

Ročná správa o hospodárení s majetkom v dôchodkovom fonde k 31.12.2015

**Index – Indexový negarantovaný dôchodkový fond
NN dôchodková správcovská spoločnosť, a.s.**

NN dôchodková správcovská spoločnosť, a.s.



Hlásenie o najvýznamnejších skutočnostiach dôchodkového fondu

Názov dôchodkového fondu

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

Identifikačný kód

1903120050

Stav ku dňu

31.12.2015

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

Výnos fondu bol v sledovanom období ovplyvnený vývojom cien európskych akcií zahrnutých v indexe Eurostoxx 50. Hneď v úvode roka zaznamenali akcie silný rast zásluhou naštartovania programu nákupu štátnych dlhopisov z dielne Európskej centrálnej banky (ECB). Obrat vo vývoji nastal v priebehu apríla, od kedy si akcie prešli turbulentným vývojom. Najprv na ne doľahli negatívne správy z Grécka. Po dohode s veriteľmi však grécka téma rýchlo ustúpila. Následne v auguste silné výpredaje spôsobila devalvácia čínskeho juanu a obavy zo spomaľovania rozvíjajúcich ekonomík. Na pomoc v októbri prišli centrálné banky s holubičou rétorikou, čo akciovým trhom opäť nalialo krv do žíl. Sklamanie z predstavených opatrení ECB v decembri investori „ocenili“ výpredajom akcií. Akcie ale nakoniec udržali na konci roka kladnú výkonnosť, čo prispelo aj ku kladnej výkonnosti fondu v roku 2015.

Svetová ekonomika zaznamenala v minulom roku spomalenie na rast o 3,1 % oproti 3,4%-nému rastu v roku 2014. Spomalenie bolo najviditeľnejšie v rozvíjajúcich sa krajinách, naopak eurozóna sa v tomto smere darilo, keď jej ekonomika v minulom roku zrýchliła z 0,9 % na 1,5 %. Oživenie v Európe bolo ovplyvnené najmä podporou zo strany ECB v rámci programu kvantitatívneho uvoľňovania, ako aj nízkou cenou ropy a oslabením eura. Pretrvávajúca vysoká miera nezamestnanosti v EMÚ, zadlženia verejného a súkromného sektora či obavy ohľadne možného odchodu Grécka z eurozóny, tlmiли investičnú aktivitu korporátneho sektora a oživenie tak bolo relatívne mierne.

Americká ekonomika v minulom roku rástla 2,4% tempom, čo je v zhode s rokom 2014. Najväčšiu zásluhu na tom mal americký spotrebiteľ, ktorému pomáhal silný trh práce, keď nezamestnanosť v USA klesla v minulom roku o 0,9 percentného bodu na 5,3 %. Nižšia investičná aktivita ako aj silný dolár naopak bránili rýchlejšiemu rastu ekonomiky.

Vývoj na dlhopisových trhoch bol v priebehu minulého roku ovplyvnený najmä politikou centrálnych bank, kde dochádzalo k prehlbovaniu rozdielov v jej smerovaní medzi USA a eurozónou. Americká centrálna banka (Fed) v decembri pristúpila k zvýšeniu úrokových sadzieb o 25 bodov do pásma 0,25-0,50 %, čo odôvodnila zotavením trhu práce a presvedčením, že inflácia sa vráti k 2% cieľu v strednodobom horizonte po odznení efektu silného dolára a nízkych cien ropy. Banka by mala menovú politiku uvoľňovať ďalej, ale zároveň sľubuje postupnosť celej akcie. Na druhej strane, ECB hneď v úvode roka uvoľnila menové kohútiky naštartovaním programu nákupu štátnych dlhopisov v objeme 60 miliárd EUR mesačne, ktorý mal trvať aspoň do septembra 2016, čo držalo úrokové sadzby a výnosy európskych dlhopisov na veľmi nízkych úrovniach. V závere roka banka tento program predĺžila aspoň do marca 2017 a ďalej znížila depozitnú sadzbu do záporu. Investori v snahe participovať na klesajúcich výnosoch a rastúcich cenách hľúne nakupovali od začiatku roka dlhopisy, čím ich ceny tlačili ešte vyššie a výnosy nadol. Výnos nemeckého 10-ročného štátneho dlhopisu klesol 20. apríla na nové historické minimum 0,07%. Po zverejnení pozitívnej inflácie v máji nastal obrat a investori začali dlhopisy vypredávať, v dôsledku čoho sa ich ceny prepadli a výnosy vyleteli nahor. Zároveň sa roziahli rizikové prirážky ostatných európskych štátnych dlhopisov oproti bundu. V druhej polovici roka sa z dôvodov spomínaných vyššie vrátili výnosy dlhopisov ku klesajúcemu trendu. Výnos nemeckého 10-ročného štátneho dlhopisu zakončil rok na úrovni 0,63 %.

