

Ročná správa o hospodárení s majetkom v dôchodkovom fonde

k 31. 12. 2020

Solid – Dlhopisový garantovaný d.f.

NN dôchodková správcovská spoločnosť, a.s.



Hlásenie o najvýznamnejších skutočnostiach dôchodkového fondu

Názov dôchodkového fondu

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

Identifikačný kód

S2203060010

Stav ku dňu

31.12.2020

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

Pandémia koronavírusu postihla snáď každú krajinu na našej planéte a výrazným spôsobom ovplyvnila finančné trhy a tým aj výkonnosť dôchodkových fondov. Globálne akciové aj dlhopisové trhy zaznamenali obrovský prepád, ale aj veľmi rýchle oživenie. Za prudký odraz odo dna vďaka finančné trhy predovšetkým bezprecedentnej reakcii centrálnych bánk a masívnej podpore vlád. Do nového roku vstupuje svet, hlavne ten ekonomický, s obrovskou nádejou, že pandémiu vyrieši vakcína a ľudia sa budú môcť bez akýchkoľvek obmedzení vrátiť k normálnemu životu. Optimizmus okolo vakcíny spolu s masívnymi stimulmi na podporu ekonomiky sa pretavil aj do minuloročnej kladnej výkonnosti fondu Solid - dlhopisového garantovaného d. f. NN dôchodková správcovská spoločnosť, a.s. Pod rast hodnoty dôchodkovej jednotky, ktorý za uplynulý rok dosiahol +2,71 %, sa podpísali predovšetkým vládne a podnikové dlhopisy, ktorých výnosy výrazne klesli v dôsledku bezprecedentnej aktivity centrálnych bánk. Pozitívny dopad na výkonnosť mali predovšetkým európske vládne dlhopisy mimo jadra eurozóny a podnikové dlhopisy, ktorých ceny vzrástli najvýraznejšie spomedzi všetkých investícií fondu.

Pokračujúca uvoľnená menová politika bude naďalej veľmi dôležitá. Centrálné banky sú naďalej odhodlané robiť všetko nevyhnutné, aby si udržali nízke náklady financovania pre firmy a štáty. Neočakávame žiadne sprísnenie menovej politiky zo strany americkej (Fed) ani európskej centrálnej banky (ECB). Inflačné ciele v USA a eurozóne zrejme nebudú dosiahnuté, hoci kvantitatívne uvoľňovanie bude pokračovať v súčasnom rozsahu. Európska centrálna banka sa bude navyše sústreďovať na zlepšenie koordinácie fiškálnej a menovej politiky. Priaznivá politika americkej centrálnej banky (Fedu) a Európskej centrálnej banky (ECB) rovnako ako naše očakávanie, že v roku 2021 bude potrebná ešte väčšia podpora menovej politiky, by mali držať výnosy dlhopisov nízko. Očakávame, že európske sadzby zostanú na nízkych úrovniach po dlhšiu dobu. ECB navyše zrejme ďalej zvýši svoje nákupy aktív, čím obmedzí potenciálny rast výnosov dlhopisov.

