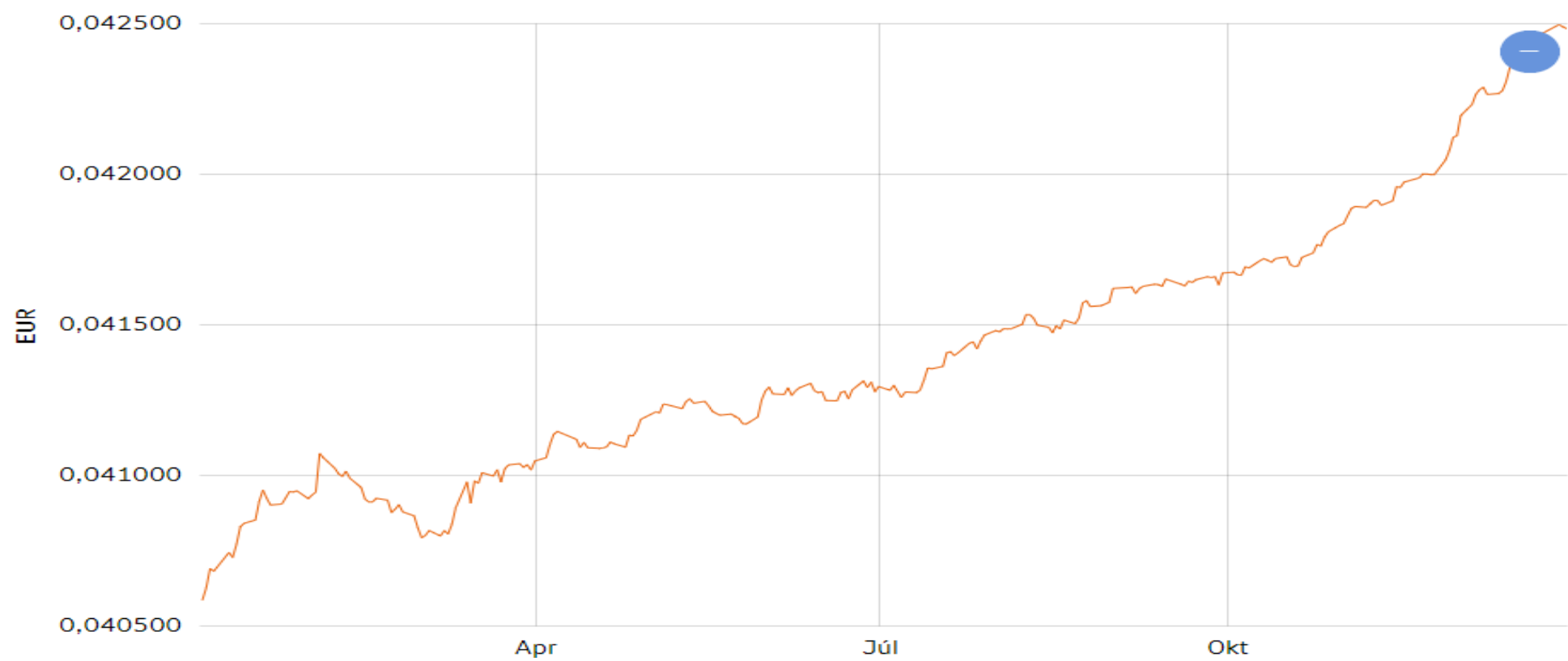
Stav ku dňu

31.12.2023

2. Grafické znázornenie vývoja hodnoty dôchodkovej jednotky

Vývoj hodnoty dôchodkovej jednotky

od 1.1.2023 do 31.12.2023



Hodnota DJ 31.12.2023

0,042486

Názov dôchodkového fondu

Solid - Dlhopisový garantovaný d.f. NN d.s.s., a.s.