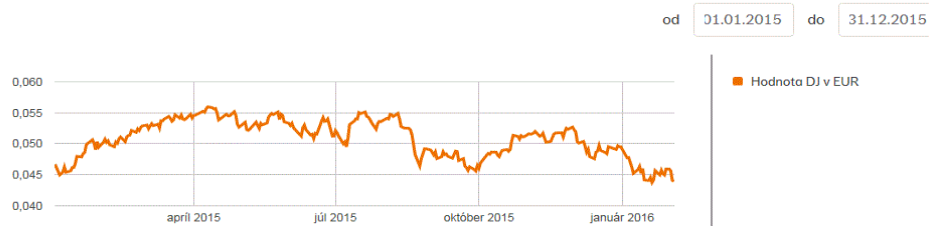
Situáciu na akciových trhoch taktiež výrazne ovplyvňovali rozhodnutia centrálnych bánk. Zahájenie kvantitatívneho uvoľňovania v eurozóna spolu s oslabujúcou menou pomohlo najmä európskym akciám v úvode roka. Taktovku nad trhmi ďalej prevzali správy z Grécka. Téma Grécka po dohode s veriteľmi rýchlo ustúpila. Na akcie však doľahli závažnejšie témy, ako spomaľovanie rastu na rozvíjajúcich sa trhoch, prudký prepád cien komodít a rastúce rizikové prirážky na trhoch podnikových dlhopisoch. V závere roka však tieto obavy ustúpili a aktivita centrálnych bánk poslala akcie na vyspelých trhoch opäť vyššie.

V prostredí pokračujúcej neistoty, nízkych cien komodít (ropy), nízkych inflačných očakávaní a aktivity centrálnych bánk očakávame v roku 2016 ďalší pokles výnosov na štátnych dlhopisoch (rast ich cien). Rizikové prirážky na dlhopisoch štátov periférie eurozóny sa síce v prípade zhoršenia makroekonomického prostredia môžu roziahnuť, aktivita ECB by však mala zabrániť výraznejšiemu zdražovaniu financovania týchto štátov. Ďalej na finančných trhoch očakávame pokračovanie zvýšenej volatility z minulého roka. Pribúdajúce riziká (menová politika v USA, spomalenie rastu v Číne a vo svete, ceny komodít) môžu negatívne vplyvať na tržný sentiment voči akciám, a preto očakávame nižšiu mieru zhodnotenia cien akciových investícií oproti minulému roku a zároveň nevyklúčujeme ich možný pokles v tomto roku.

b) Grafické znázornenie vývoja hodnoty dôchodkovej jednotky

Vývoj hodnoty dôchodkovej jednotky

Vývoj hodnoty majetku fondu



Meno a priezvisko osoby zodpovednej za výkaz:

Jana Gregorová

Telefónne číslo osoby zodpovednej za výkaz:

+421 2 59 313 838

Meno a priezvisko osoby, ktorá výkaz vypracovala:

Jana Gregorová

Telefónne číslo osoby, ktorá výkaz vypracovala:

+421 2 59 313 838

Hlásenie o stave majetku v dôchodkovom fonde

Názov dôchodkového fondu

Index - Indexový negarantovaný d.f. NN dôchodková správcovská spoločnosť, a.s.

