

Ročná správa o hospodárení s majetkom v dôchodkovom fonde k 31.12.2016

**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 d.s.s., a.s.

Identifikačný kód

S1903120050

Stav ku dňu

31.12.2016

1. 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. Európske akcie si v minulom roku prešli turbulentným vývojom, ale v konečnom dôsledku si pripísali mierne zisky. V porovnaní s americkými akciami či akciami trhov rozvíjajúcich sa ekonomík si však celkovo viedli horšie. Pod slabšiu výkonnosť sa podpísala predovšetkým politická neistota v regióne. Indexový fond v minulom roku zaznamenal zhodnotenie dôchodkovej jednotky o 2,56 %.

O svižný a nepríjemný štart do nového roku, a to hlavne pre rizikové aktíva, sa postarali obavy z možnej recesie v Spojených štátoch, spomaľovanie hospodárskeho rastu v Číne a prepad cien ropy. Výraznou korekciou si prešli všetky hlavné svetové akciové indexy. K zlepšeniu sentimentu na finančných trhoch došlo až v priebehu februára, k čomu najviac prispel obrat na cenách komodít (hlavne ropy) a návrat dôvery v oživenie americkej ekonomiky, respektíve výrazný pokles pravdepodobnosti recesie v USA. Lepšie dáta začali postupne prichádzať aj z Európy či rozvíjajúcich sa krajín, čo trhom postačilo k ich stabilizácii.

Ďalším impulzom pre finančné trhy bolo marcové zasadnutie Rady guvernérov Európskej centrálnej banky (ECB). Na ňom menová autorita rozhodla o navýšení programu kvantitatívneho uvoľňovania o 20 mld. EUR na 80 mld. EUR mesačne. Po odznení prvotnej volatility sa akcie vydali severným smerom v súlade s očakávanou reakciou na menovú expanziu.

Nervozita na finančných trhoch začala opäť narastať pred júnovým referendom u vystúpení Británie z EÚ, z čoho znovu ťažili štátne dlhopisy. Britskí voliči nakoniec šokovali trhy, keď sa rozhodli pre odchod z Únie. Reakciou boli panické výpredaje rizikových aktív. Naopak, štátne dlhopisy sa po referende stali ešte žiadanejším „tovarom“ na finančných trhoch. Všeobecné výpredaje rizika pokračovali ešte prvé dni po referende, potom sa však situácia zmenila. Dlhopisom zisky zostali, akcie dokázali straty vymazať a začali rásť. Takýto vývoj súvisel s nádejami na podporu zo strany centrálnych bánk a investorí tak paradoxne „Brexit“ vnímali ako dobrú správu pre akcie i dlhopisy vďaka výhľadu nižších sadzieb a uvoľnených menových politik centrálnych bánk.

Druhý polrok so sebou priniesol zlepšenie makroekonomických dát, nárast inflačných očakávaní a v neposlednom rade víťazstvo republikánskeho kandidáta Donalda Trumpa v amerických prezidentských voľbách. Tieto faktory hrali v prospech akcií, ktorých ceny začali rásť. Najviac sa darilo cyklickým akciám, ktoré ťažili z rastúcich inflačných očakávaní. Práve voľby v USA najviac pútali pozornosť finančných trhov v závere roka. Prvotný šok z víťazstva Trumpa v amerických prezidentských voľbách sa odvíjal podľa predpokladaného scenára výpredaja rizikových aktív, ale obrat nastal veľmi rýchlo. Väčšina trhov nabrala opačný smer a rizikové aktíva si tak namiesto strát začali pripisovať ďalšie zisky.

Pre vývoj na finančných trhoch v roku 2017 bude kľúčové, či sa potvrdia zlepšené vyhliadky pre globálnu ekonomiku sprevádzané oživením inflácie. Do značnej miery to bude ovplyvnené krokmi nastupujúcej Trumpovej administratívy v Spojených štátoch a politickým vývojom v Európe. Od toho sa budú odvíjať aj ďalšie kroky globálnych centrálnych bánk. V základnom scenári očakávame, že sa bude akciám dariť aj v roku 2017. Predpokladom je ďalšie zlepšenie globálneho makroekonomického prostredia a rast inflácie. Najväčšie riziká v tomto roku vidíme v politickej neistote, ktorá môže výrazne ovplyvňovať sentiment na finančných trhoch, a tým aj ocenenie finančných aktív.