Identifikačný kód

S2203060010

Stav ku dňu

31.12.2023

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

Spoločnosť NN d.s.s., a.s. vypočítava celkové riziko, ktorému je majetok dôchodkového fondu vystavený, ako trhové riziko. Metóda použitá na výpočet trhového rizika je absolútna hodnota v riziku a je počítaná na 250-dňovom rade pozorovaní hodnôt dôchodkovej jednotky fondu. Na základe predpokladu normálneho rozdelenia zmien dôchodkovej jednotky je vypočítaná hodnota v riziku na 99%-nom jednostrannom intervale spoľahlivosti pre časový horizont 1 dňa. Tento výsledok je následne škálovaný pravidlom druhej odmocniny času na želaný časový horizont. Výsledky a predpoklady výpočtu sú spätne testované porovnaním vypočítanej jednodňovej hodnoty v riziku s následne realizovanou zmenou hodnoty majetku dôchodkového fondu, pričom v prípade, kedy výsledky spätného testovania naznačujú porušenie predpokladov výpočtu je výsledok výpočtu ďalej primerane navýšený. K 31.12.2023 je takto vypočítaná hodnota v riziku pre časový horizont 20 dní na úrovni 0,5% čistej hodnoty majetku v dôchodkovom fonde.

Dof (HMF) 03-02

Hlásenie o stave majetku v dôchodkovom fonde

Názov dôchodkového fondu

Solid – Dlhopisový garantovaný dôchodkový fond NN dôchodková správcovská spoločnosť, a.s.

Identifikačný kód

52203060010

Stav ku dňu

31.12.2023

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	0,00	0,0000
	Prijaté na obchodovanie na trhu kótovaných cenných papierov zahraničnej burzy cenných papierov so sídlom v členskom štáte	2		0,0000
	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		0,0000
	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 zrejmé, že sa toto prijatie uskutoční do jedného roka od dátumu vydania emisie cenných papierov	4		0,0000
Dlhopisy a iné dlhové cenné papiere	Prijaté na obchodovanie na trhu kótovaných cenných papierov burzy cenných papierov	5	1045848,00	98,4204
	Prijaté na obchodovanie na trhu kótovaných cenných papierov zahraničnej burzy cenných papierov so sídlom v členskom štáte	6		0,0000
	Prijaté na obchodovanie na inom regulovanom trhu so sídlom v štáte, ktorý je súčasťou Európskeho hospodárskeho	7		0,0000
	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 zrejmé, že sa toto prijatie uskutoční do jedného roka od dátumu vydania emisie cenných papierov	8		0,0000
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	5189,00	0,4883
	Prijaté na obchodovanie na trhu kótovaných cenných papierov zahraničnej burzy cenných papierov so sídlom v členskom štáte	10		0,0000
	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		0,0000
	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 zrejmé, že sa toto prijatie uskutoční do jedného roka od dátumu vydania emisie cenných papierov	12		0,0000
	Prijaté na obchodovanie na trhu kótovaných cenných papierov burzy cenných papierov	13	0,00	0,0000
	Prijaté na obchodovanie na trhu kótovaných cenných papierov zahraničnej burzy cenných papierov so sídlom v členskom štáte	14		0,0000

Cenné papiere iných zahraničných subjektov kolektívneho investovania podľa § 81 ods. 1 písm. d) zákona	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		0,0000
	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 zrejmé, že sa toto prijatie uskutoční do jedného roka od dátumu vydania emisie cenných papierov	16		0,0000
Nástroje peňažného trhu podľa § 81 ods. 1 písm. e) zákona	Vydané alebo zaručené Ministerstvom financií SR alebo Národnou bankou Slovenska	17	0,00	0,0000
	Vydané alebo zaručené členským štátom a jeho centrálnymi orgánmi	18		0,0000
	Vydané alebo zaručené centrálnou bankou členského štátu	19		0,0000
	Vydané alebo zaručené orgánmi miestnej správy členského štátu	20		0,0000
	Vydané alebo zaručené ECB, EÚ, EIB, IBRD, IFA, CEB, IADB, ADB, AFDB, CDB, NIB, EBRD, EIF, IMF, BIS, MIGA	21		0,0000
	Vydané alebo zaručené emitentom, ktorého cenné papiere boli prijaté na obchodovanie na regulovanom trhu	22		0,0000
	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		0,0000
Peňažné prostriedky na bežných účtoch a vkladových účtoch podľa § 81 ods. 1 písm. f) zákona	na bežnom účte u depozitára	24	2299,00	0,2163
	na vkladovom účte u depozitára	25	9009,00	0,8478
	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		0,0000
	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		0,0000
	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	0,00	0,0000
Cenné papiere, s ktorými sa prestalo obchodovať na regulovanom trhu cenných papierov podľa § 83 ods. 1 zákona	29		0,0000	
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		0,0000	
Cenné papiere, ktoré nie sú prijaté na obchodovanie na regulovanom trhu	31		0,0000	
Iný majetok	32	0,00	0,0000	
Objem pohľadávok dôchodkového fondu celkom	33	288,00	0,0271	
Hodnota majetku v dôchodkovom fonde	34	1062633,00	100,0000	
Objem záväzkov dôchodkového fondu celkom	35	5201,00	0,4894	
Čistá hodnota majetku v dôchodkovom fonde	36	1057432,00	99,5106	