Identifikačný kód

1903120050

Stav ku dňu

31.12.2015

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		
Dlhové cenné papiere	Prijaté na obchodovanie na trhu kótovaných cenných papierov burzy cenných papierov	5		
	Prijaté na obchodovanie na trhu kótovaných cenných papierov zahraničnej burzy cenných papierov so sídlom v členskom štáte	6		
	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		
	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)	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	36 639	99,5219
	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		
Cenné papiere iných zahraničných subjektov kolektívneho investovania podľa § 81 ods. 1 písm. d) zákona	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 vyda	12		
	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		
	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 členskými štátmi 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, EU, 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		
Bežné účty a vkladové účty podľa § 81 ods. 1 písm. f) zákona	Peňažné prostriedky na bežnom účte u depozitára	24		
	Peňažné prostriedky na vkladovom účte u depozitára	25		
	Peňažné prostriedky na bežných účtoch v bankách alebo pobočkách zahraničných bánk so sídlom v Slovenskej republike, v inom členskom štáte alebo nečlenskom štáte, ak táto banka alebo pobočka zahraničnej banky podlieha dohľadu	26	176	0,4781
	Peňažné prostriedky na vkladových účtoch v bankách alebo pobočkách zahraničných bánk so sídlom v Slovenskej republike, v inom členskom štáte alebo nečlenskom štáte, ak táto banka alebo pobočka zahraničnej banky podlieha dohľadu	27		
Obchody na obmedzenie devízového rizika podľa § 81 ods. 1 písm. g) zákona	28			
Cenné papiere, ktoré prestali byť obchodované 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 do 1 roka	30			
Iný majetok	31			
Objem pohľadávok dôchodkového fondu celkom	32			
Hodnota majetku v dôchodkovom fonde	33	36 815	100,0000	
Objem záväzkov dôchodkového fondu celkom	34	100	0,2716	
Čistá hodnota majetku v dôchodkovom fonde	35	36 715	99,7284	

Hlásenie o stave majetku v dôchodkovom fonde

Názov dôchodkového fondu

Index - Indexový negarantovaný d.f. NN dôchodková správcovská spoločnosť, a.s.

Identifikačný kód

1903120050

Stav ku dňu

31.12.2015

Členenie podľa emitentov

čís.r.	Emitenti/Banky	Spolu		Kapitálové CP a obdobné CP		Dlhové CP		PL OPF a CP ZSKI		CP IZSKI		NPT		BÚ a VÚ		Obchody na obmedzenie devízového 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
1	CELKOM	36 815	100,0000					36 639	99,5219					176	0,4781						
2	db x-trackers - DJ EURO STOXX	8 572	23,2840					8 572	23,2840												
3	iShares II plc - iShares DJ Eu	28 067	76,2380					28 067	76,2380												
4	VSEOBECNA UVEROVA BANKA	176	0,4781											176	0,4781						

Názov dôchodkového fondu

Index - Indexový negarantovaný d.f. NN dôchodková správcovská spoločnosť, a.s.

Identifikačný kód

1903120050

Stav ku dňu

31.12.2015

Členenie podľa sektorového hľadiska

č. r.	Sektie klasifikácie ekonomických činností	Spolu		Kapitálové CP a obdobné CP		Dlhové CP		PL OPF a CP ZSKI		CP IZSKI		NPT		BÚ a VÚ		Obchody na obmedzenie devízového 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	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
1	CELKOM	36 815,0000	100,0000					36 639,0000	99,5219					176,0000	0,4781						
2	649	36 815,0000	100,0000					36 639,0000	99,5219					176,0000	0,4781						

Hlásenie o stave majetku v dôchodkovom fonde

Názov dôchodkového fondu

Index - Indexový negarantovaný d.f. NN dôchodková správcovská spoločnosť, a.s.

Identifikačný kód

1903120050

Stav ku dňu

31.12.2015

Členenie podľa geografického hľadiska

č.r.	Štáty	Spolu		Kapitálové CP a obdobné CP		Dlhové CP		PL OPF a CP ZSKI		CP IZSKI		NPT		BÚ a VÚ		Obchody na obmedzenie devízového 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
1a	Členské štáty	36 815	100,0000					36 639	99,5219					176	0,4781						
1b	Nečlenské štáty																				
1	CELKOM	36 815	100,0000					36 639	99,5219					176	0,4781						
2	IE	28067	76,23795		0		0	28067	76,23795		0		0		0		0		0		0
3	LU	8572	23,28399		0		0	8572	23,28399		0		0		0		0		0		0
4	SK	176	0,47807		0		0		0		0		0	176	0,47807		0		0		0

