

Polročná správa o hospodárení s majetkom v dôchodkovom fonde

k 30. 06. 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

30.06.2023**1. Informácie o najvýznamnejších skutočnostiach, ktoré ovplyvnili hospodárenie s majetkom v dôchodkovom fonde a informácie o jeho očakávanom vývoji v nasledujúcom období**

Finančné trhy zakončili prvý polrok 2023 slušnými ziskami, keď sa darilo predovšetkým rizikovejším aktívam. Finančným indexom k ziskom dopomohlo predovšetkým odvrátenie bankrotu Spojených štátov, blížiaci sa koniec cyklu zvyšovania úrokových sadzieb či postupný pokles inflácie v Európe i zámorí. Globálny akciový index MSCI World si za prvý polrok pripísal zisk 13,8 % v USD.

Pre vývoj na dlhopisových trhoch boli kľúčové inflačné čísla a očakávania ohľadom ďalšej trajektórie úrokových sadzieb. Zatiaľ čo inflácia prekvapuje vo väčšine hlavných ekonomík skôr smerom dole, centrálni bankári sa s doterajším progresom v poklese inflácie neuspokojujú a naznačujú ďalší rast úrokových sadzieb. Aj preto si dlhopisy v porovnaní s akciami pripísali v prvom polroku len mierne zisky. Napríklad kompozitný index európskych vládnych dlhopisov je za uplynulý polrok v zisku len 1,3 %. Darilo sa však rizikovejším častiam dlhopisového trhu. V prvom polroku tak výraznejšie rástli ceny dlhopisov štátov mimo jadra eurozóny, či niektorých stredoeurópskych vládnych dlhopisov. Napríklad 10ročný štátny dlhopis Talianska posilnil za prvých 6 mesiacov o 6,3 %. Ziskový prvý polrok zaznamenali aj korporátne dlhopisy. Európsky index korporátnych dlhopisov s ratingom v investičnom pásme vzrástol v prvom polroku o 1,6 %.

Pod rast hodnoty dôchodkovej jednotky fondu Solid - Dlhopisový garantovaný d.f. NN d.s.s., a.s., ktorý za uplynulý polrok činil + 1,76 %, sa podpísal mierny rast na svetových dlhopisových trhoch.

V Európe sme síce svedkami postupne klesajúcej inflácie, centrálni bankári sú však odhodlaní zvyšovať sadzby ďalej. Sadzby pravdepodobne dosiahnu vrchol v septembri, kedy podľa očakávania Európska centrálna banka (ECB) ukončí cyklus zvyšovania sadzieb. Dlhopisy aktuálne síce zarábajú výrazne viac na ročnej báze vďaka vyšším výnosom dlhopisov po minuloročných poklesoch, no môže trvať istý čas, kým sa minuloročné prepady na trhoch týmito vyššími výnosmi vykompenzujú. Preto u dlhopisovej triedy aktív očakávame len mierne kladné zisky v druhom polroku.