Názov dôchodkového fondu

Solid – Dlhopisový garantovaný dôchodkový fond NN dôchodková správcovská spoločnosť, a.s.

Identifikačný kód

52203060010

Stav ku dňu

31.12.2023

Členenie 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 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
0	CELKOM																				
1	AGENCE FRANCE LOCALE	4687,00	0,4411	0,00	0,0000	4687,00	0,4411	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000
2	Amundi Floating Rate Euro Corp	5189,00	0,4883	0,00	0,0000	0,00	0,0000	5189,00	0,4883	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000
3	BANK GOSPODARSTWA KRAJOW	10420,00	0,9806	0,00	0,0000	10420,00	0,9806	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000
4	BELGIUM KINGDOM	19405,00	1,8261	0,00	0,0000	19405,00	1,8261	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000
5	BOOKING HOLDINGS INC	1146,00	0,1078	0,00	0,0000	1146,00	0,1078	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000
6	BPIFRANCE FINANCEMENT SA	24162,00	2,2738	0,00	0,0000	24162,00	2,2738	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000
7	BULGARIA	3465,00	0,3261	0,00	0,0000	3465,00	0,3261	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000
8	BUONI POLIENNALI DEL TES	31,00	0,0029	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0029
9	CA IMMOBILIEN ANLAGEN AG	2490,00	0,2343	0,00	0,0000	2490,00	0,2343	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000
10	CESKA EXPORTNI BANKA AS	5060,00	0,4762	0,00	0,0000	5060,00	0,4762	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000
11	CESKA SPORITELNA AS	21860,00	2,0572	0,00	0,0000	21860,00	2,0572	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000
12	CESKE DRAHY	11150,00	1,0493	0,00	0,0000	11150,00	1,0493	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000
13	CEZ AS	19596,00	1,8441	0,00	0,0000	19596,00	1,8441	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000
14	COMMERZBANK AG	3433,00	0,3231	0,00	0,0000	3433,00	0,3231	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000
15	CONTI-GUMMI FINANCE B.V.	2946,00	0,2772	0,00	0,0000	2946,00	0,2772	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000
16	CROATIA	457,00	0,0430	0,00	0,0000	457,00	0,0430	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000
17	CTP BV	2509,00	0,2361	0,00	0,0000	2509,00	0,2361	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000
18	CTP NV	8525,00	0,8023	0,00	0,0000	8525,00	0,8023	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000
19	CZECH GAS NETWORKS INV	20763,00	1,9539	0,00	0,0000	20763,00	1,9539	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000
20	CZECH REPUBLIC	28686,00	2,6995	0,00	0,0000	28686,00	2,6995	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000
21	Dexia SA	18486,00	1,7396	0,00	0,0000	18486,00	1,7396	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000
22	Dexia SA	54002,00	5,0819	0,00	0,0000	54002,00	5,0819	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000
23	EFSS	3817,00	0,3592	0,00	0,0000	3817,00	0,3592	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000
24	ENEL FINANCE INTL NV	3250,00	0,3058	0,00	0,0000	3250,00	0,3058	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000
25	EP INFRASTRUCTURE AS	18158,00	1,7088	0,00	0,0000	18158,00	1,7088	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000
26	ERSTE BANK HUNGARY ZRT	10634,00	1,0007	0,00	0,0000	10634,00	1,0007	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000
27	ERSTE&STEIERMAR	23920,00	2,2510	0,00	0,0000	23920,00	2,2510	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000
28	EUROFIMA	28033,00	2,6381	0,00	0,0000	28033,00	2,6381	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000
29	EUROPEAN INVESTMENT BANK	64618,00	6,0809	0,00	0,0000	64618,00	6,0809	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000
30	EUSTREAM AS	15047,00	1,4160	0,00	0,0000	15047,00	1,4160	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000
31	EXPORT-IMPORT BANK KOREA	29839,00	2,8080	0,00	0,0000	29839,00	2,8080	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000
32	FADE	14307,00	1,3464	0,00	0,0000	14307,00	1,3464	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000
33	FLEMISH COMMUNITY	9171,00	0,8630	0,00	0,0000	9171,00	0,8630	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000
34	HAMBURG COMMERCIAL BANK	3123,00	0,2939	0,00	0,0000	3123,00	0,2939	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000
35	HONG KONG	10910,00	1,0267	0,00	0,0000	10910,00	1,0267	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000
36	HOWOGE WOHNUNGS	4835,00	0,4550	0,00	0,0000	4835,00	0,4550	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000
37	HUNGARIAN DEVELOPMENT BA	25641,00	2,4130	0,00	0,0000	25641,00	2,4130	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000
38	HYPONOE LB NOE WIEN AG	4554,00	0,4286	0,00	0,0000	4554,00	0,4286	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000
39	INTESA SANPAOLO SPA	8926,00	0,8400	0,00	0,0000	8926,00	0,8400	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000
40	LAND NIEDERSACHSEN	9543,00	0,8981	0,00	0,0000	9543,00	0,8981	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000
41	LITHUANIA GOVERNMENT BOND	11721,00	1,1030	0,00	0,0000	11721,00	1,1030	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000
42	LUMINOR BANK	10201,00	0,9600	0,00	0,0000	10201,00	0,9600	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000
43	MOL HUNGARIAN OIL & GAS	15117,00	1,4226	0,00	0,0000	15117,00	1,4226	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000
44	MONETA MONEY BANK	13515,00	1,2718	0,00	0,0000	13515,00	1,2718	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000
45	MVM ENERGETIKA ZRT	14475,00	1,3622	0,00	0,0000	14475,00	1,3622	0,00	0,0000												