Názov dôchodkového fondu

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

Identifikačný kód

S2203060010

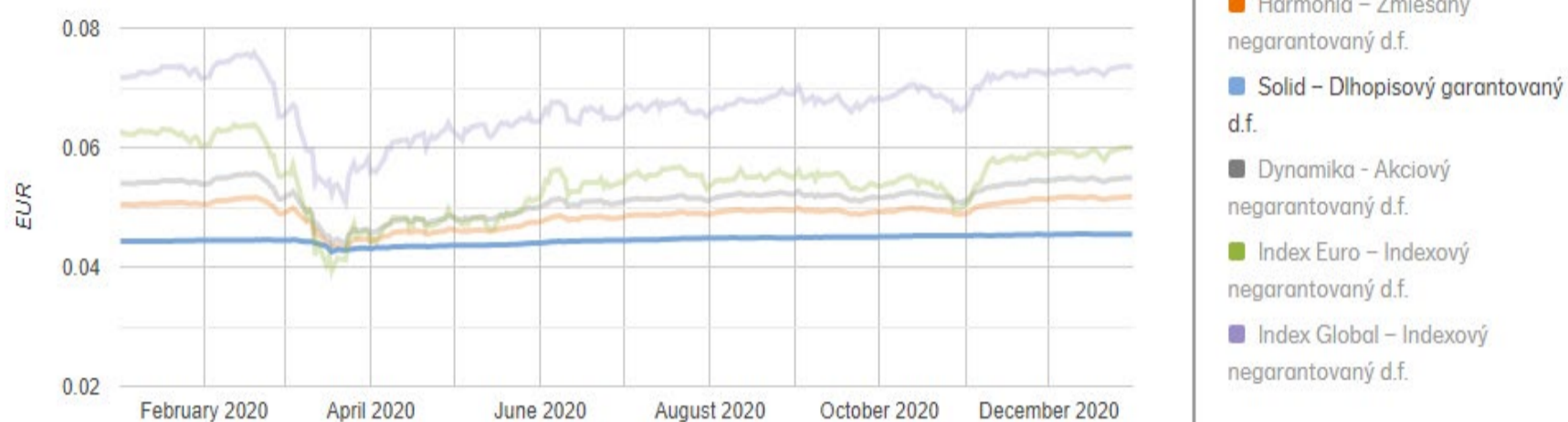
Stav ku dňu

31.12.2020

2. Grafické znázornenie vývoja hodnoty dôchodkovej jednotky

Vývoj hodnoty dôchodkovej jednotky

od 1.1.2020 do 31.12.2020



Hodnota DJ 31.12.2020 0,045485

Názov dôchodkového fondu

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

Identifikačný kód

S2203060010

Stav ku dňu

31.12.2020

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 31.12.2020 je takto vypočítaná hodnota v riziku pre časový horizont 20 dní na úrovni 1,5% čistej hodnoty majetku v dôchodkovom fonde.

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

31.12.2020

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	1 257 067,00	92,4985
	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	89 801,00	6,6078
	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

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

31.12.2020

Členenie podľa trhov

Druh majetku	Členenie	č.r.	Hodnota v tis. eur	Podiel na majetku v dôchodkovom fonde v %
a	b	c	1	2
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
	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	11 981,00	0,8816
	na vkladovom účte u depozitára	25		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		0,0000
	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	108,00		0,0079
Objem pohľadávok dôchodkového fondu celkom	33	56,00		0,0041
Hodnota majetku v dôchodkovom fonde	34	1 359 013,00		100,0000
Objem záväzkov dôchodkového fondu celkom	35	2 498,00		0,1838
Čistá hodnota majetku v dôchodkovom fonde	36	1 356 515,00		99,8162

