

Ročná správa o hospodárení s majetkom v dôchodkovom fonde

k 31. 12. 2019

Index Euro – Indexový negarantovaný d.f.

NN dôchodková správcovská spoločnosť, a.s.



Hlásenie o najvýznamnejších skutočnostiach dôchodkového fondu

Názov dôchodkového fondu

Index Euro - Indexový negarantovaný dôchodkový fond NN dôchodková správcovská spoločnosť, a.s.

Identifikačný kód

S1903120050

Stav ku dňu

31.12.2019

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

Finančné trhy sa z výrazných strát v závere roka 2018 pomerne rýchlo otriasli a netrvalo dlho, kým sa akciové trhy po celom svete dostali na nové historické maximá. Rok 2019 sa tak stal pre finančné trhy najúspešnejším od roku 2009. A darilo sa všetkým hlavným triedam finančných aktív – akciám, štátnym i podnikovým dlhopisom, aj komoditám či realitnému trhu. Aktíva po celom svete rástli navzdory faktu, že nové prichádzajúce makroekonomické dáta potvrdili výrazné spomalenie ekonomického rastu vo svete. Finančným trhom však na nové maximá pomohli predovšetkým centrálné banky, ktoré sa po krátkej odmlke vrátili k výrazným podporným opatreniam a pristúpili k opätovnému uvoľňovaniu menových podmienok. Tým sa rozplynula bezprostredná hrozba hospodárskej recesie, čo trhy ocenili výrazným rastom finančných aktív. V minulom roku znížilo svoje sadzby dokopy 25 centrálnych bánk po celom svete, čo je najvyšší počet od finančnej krízy. Ešte viac ako pomalý ekonomický rast trápi centrálné banky nízka miera inflácie, ktorú sa im už roky nedarí naštartovať. Preto výrazná aktivita centrálnych bánk po celom svete poslala výnosy štátnych a podnikových dlhopisov v priebehu roka na nové historické minimá, čo malo výrazný pozitívny dopad na ceny dlhopisov. V závere roka síce výnosy opäť mierne vzrástli, stále však ostali veľmi nízko a investori do dlhopisov tak na konci roka počítali zisky. Keďže poklesli aj rizikové prirážky pri dlhopisoch, vyššie zisky zaznamenali menej bezpečné štátne dlhopisy rozvíjajúcich sa krajín či na periférii eurozóny, alebo podnikové dlhopisy s ratingom v špekulatívnom pásme. K zmierneniu obáv z možnej recesie prispeli v úvode roka aj nádejne sa vyvíjajúce rokovania okolo obchodného sporu medzi USA a Čínou, ktoré nakoniec v decembri úspešne dospeli k uzavretiu prvej fázy obchodnej dohody. Záver roka tiež priniesol aj ďalší pozitívny impulz v podobe výrazného poklesu rizika neriadeného Brexitu po tom, čo parlamentné voľby v Británii vyhrali konzervatívci, ktorí s absolútnou väčšinou budú môcť uplatniť dohodu s EÚ a vyvieť tak krajinu z Únie na konci januára.

Situácia na svetových finančných trhoch v roku 2019 sa kladne odrazila na výkonnosti fondu Index Euro – indexového negarantovaného d. f. NN dôchodková správcovská spoločnosť, a.s. Pod výrazný rast hodnoty dôchodkovej jednotky, ktorý od začiatku roku dosiahol +28,46 %, sa podpísal predovšetkým výrazný rast akcií v eurozóne v dôsledku nových stimulov z dielne Európskej centrálnej banky (ECB) a odvrátenia bezprostrednej hrozby recesie v eurozóne.

Európske akcie vstúpili do roku 2020 blízko svojich historických maxím. Zatiaľ čo ceny akcií prudko vzrástli, odhady ziskov firiem minulý rok klesali. Vzhľadom k svojej ziskovosti tak akcie výrazne zdraželi. Pre ďalší rast akcií by preto investori potrebovali vidieť zlepšenie aj na strane firemných ziskov. Vyhliadky pre rast ziskov sú ale v tejto chvíli skromné. Napriek tomu s podporou centrálnych bánk by sa akcie mohli posunúť ešte vyššie.

Názov dôchodkového fondu

Index Euro - Indexový negarantovaný dôchodkový fond NN dôchodková správcovská spoločnosť, a.s.

Identifikačný kód

S1903120050

Stav ku dňu

31.12.2019

2. Grafické znázornenie vývoja hodnoty dôchodkovej jednotky

Vývoj hodnoty dôchodkovej jednotky

od 1.1.2019 do 31.12.2019



Hodnota DJ 31.12.2019

0,062422

Názov dôchodkového fondu

Index Euro - Indexový negarantovaný dôchodkový fond NN dôchodková správcovská spoločnosť, a.s.