Názov dôchodkového fondu

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

Identifikačný kód

S2203060010

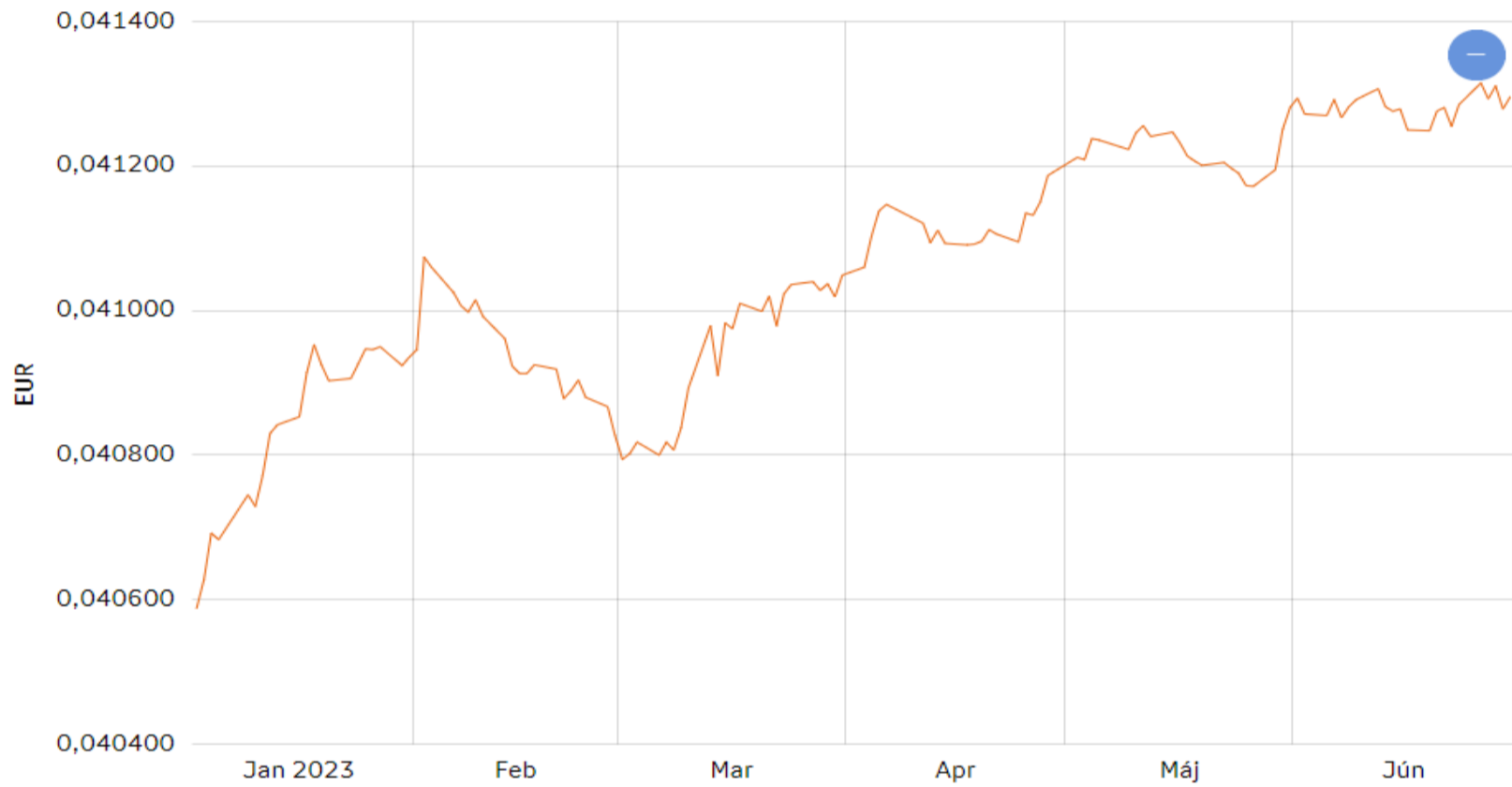
Stav ku dňu

30.06.2023

2. Grafické znázornenie vývoja hodnoty dôchodkovej jednotky

Vývoj hodnoty dôchodkovej jednotky

od 1.1.2023 do 30.06.2023



Solid - Dlhopisový garantovaný d.f.

Harmónia - Zmiešaný negarantovaný d.f.

Dynamika - Akciový negarantovaný d.f.

Rešpekt - Akciový negarantovaný ESG d.f.

Index Global - Indexový negarantovaný d.f.

Hodnota DJ 30.06.2022

0,041297

Názov dôchodkového fondu

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

Identifikačný kód

S2203060010

Stav ku dňu

30.06.2023

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 30.06.2023 je takto vypočítaná hodnota v riziku pre časový horizont 20 dní na úrovni 0,9% 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

S2203060010

Stav ku dňu

30.06.2023

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	1078623,00	84,4091
	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	5082,00	0,3977
	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
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	0,00	0,0000
	Prijaté na obchodovanie na trhu kótovaných cenných papierov zahraničnej burzy cenných papierov so sídlom v členskom štáte	14		0,0000