Názov dôchodkového fondu

Index - Indexový negarantovaný dôchodkový fond NN d.s.s., a.s.

Identifikačný kód

S1903120050

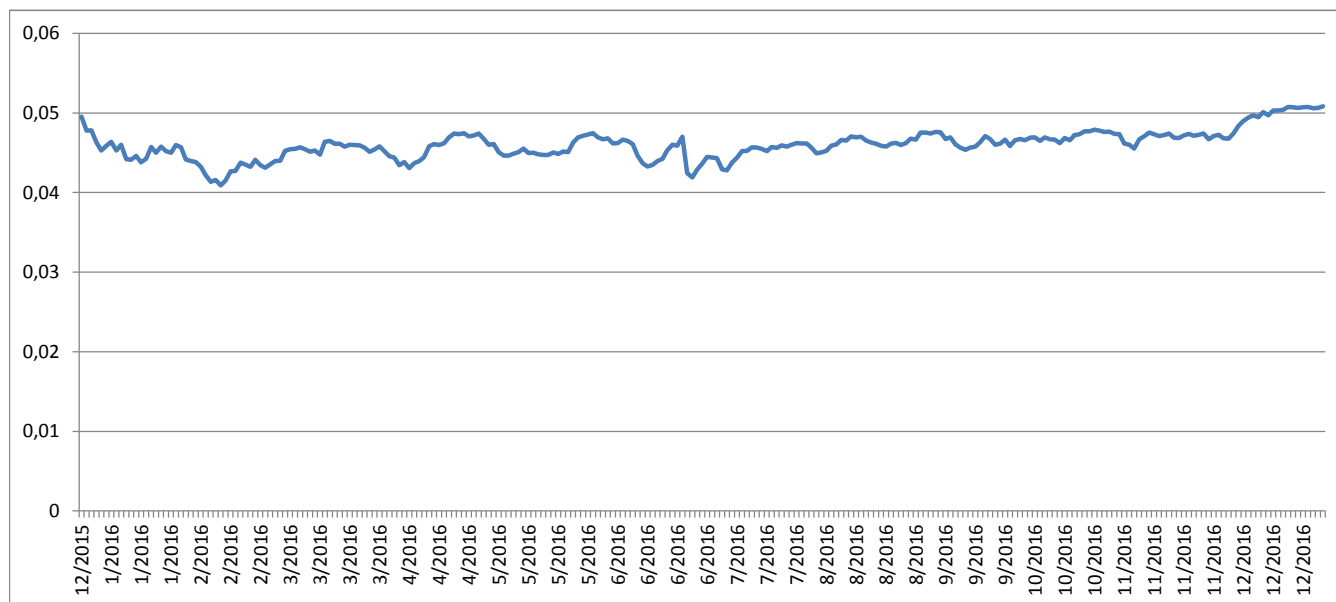
Stav ku dňu

31.12.2016

2. Grafické znázornenie vývoja hodnoty dôchodkovej jednotky

Vývoj hodnoty dôchodkovej jednotky

od 1.1.2016 do 31.12.2016



Hodnota DJ 31.12.2016

0,050811

Názov dôchodkového fondu

Index - Indexový negarantovaný dôchodkový fond NN d.s.s., a.s.

Identifikačný kód

S1903120050

Stav ku dňu

31.12.2016

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

Trhové riziko majetku dôchodkového fondu je merané prístupom hodnoty v riziku. Metóda použitá na výpočet je absolútna hodnota v riziku počítaná na 250 dňovom rade pozorovaní, na ktorom je na základe predpokladu normálneho rozdelenia zmien dôchodkovej jednotky vypočítaná hodnota v riziku na 99% intervale spoľahlivosti pre časový horizont 1 dňa. 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. Majetok dôchodkového fondu neobsahuje deriváty drahého kovu alebo deriváty indexu drahých kovov. Celkové riziko derivátov drahého kovu alebo derivátov indexu drahých kovov nie je vypočítavané.