Názov dôchodkového fondu

Solid – Dlhopisový garantovaný dôchodkový fond NN dôchodková správcovská spoločnosť, a.s.

Identifikačný kód

52203060010

Stav ku dňu

31.12.2023

Členenie 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
0	CELKOM																				
54	REPUBLIC OF CHILE	24815,00	2,3352	0,00	0,0000	24815,00	2,3352	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000
55	REPUBLIC OF LITHUANIA	37215,00	3,5021	0,00	0,0000	37215,00	3,5021	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000
56	REPUBLIC OF POLAND	49769,00	4,6836	0,00	0,0000	49769,00	4,6836	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000
57	RLB OBEROESTERREICH	12061,00	1,1350	0,00	0,0000	12061,00	1,1350	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000
58	ROMANIA	12520,00	1,1782	0,00	0,0000	12520,00	1,1782	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000
59	SLOVAKIA GOVERNMENT BOND	93368,00	8,7865	0,00	0,0000	93368,00	8,7865	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000
60	SLOVENSKA SPORITELNA	9146,00	0,8607	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	9009,00	0,8478	0,00	0,0000	0,00	0,0000	137,00	0,0129
61	SLOVENSKÁ SPORITELNÁ AS	14776,00	1,3905	0,00	0,0000	12477,00	1,1742	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	2299,00	0,2163	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000
62	SOCIETE GENERALE	15186,00	1,4291	0,00	0,0000	15186,00	1,4291	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000
63	SPP INFRASTRUCTURE FIN	4470,00	0,4207	0,00	0,0000	4470,00	0,4207	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000
64	TATRA BANKA AS	33030,00	3,1083	0,00	0,0000	33030,00	3,1083	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000
65	UNICREDIT SPA	3494,00	0,3288	0,00	0,0000	3494,00	0,3288	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000
66	Unedic	16945,00	1,5946	0,00	0,0000	16945,00	1,5946	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000
67	VOLKSWAGEN BANK GMBH	8018,00	0,7545	0,00	0,0000	8018,00	0,7545	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000
68	VOLKSWAGEN FIN SERV AG	1526,00	0,1436	0,00	0,0000	1526,00	0,1436	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000
69	VOLKSWAGEN LEASING GMBH	1483,00	0,1396	0,00	0,0000	1483,00	0,1396	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000
70	VSEOBECNA UVEROVA BANKA	1893,00	0,1781	0,00	0,0000	1893,00	0,1781	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000
71	ZAPADOSLOVENSKA ENRG AS	8006,00	0,7534	0,00	0,0000	8006,00	0,7534	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000
72	NN d.s.s.	120,00	0,0113	0,00	0,0000	0,0000	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	120,00	0,0113

Názov dôchodkového fondu

Solid – Dlhopisový garantovaný dôchodkový fond NN dôchodková správcovská spoločnosť, a.s.