Identifikačný kód

S1903120050

Stav ku dňu

31.12.2019

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 31.12.2019 je takto vypočítaná hodnota v riziku pre časový horizont 20 dní na úrovni 9,2% čistej hodnoty majetku v dôchodkovom fonde. Úroveň pákového efektu v dôchodkovom fonde je nulová.

Hlásenie o stave majetku v dôchodkovom fonde

Názov dôchodkového fondu

Index Euro - Indexový negarantovaný dôchodkový fond NN dôchodková správcovská spoločnosť, a.s.

Identifikačný kód

S1903120050

Stav ku dňu

31.12.2019

Členenie podľa trhov

Druh majetku	Členenie	č.r.	Hodnota		Podiel na majetku v dôchodkovom fonde v %
			v tis. eur		
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 zrejme, 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	0,00		0,0000
	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 priestoru, a ktorý je uvedený v zozname zverejnenom Európskou komisiou	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 zrejme, 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			0,0000
	Prijaté na obchodovanie na trhu kótovaných cenných papierov zahraničnej burzy cenných papierov so sídlom v členskom štáte	10	116466,00		98,3018
	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 zrejme, že sa toto prijatie uskutoční do jedného roka od dátumu vydania emisie cenných papierov	12			0,0000
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			0,0000
	Prijaté na obchodovanie na trhu kótovaných cenných papierov zahraničnej burzy cenných papierov so sídlom v členskom štáte	14			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	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 zrejme, 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			0,0000
	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
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			0,0000
	na bežnom účte u depozitára	24	1919,00		1,6197
	na vkladovom účte u depozitára	25	0,00		0,0000
	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	0,00		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	0,00		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			0,0000	
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		93,00		0,0785
Objem pohľadávok dôchodkového fondu celkom	33		0,00		0,0000
Hodnota majetku v dôchodkovom fonde	34		118478,00		100,0000
Objem záväzkov dôchodkového fondu celkom	35		597,00		0,5039
Čistá hodnota majetku v dôchodkovom fonde	36		117881,00		99,4961

Názov dôchodkového fondu

Index Euro - Indexový negarantovaný dôchodkový fond NN dôchodková správcovská spoločnosť, a.s.

Identifikačný kód

S1903120050

Stav ku dňu

31.12.2019

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	118478,00	100,00	0,00	0,00	0,00	0,00	116466,00	98,30	0,00	0,00	0,00	0,00	1919,00	1,62	0,00	0,00	93,00	0,08	0,00	0,00
1	db x-trackers - DJ EURO STOXX	65671,00	55,4289		0,0000		0,0000	65671,00	55,4289		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000
2	Invesco EURO STOXX 50 UCITS ET	4522,00	3,8167		0,0000		0,0000	4522,00	3,8167		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000
3	iShares II plc - iShares DJ Eu	46273,00	39,0562		0,0000		0,0000	46273,00	39,0562		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000
4	VSEOBECNA UVEROVA BANKA	1919,00	1,6197		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	1919,00	1,6197		0,0000	0,00	0,0000		0,0000
5	NN DSS, a.s.	93,00	0,0785		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000	93,00	0,0785		0,0000

Názov dôchodkového fondu

Index Euro - Indexový negarantovaný dôchodkový fond NN dôchodková správcovská spoločnosť, a.s.

Identifikačný kód

S1903120050

Stav ku dňu

31.12.2019

Čítenie podľa sektorového hľadiska

č. r.	Sektie 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	118478,00	100,00	0,00	0,00	0,00	0,00	116466,00	98,30	0,00	0,00	0,00	0,00	1919,00	1,62	0,00	0,00	93,00	0,08	0,00	0,00
1	6430	116466,00	98,3018	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	116466,00	98,3018	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,00	0,0000	0,0000	0,0000	0,00	0,0000	0,0000	0,0000
2	6499	1919,00	1,6197	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	1919,00	1,6197	0,0000	0,0000	0,00	0,0000	0,0000	0,0000
3	6530	93,00	0,0785	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,00	0,0000	0,0000	0,0000	93,00	0,0785	0,0000	0,0000

Názov dôchodkového fondu

Index Euro - Indexový negarantovaný dôchodkový fond NN dôchodková správcovská spoločnosť, a.s.