Hlásenie o stave majetku v dôchodkovom fonde

Názov dôchodkového fondu

Index - Indexový negarantovaný dôchodkový fond NN d.s.s., a.s.

Identifikačný kód

SI1903120050

Stav ku dňu

31.12.2016

Členenie podľa trhov

Druh majetku	Členenie	č.r.	Hodnota v tis. eur	Podiel na majetku v dôchodkovom fonde v %
a	b	c	1	2
Kapitálové cenné papiere a obdobné cenné papiere	Prijaté na obchodovanie na trhu kótovaných cenných papierov burzy cenných papierov	1		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		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 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		0,0000
	Prijaté na obchodovanie na trhu kótovaných cenných papierov zahraničnej burzy cenných papierov so sídlom v členskom štáte	10	48690,00	98,8509
	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
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 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		0,0000
	Vydané alebo zaručené členskými štátmi 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
	na bežnom účete u depozitára	24		0,0000
na vkladovom účete u depozitára	25		0,0000	
Peňažné prostriedky na bežných účtoch a vkladových účtoch podľa § 81 ods. 1 písm. f) zákona	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	566,00	1,1491
	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		0,0000
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		0,0000
Objem pohľadávok dôchodkového fondu celkom		33		0,0000
Hodnota majetku v dôchodkovom fonde		34	49256,00	100,0000
Objem záväzkov dôchodkového fondu celkom		35	212,00	0,4304
Čistá hodnota majetku v dôchodkovom fonde		36	49044,00	99,5696

Dof (HMF) 03-02

Názov dôchodkového fondu

Index - Indexový negarantovaný dôchodkový fond NN d.s.s., a.s.

Identifikačný kód

SI1903120050

Stav ku dňu

31.12.2016

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	49256,00	100,00	0,00	0,00	0,00	0,00	48690,00	98,85	0,00	0,00	0,00	0,00	566,00	1,15	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
1	db x-trackers - DJ EURO STOXX	20749,00	42,1248		0,0000		0,0000	20749,00	42,1248		0,0000		0,0000		0,0000		0,0000		0,0000		0,0000
2	iShares II plc - iShares DJ Eu	27941,00	56,7261		0,0000		0,0000	27941,00	56,7261		0,0000		0,0000		0,0000		0,0000		0,0000		0,0000
3	VSEOBECNA UVEROVA BANKA	566,00	1,1491		0,0000		0,0000		0,0000		0,0000		0,0000	566,00	1,1491		0,0000		0,0000		0,0000

Názov dôchodkového fondu

Index - Indexový negarantovaný dôchodkový fond NN d.s.s., a.s.

Identifikačný kód

SI903120050

Stav ku dňu

31.12.2016

Členenie 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	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	49256,00	100,00	0,00	0,00	0,00	0,00	48690,00	98,85	0,00	0,00	0,00	0,00	566,00	1,15	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
1	6430	48690,00	98,8509		0,0000		0,0000	48690,00	98,8509		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000		0,0000
2	6499	566,00	1,1491		0,0000		0,0000		0,0000		0,0000		0,0000	566,00	1,1491		0,0000		0,0000		0,0000

Dof (HMF) 03-02

Názov dôchodkového fondu

Index - Indexový negarantovaný dôchodkový fond NN d.s.s., a.s.