Identifikačný kód

52203060010

Stav ku dňu

31.12.2023

Čítenie podľa
sektorového hľadiska

č. r.	Sekcie klasifikácie ekonomických činností	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
0	CELKOM																				
1	1920	29661,00	2,7913	0,00	0,0000	29661,00	2,7913	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000
2	3511	49010,00	4,6121	0,00	0,0000	49010,00	4,6121	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000
3	3513	14475,00	1,3622	0,00	0,0000	14475,00	1,3622	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000
4	3522	41118,00	3,8694	0,00	0,0000	41118,00	3,8694	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000
5	4920	11149,00	1,0492	0,00	0,0000	11149,00	1,0492	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000
6	5911	1145,00	0,1078	0,00	0,0000	1145,00	0,1078	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000
7	6419	26407,00	2,4851	0,00	0,0000	26407,00	2,4851	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000
8	6430	5189,00	0,4883	0,00	0,0000	0,00	0,0000	5189,00	0,4883	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000
9	6491	3008,00	0,2831	0,00	0,0000	3008,00	0,2831	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000
10	6499	429779,00	40,4447	0,00	0,0000	418214,00	39,3564	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	11308,00	1,0641	0,00	0,0000	0,00	0,0000	257,00	0,0242
11	6820	24025,00	2,2609	0,00	0,0000	24025,00	2,2609	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000
12	8411	427667,00	40,2460	0,00	0,0000	427636,00	40,2431	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	31,00	0,0029

Názov dôchodkového fondu

Solíd – Dlhopisový garantovaný dôchodkový fond NN dôchodková správcovská spoločnosť, a.s.

Identifikačný kód

52203060010

Stav ku dňu

31.12.2023

Členenie podľa menového hľadiska

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 nástroja v tis. eur	podiel v %	objem 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		
0a	CELKOM EUR		1062633,00	100,0000	0,00	0,0000	1045848,00	98,4204	5189,00	0,4883	0,00	0,0000	0,00	0,0000	11308,00	1,0641	0,00	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	288,00	0,0271
0b	CELKOM USD		0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000
0c	CELKOM CZK		0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000
0d	CELKOM HUF		0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000
0e	CELKOM PLN		0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000
0f	CELKOM JPY		0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000
0g	CELKOM OSTATNÉ		0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000
1	EUR	6M1R	1051037,00	98,9087	0,00	0,0000	1045848,00	98,4204	5189,00	0,4883	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000				0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	
2	EUR	M1	11308,00	1,0641	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	11308,00	1,0641				0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	
3	EUR	NA	288,00	0,0271	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000				0,0000	0,00	0,0000	288,00	0,0271	

Dof (SP) 17-02

Hlásenie o vývoji počtu sporiteľov

Názov dôchodkového fondu

Solid – Dlhopisový garantovaný dôchodkový fond NN dôchodková správcovská spoločnosť, a.s.

LEI

315700UD30CZ5VHFFW92

Identifikačný kód

S2203060010

Stav ku dňu

31.12.2023

		Hodnota
a	b	1
Počet sporiteľov	1	240 927
Objem príspevkov v eurách	2	121 136 103
Objem penále v eurách	3	0

Dof (PAS) 31-02

Výkaz pasív dôchodkového fondu

Názov dôchodkového fondu

Solid – Dlhopisový garantovaný dôchodkový fond NN dôchodková správcovská spoločnosť, a.s.