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

S2203060010

Stav ku dňu

30.06.2023

Členenie podľa trhov

Druh majetku	Členenie	č.r.	Hodnota v tis. eur	Podiel na majetku v dôchodkovom fonde v %
a	b	c	1	2
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	9846,00	0,7705
	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	7564,00	0,5919
	na vkladovom účte u depozitára	25	45379,00	3,5512
	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	124542,00	9,7462
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

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

S2203060010

Stav ku dňu

30.06.2023

Členenie podľa trhov

Druh majetku	Členenie	č.r.	Hodnota v tis. eur	Podiel na majetku v dôchodkovom fonde v %
a	b	c	1	2
Objem pohľadávok dôchodkového fondu celkom		33	6815,00	0,5333
Hodnota majetku v dôchodkovom fonde		34	1277851,00	100,0000
Objem záväzkov dôchodkového fondu celkom		35	6089,00	0,4765
Čistá hodnota majetku v dôchodkovom fonde		36	1271762,00	99,5235

Názov dôchodkového fondu

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

Identifikačný kód

52203060010

Stav ku dňu

30.06.2023

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																				
1	AGENCE FRANCE LOCALE	4527,00	0,3543	0,00	0,0000	4527,00	0,3543	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	5082,00	0,3977	0,00	0,0000	0,00	0,0000	5082,00	0,3977	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	10051,00	0,7866	0,00	0,0000	10051,00	0,7866	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	19235,00	1,5053	0,00	0,0000	19235,00	1,5053	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	1110,00	0,0869	0,00	0,0000	1110,00	0,0869	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	23567,00	1,8443	0,00	0,0000	23567,00	1,8443	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	3339,00	0,2613	0,00	0,0000	3339,00	0,2613	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	0,0024	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	0,0024
9	CA IMMOBILIEN ANLAGEN AG	2471,00	0,1934	0,00	0,0000	2471,00	0,1934	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	5039,00	0,3943	0,00	0,0000	5039,00	0,3943	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 SPORTNELNA AS	21401,00	1,6748	0,00	0,0000	21401,00	1,6748	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	10669,00	0,8349	0,00	0,0000	10669,00	0,8349	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	18834,00	1,4739	0,00	0,0000	18834,00	1,4739	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	CK HUTCHISON GROUP	17554,00	1,3737	0,00	0,0000	17554,00	1,3737	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	COMMERZBANK AG	3385,00	0,2649	0,00	0,0000	3385,00	0,2649	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	CONTI-GUMMI FINANCE B.V.	2915,00	0,2281	0,00	0,0000	2915,00	0,2281	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	CROATIA	436,00	0,0341	0,00	0,0000	436,00	0,0341	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 BV	2252,00	0,1762	0,00	0,0000	2252,00	0,1762	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	CTP NV	7804,00	0,6107	0,00	0,0000	7804,00	0,6107	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 GAS NETWORKS INV	19585,00	1,5327	0,00	0,0000	19585,00	1,5327	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	CZECH REPUBLIC	28505,00	2,2307	0,00	0,0000	28505,00	2,2307	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 CREDIT LOCAL	72022,00	5,6362	0,00	0,0000	72022,00	5,6362	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	3701,00	0,2896	0,00	0,0000	3701,00	0,2896	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	3121,00	0,2442	0,00	0,0000	3121,00	0,2442	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	17404,00	1,3620	0,00	0,0000	17404,00	1,3620	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	10146,00	0,7940	0,00	0,0000	10146,00	0,7940	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	ERST&STEIERMAR	22806,00	1,7847	0,00	0,0000	22806,00	1,7847	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	26900,00	2,1051	0,00	0,0000	26900,00	2,1051	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	65365,00	5,1152	0,00	0,0000	65365,00	5,1152	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	13841,00	1,0831	0,00	0,0000	13841,00	1,0831	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	29246,00	2,2887	0,00	0,0000	29246,00	2,2887	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	13922,00	1,0895	0,00	0,0000	13922,00	1,0895	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	8787,00	0,6876	0,00	0,0000	8787,00	0,6876	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	FRENCH DISCOUNT T-BILL	9846,00	0,7705	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	9846,00	0,7705	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000
35	GLENCORE FINANCE EUROPE	13646,00	1,0679	0,00	0,0000	13646,00	1,0679	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	HAMBURG COMMERCIAL BANK	3048,00	0,2385	0,00	0,0000	3048,00	0,2385	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	HEIMSTADEN BOSTAD TRESRY	2421,00	0,1895	0,00	0,0000	2421,00	0,1895	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	HONG KONG	10686,00	0,8362	0,00	0,0000	10686,00	0,8362	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	HOWOGE WOHNUNGS	4715,00	0,3690	0,00	0,0000	4715,00	0,3690	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	HUNGARIAN DEVELOPMENT BA	24570,00	1,9228	0,00	0,0000	24570,00	1,9228	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	HYPONOE LB NOE WIEN AG	4381,00	0,3428	0,00	0,0000	4381,00	0,3428	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	INTESA SANPAOLO SPA	8659,00	0,6776	0,00	0,0000	8659,00	0,6776	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	LAND NIEDERSACHSEN	9257,00	0,7244	0,00	0,0000	9257,00	0,7244	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	LITHUANIA GOVERNMT BOND	11564,00	0,9050	0,00	0,0000	11564,00	0,9050	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	LUMINOR BANK	9730,00	0,7614	0,00	0,0000	9730,00	0,7614	0,00													