Identifikačný kód

S1903120050

Stav ku dňu

31.12.2019

Clenenie 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
0a	Clenské štáty	118478,00	100,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	116466,00	98,3018	0,00	0,0000	0,00	0,0000	1919,00	1,6197	0,00	0,0000	93,00	0,0785	0,00	0,0000
0b	Nečlenské štáty	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	0,0000	0,00	0,0000
0	CELKOM	118478,00	100,00	0,00	0,00	0,00	0,00	116466,00	98,30	0,00	0,00	0,00	0,00	1919,00	1,62	0,00	0,00	93,00	0,08	0,00	0,00
1	IE	50795,00	42,8729		0,0000		0,0000	50795,00	42,8729		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000
2	LU	65671,00	55,4289		0,0000		0,0000	65671,00	55,4289		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000
3	SK	2012,00	1,6982		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	1919,00	1,6197		0,0000	93,00	0,0785		0,0000

Názov dôchodkového fondu

Index Euro - Indexový negarantovaný dôchodkový fond NN dôchodková správcovská spoločnosť, a.s.

Identifikačný kód

S1903120050

Stav ku dňu

31.12.2019

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 podkladového 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
0a	CELKOM EUR		118478,00	100,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	116466,00	98,3018	0,00	0,0000	0,00	0,0000	1919,00	1,6197	0,00	0,00	0,0000	93,00	0,0785	0,00	0,0000
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
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
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
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
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
0g	CELKOM OSTATNE		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
1	EUR	M1	1919,00	1,6197	0	0,0000	0	0,0000	0,00	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	1919,00	1,6197	0		0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000
2	EUR	NA	116559,00	98,3803	0	0,0000	0	0,0000	116466,00	98,3018	0	0,0000	0	0,0000	0,00	0,0000	0		0,0000	93,00	0,0785	0,00	0,0000

Dof (SP) 17-02

Hlásenie o vývoji počtu sporiteľov

Názov dôchodkového fondu

Index Euro - Indexový negarantovaný dôchodkový fond NN dôchodková správcovská spoločnosť, a.s.

Identifikačný kód

S1903120050

Stav ku dňu

31.12.2019

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		úmrta
							prírastky	úbytky	prírastky	úbytky	
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12
25 569	19 546 458	74	13 368	12 201	22 701	2 868	5 265	2 610	1 462	811	13

Dof (PAS) 31-02

Výkaz pasív dôchodkového fondu

Názov dôchodkového fondu

Index Euro - Indexový negarantovaný dôchodkový fond NN dôchodková správcovská spoločnosť, a.s.

Identifikačný kód

S1903120050

Stav ku dňu

31.12.2019

Označenie	Položka	č. r.	Hodnota v tis. eur
a	b	c	1
1.	Záväzky	1	597
a)	záväzky voči bankám	2	0
b)	záväzky z ukončenia dôchodkového sporenia	3	342
c)	záväzky voči dôchodkovej správcovskej spoločnosti	4	242
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	13
2.	Vlastné imanie	9	117881
a)	dôchodkové jednotky na osobných dôchodkových účtoch sporiteľov	10	93495
b)	zisk alebo strata za účtovné obdobie	11	24386
3.	Pasíva spolu	12	118478

Výkaz výnosov a nákladov dôchodkového fondu

Názov dôchodkového fondu

Index Euro - Indexový negarantovaný dôchodkový fond NN dôchodková správcovská spoločnosť, a.s.

Identifikačný kód

S1903120050

Stav ku dňu

31.12.2019

Označenie a	Položka b	č. r. c	Hodnota v tis. eur 1
1.	Výnosy z úrokov a obdobné výnosy	1	0
a)	z peňažných prostriedkov na bežnom účte	2	0
b)	z peňažných prostriedkov na vkladovom účte	3	0
c)	z dlhopisov a obdobných dlhových cenných papierov	4	0
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	2887
4.	Výnosy z operácií s cennými papiermi a podielmi	8	15652
a)	z kapitálových cenných papierov a obdobných cenných papierov	9	0
b)	z dlhopisov a iných dlhových cenných papierov	10	0
c)	z nástrojov peňažného trhu	11	0
d)	z podielových listov a obdobných cenných papierov	12	15652
5.	Náklady na operácie s cennými papiermi a podielmi	13	-7074
a)	kapitálové cenné papiere a obdobné cenné papiere	14	0
b)	dlhopisy a iné dlhové cenné papiere	15	0
c)	nástroje peňažného trhu	16	0
d)	podielové listy a obdobné cenné papiere	17	-7074
6.	Zisk/strata z operácií s cennými papiermi a podielmi	18	22726
7.	Zisk/strata z operácií s devízami	19	0
8.	Zisk/strata z derivátov	20	0
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	25613
11.	Transakčné náklady	24	2
a)	náklady na transakcie s CP platené depozitárovi	25	1
b)	poplatky pri nákupe a predaji CP platené tretej strane	26	1
12.	Bankové a iné poplatky	27	36
a)	bankové odplaty a poplatky	28	36
b)	burzové odplaty a poplatky	29	0
II.	Čistý výnos z majetku vo fonde	30	25575
13.	Náklady na financovanie dôchodkového fondu	31	0
III.	Čistý zisk/strata zo správy majetku	32	25575
14.	Iné výnosy	33	0
15.	Náklady na odplaty	34	1189
a)	náklady na odplatu za správu DF	35	315
b)	náklady na odplatu za zhodnotenie majetku v DF	36	874
c)	náklady na iné odplaty	37	0
IV.	Zisk/strata dôchodkového fondu za účtovné obdobie	38	24386