Identifikačný kód

S2203060010

Stav ku dňu

31.12.2023

Označenie	Položka	č. r.	Hodnota v tis. eur
a	b	c	1
1.	Záväzky	1	5 201
a)	záväzky voči bankám	2	0
b)	záväzky z ukončenia dôchodkového sporenia	3	4 670
c)	záväzky voči dôchodkovej správcovskej spoločnosti	4	407
d)	záväzky z derivátových operácií	5	0
e)	záväzky voči bankám z repoobchodov	6	0
f)	záväzky z vypožičania finančného majetku	7	0
	ostatné záväzky	8	124
2.	Vlastné imanie	9	1 057 432
a)	dôchodkové jednotky na osobných dôchodkových účtoch sporiteľov	10	1 004 564
b)	zisk alebo strata za účtovné obdobie	11	52 868
3.	Pasíva spolu	12	1 062 633

Dof (VVN) 32-02

Výkaz výnosov a nákladov dôchodkového fondu

Názov dôchodkového fondu

Solid – Dlhopisový garantovaný dôchodkový fond NN dôchodková správcovská spoločnosť, a.s.

Identifikačný kód

S2203060010

Stav ku dňu

31.12.2023

Označenie a	Položka b	č. r. c	Hodnota v tis. eur 1
1.	Výnosy z úrokov a obdobné výnosy	1	20 793
a)	z peňažných prostriedkov na bežnom účte	2	0
b)	z peňažných prostriedkov na vkladovom účte	3	2 775
c)	z dlhopisov a obdobných dlhových cenných papierov	4	18 018
d)	z nástrojov peňažného trhu	5	0
2.	Výnosy z podielových listov a obdobné výnosy	6	0
3.	Výnosy z dividend a iných podielov na zisku	7	0
4.	Výnosy z operácií s cennými papiermi a podielmi	8	858
a)	z kapitálových cenných papierov a obdobných cenných papierov	9	0
b)	z dlhopisov a iných dlhových cenných papierov	10	667
c)	z nástrojov peňažného trhu	11	19
d)	z podielových listov a obdobných cenných papierov	12	172
5.	Náklady na operácie s cennými papiermi a podielmi	13	-36 490
a)	kapitálové cenné papiere a obdobné cenné papiere	14	0
b)	dlhopisy a iné dlhové cenné papiere	15	-36 429
c)	nástroje peňažného trhu	16	0
d)	podielové listy a obdobné cenné papiere	17	-61
6.	Zisk/strata z operácií s cennými papiermi a podielmi	18	37 348
7.	Zisk/strata z operácií s devízami	19	0
8.	Zisk/strata z derivátov	20	636
9.	Zisk/strata z operácií s drahými kovmi	21	0
10.	Zisk/strata z operácií s iným majetkom	22	0
I.	Výnos z majetku	23	58 777
11.	Transakčné náklady	24	0
a)	náklady na transakcie s CP platené depozitárovi	25	0
b)	poplatky pri nákupe a predaji CP platené tretej strane	26	0
12.	Bankové a iné poplatky	27	461
a)	bankové odplaty a poplatky	28	461
b)	burzové odplaty a poplatky	29	0
II.	Čistý výnos z majetku vo fonde	30	58 316
13.	Náklady na financovanie dôchodkového fondu	31	0
III.	Čistý zisk/strata zo správy majetku	32	58 316
14.	Iné výnosy	33	0
15.	Náklady na odplaty	34	5 438
a)	náklady na odplatu za správu DF	35	5 296
b)	náklady na odplatu za zhodnotenie majetku v DF	36	142
c)	náklady na iné odplaty	37	0
IV.	Zisk/strata dôchodkového fondu za účtovné obdobie	38	52 878

Skrátená verzia ročnej správy o hospodárení s majetkom v dôchodkovom fonde

Názov dôchodkového fondu

Solid - Dlhopisový garantovaný dôchodkový fond NN d.s.s., a.s.