Názov dôchodkového fondu
Index - Indexový negarantovaný d.f. NN dôchodková správcovská spoločnosť, a.s.Identifikačný kód
1903120050
Stav ku dňu
31.12.2015

Členenie podľa menového hľadiska

č.č.	Zostatková fixácia úrokových mier	Spolu		Kapitálové CP a obdobné CP		Dlhové CP		PL OPF a CP ZSKI		CP IZSKI		NPT		BÚ a VÚ		Obchody na obmedzenie depežného 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 %	redná hodnota v tis. eur	podkladového nástroja 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	21
1	Majetok denominovaný v EUR																					
2	na požiadanie a do 1 mesiaca vrátane	176	0,4781														176		0,4781			
3	od 1 do 3 mesiacov vrátane																					
4	od 3 do 6 mesiacov vrátane																					
5	od 6 mesiacov do 1 roka vrátane																					
6	od 1 do 3 rokov vrátane																					
7	od 3 do 5 rokov vrátane																					
8	od 5 do 10 rokov vrátane																					
9	od 10 do 15 rokov vrátane																					
10	nad 15 rokov																					
11	nedefinované	36 639	99,5219					36 639	99,5219													
12	CELKOM	36 815	100,0000					36 639	99,5219							176		0,4781				
13	Majetok denominovaný v USD																					
14	na požiadanie a do 1 mesiaca vrátane																					
15	od 1 do 3 mesiacov vrátane																					
16	od 3 do 6 mesiacov vrátane																					
17	od 6 mesiacov do 1 roka vrátane																					
18	od 1 do 3 rokov vrátane																					
19	od 3 do 5 rokov vrátane																					
20	od 5 do 10 rokov vrátane																					
21	od 10 do 15 rokov vrátane																					
22	nad 15 rokov																					
23	nedefinované																					
24	CELKOM																					
25	Majetok denominovaný v CZK																					
26	na požiadanie a do 1 mesiaca vrátane																					
27	od 1 do 3 mesiacov vrátane																					
28	od 3 do 6 mesiacov vrátane																					
29	od 6 mesiacov do 1 roka vrátane																					
30	od 1 do 3 rokov vrátane																					
31	od 3 do 5 rokov vrátane																					
32	od 5 do 10 rokov vrátane																					
33	od 10 do 15 rokov vrátane																					
34	nad 15 rokov																					
35	nedefinované																					
36	CELKOM																					
37	Majetok denominovaný v HUF																					
38	na požiadanie a do 1 mesiaca vrátane																					
39	od 1 do 3 mesiacov vrátane																					
40	od 3 do 6 mesiacov vrátane																					
41	od 6 mesiacov do 1 roka vrátane																					
42	od 1 do 3 rokov vrátane																					
43	od 3 do 5 rokov vrátane																					
44	od 5 do 10 rokov vrátane																					
45	od 10 do 15 rokov vrátane																					
46	nad 15 rokov																					
47	nedefinované																					
48	CELKOM																					
49	Majetok denominovaný v PLN																					
50	na požiadanie a do 1 mesiaca vrátane																					
51	od 1 do 3 mesiacov vrátane																					
52	od 3 do 6 mesiacov vrátane																					
53	od 6 mesiacov do 1 roka vrátane																					
54	od 1 do 3 rokov vrátane																					
55	od 3 do 5 rokov vrátane																					
56	od 5 do 10 rokov vrátane																					
57	od 10 do 15 rokov vrátane																					
58	nad 15 rokov																					
59	nedefinované																					
60	CELKOM																					
61	Majetok denominovaný v JPY																					
62	na požiadanie a do 1 mesiaca vrátane																					
63	od 1 do 3 mesiacov vrátane																					
64	od 3 do 6 mesiacov vrátane																					
65	od 6 mesiacov do 1 roka vrátane																					
66	od 1 do 3 rokov vrátane																					
67	od 3 do 5 rokov vrátane																					
68	od 5 do 10 rokov vrátane																					
69	od 10 do 15 rokov vrátane																					
70	nad 15 rokov																					
71	nedefinované																					
72	CELKOM																					
73	Majetok denominovaný v ostatných cudzích menách																					
74	na požiadanie a do 1 mesiaca vrátane																					
75	od 1 do 3 mesiacov vrátane																					
76	od 3 do 6 mesiacov vrátane																					
77	od 6 mesiacov do 1 roka vrátane																					
78	od 1 do 3 rokov vrátane																					
79	od 3 do 5 rokov vrátane																					
80	od 5 do 10 rokov vrátane																					
81	od 10 do 15 rokov vrátane																					
82	nad 15 rokov																					
83	nedefinované																					
84	CELKOM																					