Názov dôchodkového fondu

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

Identifikačný kód

52203060010

Stav ku dňu

30.06.2023

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																				
60	REPUBLIC OF POLAND	47941,00	3,7517	0,00	0,0000	47941,00	3,7517	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
61	RLB OBEROESTERREICH	12018,00	0,9405	0,00	0,0000	12018,00	0,9405	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
62	ROMANIA	12506,00	0,9787	0,00	0,0000	12506,00	0,9787	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	SLOVAKIA GOVERNMENT BOND	97529,00	7,6323	0,00	0,0000	97529,00	7,6323	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	SLOVENSKA SPORITELNA AS	65126,00	5,0965	0,00	0,0000	12183,00	0,9534	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	52943,00	4,1431	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000
65	SOCIETE GENERALE	15115,00	1,1828	0,00	0,0000	15115,00	1,1828	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	SPP INFRASTRUCTURE FIN	4169,00	0,3263	0,00	0,0000	4169,00	0,3263	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	TATRA BANKA AS	142719,00	11,1687	0,00	0,0000	31225,00	2,4436	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	111494,00	8,7251	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000
68	UNICREDIT BANK CR&SR	13048,00	1,0211	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	13048,00	1,0211	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000
69	UNICREDIT SPA	3374,00	0,2640	0,00	0,0000	3374,00	0,2640	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	Unedic	16800,00	1,3147	0,00	0,0000	16800,00	1,3147	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	VOLKSWAGEN BANK GMBH	7845,00	0,6139	0,00	0,0000	7845,00	0,6139	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	VOLKSWAGEN FIN SERV AG	1483,00	0,1161	0,00	0,0000	1483,00	0,1161	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
73	VOLKSWAGEN LEASING GMBH	6269,00	0,4906	0,00	0,0000	6269,00	0,4906	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
74	VSEOBECNA UVEROVA BANKA	1815,00	0,1420	0,00	0,0000	1815,00	0,1420	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
75	ZAPADOSLOVENSKA ENRG AS	7652,00	0,5988	0,00	0,0000	7652,00	0,5988	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
76	NN DSS, a.s.	6784,00	0,5309	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	6784,00	0,5309