Stav ku dňu

31.12.2023

Výkaz aktív a pasív dôchodkového fondu

Označenie	Položka	Č.r.	V tis. EUR 31.12.2023	V tis. EUR 31.12.2022	V tis. EUR 31.12.2021
I.	Investičný majetok	1	1 060 046	1 190 463	1 356 848
1.	Dlhopisy oceňované umorovanou hodnotou	2	268 107	233 800	40 944
a)	bez kupónov	3	50 847	55 149	4 950
b)	s kupónmi	4	217 260	178 651	35 994
2.	Dlhopisy oceňované reálnou hodnotou	5	777 741	771 583	1 227 604
a)	bez kupónov	6	83 845	114 061	125 151
b)	s kupónmi	7	693 896	657 522	1 102 453
3.	Akcie a podiely v obchodných spoločnostiach	8	-	-	-
a)	obchodovateľné	9	-	-	-
b)	neobchodovateľné	10	-	-	-
c)	podiely v obchodných spoločnostiach, ktoré nemajú formu cenného papiera	11	-	-	-
d)	obstaranie neobchodovateľných akcií a podielov v obchodných spoločnostiach	12	-	-	-
4.	Podielové listy	13	5 189	9 568	88 301
a)	otvorených podielových fondov	14	5 189	9 568	88 301
b)	ostatné	15	-	-	-
5.	Krátkodobé pohľadávky	16	9 009	175 512	-
a)	krátkodobé vklady v bankách	17	9 009	175 512	-
b)	krátkodobé pôžičky obchodným spoločnostiam, v ktorých má dôchodkový fond majetkový podiel	18	-	-	-
c)	iné	19	-	-	-
d)	obrátené repoobchody	20	-	-	-
6.	Dlhodobé pohľadávky	21	-	-	-
a)	dlhodobé vklady v bankách	22	-	-	-
b)	dlhodobé pôžičky obchodným spoločnostiam, v ktorých má dôchodkový fond majetkový podiel	23	-	-	-
7.	Deriváty	24	-	-	-
8.	Drahé kovy	25	-	-	-
II.	Neinvestičný majetok	26	2 587	32 034	2 577
9.	Peňažné prostriedky a ekvivalenty peňažných prostriedkov	27	2 299	30 220	2 342
10.	Ostatný majetok	28	288	1 814	235
	Aktíva spolu	29	1 062 633	1 222 497	1 359 425

I.	Závazky	30	5 201	3 699	3 032
1.	Závazky voči bankám	31	-	-	-
2.	Závazky z ukončenia dôchodkového sporenia	32	4 670	3 264	2 537
3.	Závazky voči dôchodkovej správcovskej spoločnosti	33	407	311	347
4.	Závazky z derivátových operácií	34	-	-	-
5.	Závazky z repoobchodov	35	-	-	-
6.	Závazky z vypožičania finančného majetku	36	-	-	-
7.	Ostatné záväzky	37	124	124	148
II.	Vlastné imanie	38	1 057 432	1 218 798	1 356 393
1.	Dôchodkové jednotky na osobných dôchodkových účtoch sporiteľov, z toho	39	1 057 432	1 218 798	1 356 393
a)	zisk alebo strata za účtovné obdobie	40	52 868	(131 198)	(15 237)
	Pasíva spolu	41	1 062 633	1 222 497	1 359 425

Výkaz výnosov a nákladov dôchodkového fondu

Označenie	Položka	Č.r.	V tis. EUR 1.1.-31.12.2023	V tis. EUR 1.1.-31.12.2022	V tis. EUR 1.1.-31.12.2021
1.	Výnosy z úrokov	1.	20 793	10 269	7 717
2.	Výnosy z podielových listov	2.	-	83	518
3.	Výnosy z dividend a z iných podielov na zisku	3.	-	-	-
4.	Zisk / strata z operácií s cennými papiermi	4.	37 348	(149 911)	(18 090)
5.	Zisk/strata z operácií s devízami	5.	-	-	-
6.	Zisk/strata z derivátov	6.	636	12 868	-
7.	Zisk/strata z operácií s drahými kovmi	7.	-	-	-
8.	Zisk/strata z operácií s iným majetkom	8.	-	-	-
I.	Výnos z majetku	9.	58 777	(126 691)	(9 855)
9.	Transakčné náklady	10.	9	109	-
10.	Bankové a iné poplatky	11.	462	521	562
II.	Čistý výnos z majetku	12.	58 306	(127 321)	(10 417)
11.	Náklady na financovanie fondu	13.	-	-	-
III.	Čistý zisk / strata zo správy majetku	14.	58 306	(127 321)	(10 417)
12.	Náklady na odplaty	15.	5 438	3 877	4 820
IV.	Zisk / strata dôchodkového fondu za účtovné obdobie	16.	52 868	(131 198)	(15 237)