Meno a priezvisko osoby zodpovednej za výkaz:
Jana Gregorova
Telefónne číslo osoby zodpovednej za výkaz:
Jana Gregorova
Meno a priezvisko osoby, ktorá výkaz vypracovala:
+421 2 59 313 838
Telefónne číslo osoby, ktorá výkaz vypracovala:
+421 2 59 313 838

Dof (SP) 17-02

Strana 1/1

Hlásenie o vývoji počtu sporiteľov

Názov dôchodkového fondu

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

Identifikačný kód

2203060008

Stav ku dňu

31.12.2015

Počet sporiteľov spolu	Objem príspevkov v eurách spolu	Objem penále v eurách spolu	Počet sporiteľov podľa pohlavia		Počet sporiteľov podľa spôsobu		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
8 254	10 828 776	72	4 595	3 659	7 125	1 129	2 606	1 063	2 194	174	3

Meno a priezvisko osoby zodpovednej za výkaz:

Jana Krajčovičová

Telefónne číslo osoby zodpovednej za výkaz:

02/59 313 641

Meno a priezvisko osoby, ktorá výkaz vypracovala:

Jana Krajčovičová

Telefónne číslo osoby, ktorá výkaz vypracovala:

02/59 313 641

Dof (PAS) 31-02

Strana 1/1

Výkaz pasív dôchodkového fondu

Názov dôchodkového fondu

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

Identifikačný kód

1903120050

Stav ku dňu

31.12.2015

Ozna- čenie	Položka	č. r.	Hodnota v tis. eur
a	b	c	1
1.	Záväzky	1	100
a)	záväzky voči bankám	2	
b)	záväzky z ukončenia dôchodkového sporenia	3	86
c)	záväzky voči dôchodkovej správcovskej spoločnosti	4	9
d)	záväzky z derivátových operácií	5	
e)	ostatné záväzky	6	5
2.	Vlastné imanie	7	36 715
a)	dôchodkové jednotky na osobných dôchodkových účtoch sporiteľov	8	36 715
b)	dôchodkové jednotky na garančnom účte	9	0
3.	Pasíva v dôchodkovom fonde celkom	10	36 815

Meno a priezvisko osoby zodpovednej za výkaz:

Alžbeta Danovičová

Telefónne číslo osoby zodpovednej za výkaz:

+421 2 59 313 841

Meno a priezvisko osoby, ktorá výkaz vypracovala:

Alžbeta Danovičová

Telefónne číslo osoby, ktorá výkaz vypracovala:

+421 2 59 313 841

Dof (VVN) 32-02

Strana 1/1

Výkaz výnosov a nákladov dôchodkového fondu

Názov dôchodkového fondu

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

Identifikačný kód

1903120050

Stav ku dňu

31.12.2015

Označenie	Položka	č. r.	Hodnota v tis. eur
a	b	c	1
1.	Výnosy z úrokov a obdobné výnosy	1	1
a)	z peňažných prostriedkov na bežnom účte	2	1
b)	z peňažných prostriedkov na vkladovom účte	3	
c)	z dlhopisov a obdobných dlhových cenných papierov	4	
d)	z nástrojov peňažného trhu	5	
2.	Výnosy z kapitálových cenných papierov a obdobné výnosy	6	800
3.	Výnosy z podielových listov a obdobné výnosy	7	
4.	Výnosy z operácií s cennými papiermi	8	181
a)	z kapitálových cenných papierov a obdobných cenných papierov	9	
b)	z dlhopisov a iných dlhových cenných papierov	10	
c)	z nástrojov peňažného trhu	11	
d)	z podielových listov a obdobných cenných papierov	12	181
5.	Náklady na operácie s cennými papiermi	13	193
a)	kapitálové cenné papiere a obdobné cenné papiere	14	
b)	dlhopisy a iné dlhové cenné papiere	15	
c)	nástroje peňažného trhu	16	
d)	podielové listy a obdobné cenné papiere	17	193
6.	Zisk/strata z operácií s cennými papiermi	18	-12
7.	Zisk/strata z obchodov určených na obmedzenie devízového rizika	19	0
a)	swapy	20	
b)	forwardy	21	
c)	opcie	22	
8.	Zisk/strata z devízových operácií	23	
9.	Zisk/strata z predaja iného majetku	24	
10.	Iné výnosy	25	0
a)	výnosy z rozpustenia prostriedkov na garančnom účte	26	
b)	výnosy z majetku doplneného zo zdrojov dôchodkovej správcovskej spoločnosti	27	
c)	ostatné výnosy	28	
11.	Iné náklady	29	485
12.	Náklady na dane vzťahujúce sa na majetok v dôchodkovom fonde	30	
13.	Zisk/strata za účtovné obdobie	31	304