Identifikačný kód

S1903120050

Stav ku dňu

31.12.2016

Členenie podľa geografického hľadiska

č.r.	Štáty	Spolu		Kapitálové CP a obdobné CP		Dlhopisy a iné dlhové CP		PL OPF a CP ZSKI		CP IZSKI		NPT		Peňažné prostriedky na BÚ a VÚ		Pohľadávky a záväzky vznikajúce pri obchodoch určených výlučne na obmedzenie úrokového rizika, menového rizika alebo iného rizika		Iný majetok		Pohľadávky dôchodkového fondu	
		objem v tis. eur	podiel v %	objem v tis. eur	podiel v %	objem v tis. eur	podiel v %	objem v tis. eur	podiel v %	objem v tis. eur	podiel v %	objem v tis. eur	podiel v %	objem v tis. eur	podiel v %	reálna hodnota v tis. eur	podiel v %	objem v tis. eur	podiel v %	objem v tis. eur	podiel v %
a	b	1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13	14	15	16	17	18	19	20
0a	Členské štáty	49256,00	100,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	48690,00	98,8509	0,00	0,0000	0,00	0,0000	566,00	1,1491	0,00	0,0000	0,00	0,0000	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	49256,00	100,00	0,00	0,00	0,00	0,00	48690,00	98,85	0,00	0,00	0,00	0,00	566,00	1,15	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
1	IE	27941,00	56,7261		0,0000		0,0000	27941,00	56,7261		0,0000		0,0000		0,0000		0,0000		0,0000		0,0000
2	LU	20749,00	42,1248		0,0000		0,0000	20749,00	42,1248		0,0000		0,0000		0,0000		0,0000		0,0000		0,0000
3	SK	566,00	1,1491		0,0000		0,0000		0,0000		0,0000		0,0000	566,00	1,1491		0,0000		0,0000		0,0000

Názov dôchodkového fondu

Index - Indexový negarantovaný dôchodkový fond NN d.s.s., a.s.

Identifikačný kód

S1903120050

Stav ku dňu

31.12.2016

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 obmedzení 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 %	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		49256,00	100,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	48690,00	98,8509	0,00	0,0000	0,00	0,0000	566,00	1,1491	0,00	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	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	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 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	0,00	0,0000
1	EUR	M1	566,00	1,1491		0,0000		0,0000		0,0000		0,0000		0,0000	566,00	1,1491				0,0000		0,0000		0,0000	0,0000
2	EUR	O1M3M	0,00	0,0000		0,0000		0,0000		0,0000		0,0000		0,0000		0,0000				0,0000		0,0000		0,0000	0,0000
3	EUR	O3M6M	0,00	0,0000		0,0000		0,0000		0,0000		0,0000		0,0000		0,0000				0,0000		0,0000		0,0000	0,0000
4	EUR	6M1R	0,00	0,0000		0,0000		0,0000		0,0000		0,0000		0,0000		0,0000				0,0000		0,0000		0,0000	0,0000
5	EUR	R1PR3	0,00	0,0000		0,0000		0,0000		0,0000		0,0000		0,0000		0,0000				0,0000		0,0000		0,0000	0,0000
6	EUR	R3PR5	0,00	0,0000		0,0000		0,0000		0,0000		0,0000		0,0000		0,0000				0,0000		0,0000		0,0000	0,0000
7	EUR	R5PR10	0,00	0,0000		0,0000		0,0000		0,0000		0,0000		0,0000		0,0000				0,0000		0,0000		0,0000	0,0000
8	EUR	R10PR15	0,00	0,0000		0,0000		0,0000		0,0000		0,0000		0,0000		0,0000				0,0000		0,0000		0,0000	0,0000
9	EUR	R15P	0,00	0,0000		0,0000		0,0000		0,0000		0,0000		0,0000		0,0000				0,0000		0,0000		0,0000	0,0000
10	EUR	NA	48690,00	98,8509		0,0000		0,0000	48690,00	98,8509		0,0000		0,0000		0,0000				0,0000		0,0000		0,0000	0,0000

Hlásenie o vývoji počtu sporiteľov

Názov dôchodkového fondu

Index - Indexový negarantovaný dôchodkový fond NN d.s.s., a.s.