Skrátená verzia ročnej správy o hospodárení s majetkom v dôchodkovom fonde

Názov dôchodkového fondu

Index Euro - Indexový negarantovaný dôchodkový fond NN dôchodková správcovská spoločnosť, a.s.

Stav ku dňu

31.12.2019

Výkaz aktív a pasív dôchodkového fondu

Označenie	Položka	č.r.	V tis. EUR 31.12.2019	V tis. EUR 31.12.2018	V tis. EUR 31.12.2017
I.	Investičný majetok	1	116 466	80 043	64 774
1.	Dlhopisy oceňované umorovanou hodnotou	2	-		
a)	bez kupónov	3	-		
b)	s kupónmi	4	-		
2.	Dlhopisy oceňované reálnou hodnotou	5	-	-	-
a)	bez kupónov	6	-		
b)	s kupónmi	7	-		
3.	Akcie a podiely v obchodných spoločnostiach	8	-	-	-
a)	obchodovateľné	9	-		
b)	neobchodovateľné	10	-		
c)	podieľy v obchodných spoločnostiach, ktoré nemajú formu cenného papiera	11	-		
d)	obstaranie neobchodovateľných akcií a podielov v obchodných spoločnostiach	12	-		
4.	Podielové listy	13	116 466	80 025	64 774
a)	otvorených podielových fondov	14	116 466	80 025	64 774
b)	ostatné	15	-		
5.	Krátkodobé pohľadávky	16	-	18	-
a)	krátkodobé vklady v bankách	17	-	18	
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.	Drahe kovy	25	-		
II.	Neinvestičný majetok	26	2 012	535	262
9.	Peňažné prostriedky a ekvivalenty peňažných prostriedkov	27	1 919	535	262
10.	Ostatný majetok	28	93		
Aktíva spolu			118 478	80 578	65 036

I.	Závazky	30	597	270	171
1.	Závazky voči bankám	31	-		
2.	Závazky z ukončenia dôchodkového sporenia	32	342	238	145
3.	Závazky voči dôchodkovej správcovskej spoločnosti	33	242	21	17
4.	Závazky z derivátových operácií	34	-		
5.	Závazky z repoobchodov	35	-		
6.	Závazky z vypožičania finančného majetku	36	-		
7.	Ostatné záväzky	37	13	11	9
II.	Vlastné imanie	38	117 881	80 308	64 865
1.	Dôchodkové jednotky na osobných dôchodkových účtoch sporiteľov, z toho	39	117 881	80 308	64 865
a)	zisk alebo strata za účtovné obdobie	40	24 386	(10 979)	4 728
Pasíva spolu			118 478	80 578	65 036

Výkaz výnosov a nákladov dôchodkového fondu

Označenie	Položka	č.r.	V tis. EUR 1.1.-31.12.2019	V tis. EUR 1.1.-31.12.2018	V tis. EUR 1.1.-31.12.2017
1.	Výnosy z úrokov	1.	-		
2.	Výnosy z podielových listov	2.	-		
3.	Výnosy z dividend a z iných podielov na zisku	3.	2 887	2 173	1 629
4.	Zisk / strata z operácií s cennými papiermi	4.	22 726	(12 819)	3 619
5.	Zisk/strata z operácií s devízami	5.	-		
6.	Zisk/strata z derivátov	6.	-		
7.	Zisk/strata z operácií s drahými kovmi	7.	-		
8.	Zisk/strata z operácií s iným majetkom	8.	-		
I.	Výnos z majetku	9.	25 613	(10 646)	5 248
9.	Transakčné náklady	10.	2	8	5
10.	Bankové a iné poplatky	11.	36	64	46
II.	Čistý výnos z majetku	12.	25 575	(10 718)	5 197
11.	Náklady na financovanie fondu	13.	-		
III.	Čistý zisk / strata zo správy majetku	14.	25 575	(10 718)	5 197
12.	Náklady na odplaty	15.	1 189	261	469
IV.	Zisk / strata dôchodkového fondu za účtovné obdobie	16.	24 386	(10 979)	4 728