Meno a priezvisko osoby zodpovednej za výkaz:

Alžbeta Danovičová

Telefónne číslo osoby zodpovednej za výkaz:

+421 2 59 313 841

Meno a priezvisko osoby, ktorá výkaz vypracovala:

Alžbeta Danovičová

Telefónne číslo osoby, ktorá výkaz vypracovala:

+421 2 59 313 841

Skrátená verzia ročnej správy o hospodárení s majetkom v dôchodkovom fonde

Názov dôchodkového fondu

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

Stav ku dňu

31.12.2015

Výkaz aktív a pasív dôchodkového fondu

Označenie	Položka	č. r.	Hodnota v tis. eur k 31.12.2015	Hodnota v tis. eur k 31.12.2014	Hodnota v tis. eur k 31.12.2013
a	b	c	1	2	3
I.	Investičný majetok	1	36 639	19 017	7 561
1.	Dlhopisy	2			
a)	bez kupónov	3			
b)	s kupónmi	4			
2.	Akcie	5			
3.	Podielové listy	6	36 639	19 017	7 561
a)	otvorených podielových fondov	7	36 639	19 017	7 561
b)	ostatné	8			
4.	Krátkodobé pohľadávky	9			
5.	Dlhodobé pohľadávky	10			
6.	Deriváty	11			
II.	Neinvestičný majetok	12	177	92	54
7.	Peňažné prostriedky a ekvivalenty peňažných prostriedkov	13	177	92	54
8.	Ostatný majetok	14			
	Aktíva v dôchodkovom fonde spolu	15	36 816	19 109	7 615
I.	Závazky	16	100	9	9
1.	Závazky voči bankám	17			
2.	Závazky z ukončenia dôchodkového sporenia	18	86	1	
3.	Závazky voči dôchodkovej správcovskej spoločnosti	19	9	5	8
4.	Závazky z derivátových operácií	20			1
5.	Ostatné záväzky	21	5	3	
II.	Vlastné imanie	22	36 715	19 100	7 606
1.	Dôchodkové jednotky na osobných dôchodkových účtoch sporiteľov	23	36 715	19 100	7 606
2.	Dôchodkové jednotky na garančnom účte	24			
	Pasíva v dôchodkovom fonde spolu	25	36 815	19 109	7 615

Výkaz výnosov a nákladov dôchodkového fondu

Označenie	Položka	č. r.	Hodnota v tis. eur k 31.12.2015	Hodnota v tis. eur k 31.12.2014	Hodnota v tis. eur k 31.12.2013
a	b	c	1	2	3
1.	Výnosy z úrokov	1	1	1	1
2.	Výnosy z podielových listov	2			
3.	Výnosy z dividend	3	800	396	137
4.a	Čistý zisk/(strata) z operácií s cennými papiermi	4	31		28
5.b	Čistý zisk/(strata) z devízových operácií	5			
6.c	Čistý zisk/(strata) z derivátových operácií	6			
7.d	Čistý zisk/(strata) z operácií s iným majetkom	7			
8.e	Čistý zisk/(strata) z precenenia cenných papierov	8	-43	187	897
II.	Čistý výnos z majetku vo fonde	9	789	584	1 063
f	Náklady na financovanie fondu	10	485	164	109
III.	Čistý zisk (strata) zo správy majetku vo fonde	11	304	420	954
g.	Dane	12			
IV.	Zisk/(strata) dôchodkového fondu	13	304	420	954