Názov dôchodkového fondu

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

Identifikačný kód

52203060010

Stav ku dňu

30.06.2023

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 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	0899	13646,00	1,0679	0,00	0,0000	13646,00	1,0679	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	1920	28309,00	2,2154	0,00	0,0000	28309,00	2,2154	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	2910	4861,00	0,3804	0,00	0,0000	4861,00	0,3804	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	3511	47011,00	3,6789	0,00	0,0000	47011,00	3,6789	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	3513	13406,00	1,0491	0,00	0,0000	13406,00	1,0491	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	3522	38306,00	2,9977	0,00	0,0000	38306,00	2,9977	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	4920	10669,00	0,8349	0,00	0,0000	10669,00	0,8349	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	5911	1110,00	0,0869	0,00	0,0000	1110,00	0,0869	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
9	6120	17554,00	1,3737	0,00	0,0000	17554,00	1,3737	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	6419	26220,00	2,0519	0,00	0,0000	26220,00	2,0519	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	6430	5082,00	0,3977	0,00	0,0000	0,00	0,0000	5082,00	0,3977	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	6491	7752,00	0,6066	0,00	0,0000	7752,00	0,6066	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	6499	583342,00	45,6502	0,00	0,0000	405857,00	31,7609	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	177485,00	13,8893	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000
14	6820	24977,00	1,9546	0,00	0,0000	24977,00	1,9546	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	8411	448822,00	35,1232	0,00	0,0000	438945,00	34,3502	0,00	0,0000	0,00	0,0000	9846,00	0,7705	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	31,00	0,0024
16	6530	6784,00	0,5309	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	6784,00	0,5309

Hlásenie o vývoji počtu sporiteľov

Názov dôchodkového fondu

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

LEI

315700UD30CZ5UHFFW92

Identifikačný kód

S2203060010

Štav ku dňu

30.06.2023

		Hodnota
a	b	1
Počet sporiteľov	1	241 752
Objem príspevkov v eurách	2	78 404 049
Objem penále v eurách	3	0

Výkaz pasív dôchodkového fondu

Názov dôchodkového fondu

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

Identifikačný kód

S2203060010

Stav ku dňu

30.06.2023

Označenie	Položka	č. r.	Hodnota v tis. eur
a	b	c	1
1.	Závazky	1	6089
a)	záväzky voči bankám	2	0
b)	záväzky z ukončenia dôchodkového sporenia	3	5495
c)	záväzky voči dôchodkovej správcovskej spoločnosti	4	468
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	126
2.	Vlastné imanie	9	1271762
a)	dôchodkové jednotky na osobných dôchodkových účtoch sporiteľov	10	1250177
b)	zisk alebo strata za účtovné obdobie	11	21585
3.	Pasíva spolu	12	1277851

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

30.06.2023

Označenie	Položka	č. r.	Hodnota v tis. eur
a	b	c	1
1.	Výnosy z úrokov a obdobné výnosy	1	10767
a)	z peňažných prostriedkov na bežnom účte	2	0
b)	z peňažných prostriedkov na vkladovom účte	3	2225
c)	z dlhopisov a obdobných dlhových cenných papierov	4	8542
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	32
a)	z kapitálových cenných papierov a obdobných cenných papierov	9	0
b)	z dlhopisov a iných dlhových cenných papierov	10	-32
c)	z nástrojov peňažného trhu	11	0
d)	z podielových listov a obdobných cenných papierov	12	64
5.	Náklady na operácie s cennými papiermi a podielmi	13	-13246
a)	kapitálové cenné papiere a obdobné cenné papiere	14	0
b)	dlhopisy a iné dlhové cenné papiere	15	-13184
c)	nástroje peňažného trhu	16	0
d)	podielové listy a obdobné cenné papiere	17	-62
6.	Zisk/strata z operácií s cennými papiermi a podielmi	18	13278
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	24681
11.	Transakčné náklady	24	10
a)	náklady na transakcie s CP platené depozitárovi	25	0
b)	poplatky pri nákupe a predaji CP platené tretej strane	26	10
12.	Bankové a iné poplatky	27	231
a)	bankové odplaty a poplatky	28	231
b)	burzové odplaty a poplatky	29	0
II.	Čistý výnos z majetku vo fonde	30	24440
13.	Náklady na financovanie dôchodkového fondu	31	0
III.	Čistý zisk/strata zo správy majetku	32	24440
14.	Iné výnosy	33	0
15.	Náklady na odplaty	34	2855
a)	náklady na odplatu za správu DF	35	2782
b)	náklady na odplatu za zhodnotenie majetku v DF	36	73
c)	náklady na iné odplaty	37	0
IV.	Zisk/strata dôchodkového fondu za účtovné obdobie	38	21585