Identifikačný kód

S1903120050

Stav ku dňu

31.12.2016

Počet sporiteľov spolu	Objem príspevkov v eurách spolu	Objem penále v eurách spolu	Počet sporiteľov podľa pohlavia		Počet sporiteľov podľa spôsobu prispievania		Zmena stavov sporiteľov				
			muži	ženy	aktívny	pasívny	medzi DF rámci DSS		z DSS do inej DSS		úmrčia
							prírastky	úbytky	prírastky	úbytky	
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12
10202	8099803	59	5608	4594	8988	1214	1516	933	985	315	6

Dof (PAS) 31-02

Výkaz pasív dôchodkového fondu

Názov dôchodkového fondu

Index - Indexový negarantovaný dôchodkový fond NN d.s.s., a.s.

Identifikačný kód

S1903120050

Stav ku dňu

31.12.2016

Označenie a	Položka b	č. r. c	Hodnota v tis. eur 1
1.	Závazky	1	212
a)	záväzky voči bankám	2	
b)	záväzky z ukončenia dôchodkového sporenia	3	194
c)	záväzky voči dôchodkovej správcovskej spoločnosti	4	12
d)	záväzky z derivátových operácií	5	
e)	záväzky voči bankám z repoobchodov	6	
f)	záväzky z vypožičania finančného majetku	7	
	ostatné záväzky	8	6
2.	Vlastné imanie	9	49044
a)	dôchodkové jednotky na osobných dôchodkových účtoch sporiťel'ov	10	46810
b)	zisk alebo strata za účtovné obdobie	11	2234
3.	Pasíva spolu	12	49256

Výkaz výnosov a nákladov dôchodkového fondu

Názov dôchodkového fondu

Index - Indexový negarantovaný dôchodkový fond NN d.s.s., a.s.

Identifikačný kód

S1903120050

Stav ku dňu

31.12.2016

Označenie	Položka	č. r.	Hodnota v tis. eur
a	b	c	1
1.	Výnosy z úrokov a obdobné výnosy	1	0
a)	z peňažných prostriedkov na bežnom účte	2	
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 podielových listov a obdobné výnosy	6	1263
3.	Výnosy z dividend a iných podielov na zisku	7	
4.	Výnosy z operácií s cennými papiermi a podielmi	8	1141
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	1141
5.	Náklady na operácie s cennými papiermi a podielmi	13	0
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	
6.	Zisk/strata z operácií s cennými papiermi a podielmi	18	1141
7.	Zisk/strata z operácií s devízami	19	
8.	Zisk/strata z derivátov	20	
9.	Zisk/strata z operácií s drahými kovmi	21	
10.	Zisk/strata z operácií s iným majetkom	22	
I.	Výnos z majetku	23	2404
11.	Transakčné náklady	24	3
a)	náklady na transakcie s CP platené depozitárovi	25	
b)	poplatky pri nákupe a predaji CP platené tretej strane	26	3
12.	Bankové a iné poplatky	27	33
a)	bankové odplaty a poplatky	28	
b)	burzové odplaty a poplatky	29	33
II.	Čistý výnos z majetku vo fonde	30	2368
13.	Náklady na financovanie dôchodkového fondu	31	
III.	Čistý zisk/strata zo správy majetku	32	2368
14.	Iné výnosy	33	
15.	Náklady na odplaty	34	134
a)	náklady na odplatu za správu DF	35	122
b)	náklady na odplatu za zhodnotenie majetku v DF	36	0
c)	náklady na iné odplaty	37	12
IV.	Zisk/strata dôchodkového fondu za účtovné obdobie	38	2234

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

Názov dôchodkového fondu

Stav ku dňu

Index - Indexový negarantovaný dôchodkový fond NN d.s.s., a.s.

31.12.2016

Výkaz aktív a pasív dôchodkového fondu

Označenie	Položka	č. r.	Hodnota v tis. eur k 31.12.2016	Hodnota v tis. eur k 31.12.2015	Hodnota v tis. eur k 31.12.2014
I.	Investičný majetok	1	48 690	36 639	19 017
1.	Dlhopisy oceňované umorovanou hodnotou	2	0	0	0
a)	bez kupónov	3	0	0	0
b)	s kupónmi	4	0	0	0
2.	Dlhopisy oceňované reálnou hodnotou	5	0	0	0
a)	bez kupónov	6	0	0	0
b)	s kupónmi	7	0	0	0
3.	Akcie a podiely v obchodných spoločnostiach	8	0	0	0
a)	obchodovateľné	9	0	0	0
b)	neobchodovateľné	10	0	0	0
c)	podiely v obchodných spoločnostiach, ktoré nemajú formu ceného papiera	11	0	0	0
d)	obstaranie neobchodovateľných akcií a podielov v obchodných spoločnostiach	12	0	0	0
4.	Podielové listy	13	48 690	36 639	19 017
a)	otvorených podielových fondov	14	48 690	36 639	19 017
b)	ostatné	15	0	0	0
5.	Krátkodobé pohľadávky	16	0	0	0
a)	krátkodobé vklady v bankách	17	0	0	0
b)	krátkodobé pôžičky obchodným spoločnostiam, v ktorých má dôchodkový fond majetkový podiel	18	0	0	0
c)	iné	19	0	0	0
d)	obrátené repoobchody	20	0	0	0
6.	Dlhodobé pohľadávky	21	0	0	0
a)	dlhodobé vklady v bankách	22	0	0	0
b)	dlhodobé pôžičky obchodným spoločnostiam, v ktorých má dôchodkový fond majetkový podiel	23	0	0	0
7.	Deriváty	24	0	0	0
8.	Drahé kovy	25	0	0	0
II.	Neinvestičný majetok	26	565	176	92
9.	Peňažné prostriedky a ekvivalenty peňažných prostriedkov	27	565	176	92
10.	Ostatný majetok	28	0	0	0
	Aktíva spolu	29	49 255	36 815	19 109
I.	Závazky	30	211	100	9
1.	Závazky voči bankám	31	0	0	0
2.	Závazky z ukončenia dôchodkového sporenia	32	193	86	1
3.	Závazky voči dôchodkovej správcovskej spoločnosti	33	12	9	5
4.	Závazky z derivátových operácií	34	0	0	0
5.	Závazky z repoobchodov	35	0	0	0
6.	Závazky z vypožičania finančného majetku	36	0	0	0
7.	Ostatné záväzky	37	6	5	3
II.	Vlastné imanie	38	49 044	36 715	19 100
1.	Dôchodkové jednotky na osobných dôchodkových účtoch sporiťel'ov, z toho	39	49 044	36 715	19 100
a)	zisk / strata za účtovné obdobie	40	0	0	0
	Pasíva spolu	41	49 255	36 815	19 109

Výkaz výnosov a nákladov dôchodkového fondu

Označenie	Položka	č. r.	Hodnota v tis. eur k 31.12.2016	Hodnota v tis. eur k 31.12.2015	Hodnota v tis. eur k 31.12.2014
1.	Výnosy z úrokov	1	0	1	1
2.	Výnosy z podielových listov	2	0	0	0
3.	Výnosy z dividend a z iných podielov na zisku	3	1 263	800	396
4.	Zisk / strata z operácií s cennými papiermi	4	1 141	-12	187
5.	Zisk / strata z operácií s devízami	5	0	0	0
6.	Zisk / strata z derivátov	6	0	0	0
7.	Zisk / strata z operácií s drahými kovmi	7	0	0	0
8.	Zisk / strata z operácií s iným majetkom	8	0	0	0
I.	Výnos z majetku	9	2 404	789	584
9.	Transakčné náklady	10	3	8	8
10.	Bankové a iné poplatky	11	33	24	12
II.	Čistý výnos z majetku	12	2 368	757	564
11.	Náklady na financovanie dôchodkového fondu	13	0	0	0
III.	Čistý zisk / strata zo správy majetku	14	2 368	757	564
12.	Náklady na odplaty	15	134	453	144
IV.	Zisk / strata dôchodkového fondu za účtovné obdobie	16	2 234	304	420