Skrátená verzia polročnej 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

30.06.2023

Výkaz aktív a pasív dôchodkového fondu

Označenie	Položka	č.r.	V tis. EUR 30.06.2023	V tis. EUR 30.06.2022	V tis. EUR 30.06.2021
I.	Investičný majetok	1	1 263 472	1 189 054	1 382 932
1.	Dlhopisy oceňované umorovanou hodnotou	2	270 588	232 029	40 713
a)	bez kupónov	3	55 496	54 798	-
b)	s kupónmi	4	215 092	177 231	40 713
2.	Dlhopisy oceňované reálnou hodnotou	5	817 881	947 493	1 253 333
a)	bez kupónov	6	107 771	165 818	-
b)	s kupónmi	7	710 110	781 675	1 253 333
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	5 082	9 532	88 886
a)	otvorených podielových fondov	14	5 082	9 532	88 886
b)	ostatné	15	-	-	-
5.	Krátkodobé pohľadávky	16	169 921	-	-
a)	krátkodobé vklady v bankách	17	169 921	-	-
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	14 379	23 100	32 150
9.	Peňažné prostriedky a ekvivalenty peňažných prostriedkov	27	7 564	21 445	12 170
10.	Ostatný majetok	28	6 815	1 655	19 980
	Aktíva spolu	29	1 277 851	1 212 154	1 415 082

I.	Závazky	30	6 089	4 450	31 704
1.	Závazky voči bankám	31	-	-	-
2.	Závazky z ukončenia dôchodkového sporenia	32	5 495	4 010	3 358
3.	Závazky voči dôchodkovej správovskej spoločnosti	33	468	300	340
4.	Závazky z derivátových operácií	34	-	-	-
5.	Závazky z repoobchodov	35	-	-	-
6.	Závazky z vypožičania finančného majetku	36	-	-	-
7.	Ostatné záväzky	37	126	140	28 006
II.	Vlastné imanie	38	1 271 762	1 207 704	1 383 378
1.	Dôchodkové jednotky na osobných dôchodkových účtoch sporeiteľov, z toho	39	1 271 762	1 207 704	1 383 378
a)	zisk alebo strata za účtovné obdobie	40	21 585	(127 000)	(5 163)
	Pasíva spolu	41	1 277 851	1 212 154	1 415 082

Výkaz výnosov a nákladov dôchodkového fondu

Označenie	Položka	č.r.	V tis. EUR 1.1.-30.06.2023	V tis. EUR 1.1.-30.06.2022	V tis. EUR 1.1.-30.06.2021
1.	Výnosy z úrokov	1.	10 767	4 284	3 809
2.	Výnosy z podielových listov	2.	-	83	281
3.	Výnosy z dividend a z iných podielov na zisku	3.	-	-	-
4.	Zisk / strata z operácií s cennými papiermi	4.	13 278	(129 113)	(6 830)
5.	Zisk/strata z operácií s devízami	5.	-	-	-
6.	Zisk/strata z derivátov	6.	636	-	-
7.	Zisk/strata z operácií s drahými kovmi	7.	-	-	-
8.	Zisk/strata z operácií s iným majetkom	8.	-	-	-
I.	Výnos z majetku	9.	24 681	(124 746)	(2 740)
9.	Transakčné náklady	10.	10	-	-
10.	Bankové a iné poplatky	11.	231	279	(280)
II.	Čistý výnos z majetku	12.	24 440	(125 025)	(3 020)
11.	Náklady na financovanie fondu	13.	-	-	-
III.	Čistý zisk / strata zo správy majetku	14.	24 440	(125 025)	(3 020)
12.	Náklady na odplaty	15.	2 855	1 975	(2 143)
IV.	Zisk / strata dôchodkového fondu za účtovné obdobie	16.	21 585	(127 000)	(5 163)