Názov dôchodkového fondu

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

Identifikačný kód

S2203060010

Stav ku dňu

31.12.2020

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, menovového 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	AIR PRODUCTS & CHEMICALS	2 509,00	0,1846	0,00	0,0000	2 509,00	0,1846	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
2	AIRBUS SE	8 019,00	0,5901	0,00	0,0000	8 019,00	0,5901	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
3	AMERICAN HONDA FINANCE	3 538,00	0,2603	0,00	0,0000	3 538,00	0,2603	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
4	BANK GOSPODARSTWA KRAJOW	11 444,00	0,8421	0,00	0,0000	11 444,00	0,8421	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
5	BANK OF CHINA/FRANKFURT	13 237,00	0,9740	0,00	0,0000	13 237,00	0,9740	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
6	BANK OF NOVA SCOTIA	10 074,00	0,7413	0,00	0,0000	10 074,00	0,7413	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
7	BAYER AG	13 424,00	0,9878	0,00	0,0000	13 424,00	0,9878	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
8	BMW FINANCE NV	2 346,00	0,1726	0,00	0,0000	2 346,00	0,1726	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
9	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	587,00	0,0432	0,00	0,0000	587,00	0,0432	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
10	BP CAPITAL MARKETS PLC	5 779,00	0,4252	0,00	0,0000	5 779,00	0,4252	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
11	BPIFRANCE FINANCEMENT SA	37 539,00	2,7622	0,00	0,0000	37 539,00	2,7622	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
12	BUONI POLIENNALI DEL TES	92 198,00	6,7842	0,00	0,0000	92 167,00	6,7819	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	31,00	0,0023
13	CA IMMOBILIEN ANLAGEN AG	2 621,00	0,1929	0,00	0,0000	2 621,00	0,1929	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
14	CAISSE D'AMORT DETTE SOC	15 571,00	1,1458	0,00	0,0000	15 571,00	1,1458	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
15	CARREFOUR	2 139,00	0,1574	0,00	0,0000	2 139,00	0,1574	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
16	ČESKA EXPORTNI BANKA AS	5 000,00	0,3679	0,00	0,0000	5 000,00	0,3679	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
17	ČESKE DRAHY	13 678,00	1,0065	0,00	0,0000	13 678,00	1,0065	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
18	CETIN FINANCE BV	3 040,00	0,2237	0,00	0,0000	3 040,00	0,2237	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
19	CEZ AS	10 971,00	0,8073	0,00	0,0000	10 971,00	0,8073	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
20	COCA-COLA HBC FINANCE BV	1 599,00	0,1177	0,00	0,0000	1 599,00	0,1177	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
21	COMMERZBANK AG	3 595,00	0,2645	0,00	0,0000	3 595,00	0,2645	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
22	CONTI-GUMMI FINANCE B.V.	11 752,00	0,8647	0,00	0,0000	11 752,00	0,8647	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
23	CONTINENTAL AG	4 495,00	0,3308	0,00	0,0000	4 495,00	0,3308	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
24	COVESTRO AG	2 082,00	0,1532	0,00	0,0000	2 082,00	0,1532	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
25	CRH FINLAND SERVICES OYJ	3 087,00	0,2272	0,00	0,0000	3 087,00	0,2272	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
26	CRH SMW FINANCE DAC	2 783,00	0,2048	0,00	0,0000	2 783,00	0,2048	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
27	CROATIA	528,00	0,0389	0,00	0,0000	528,00	0,0389	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
28	CTP BV	18 412,00	1,3548	0,00	0,0000	18 412,00	1,3548	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
29	CZECH GAS NETWORKS INV	23 520,00	1,7307	0,00	0,0000	23 520,00	1,7307	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
30	DAIMLER AG	16 209,00	1,1927	0,00	0,0000	16 209,00	1,1927	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
31	DAIMLER INTL FINANCE BV	6 124,00	0,4506	0,00	0,0000	6 124,00	0,4506	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
32	EFSE	4 109,00	0,3024	0,00	0,0000	4 109,00	0,3024	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
33	EMERSON ELECTRIC CO	3 059,00	0,2251	0,00	0,0000	3 059,00	0,2251	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
34	EP INFRASTRUCTURE AS	13 094,00	0,9635	0,00	0,0000	13 094,00	0,9635	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
35	ERSTE GROUP BANK AG	10 430,00	0,7675	0,00	0,0000	10 430,00	0,7675	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
36	EUROFIMA	30 581,00	2,2502	0,00	0,0000	30 581,00	2,2502	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
37	EUSTREAM AS	19 312,00	1,4210	0,00	0,0000	19 312,00	1,4210	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
38	EXPORT-IMPORT BANK CHINA	5 533,00	0,4071	0,00	0,0000	5 533,00	0,4071	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
39	EXPORT-IMPORT BANK KOREA	39 197,00	2,8842	0,00	0,0000	39 197,00	2,8842	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
40	FADE	15 291,00	1,1252	0,00	0,0000	15 291,00	1,1252	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
41	FLEMISH COMMUNITY	27 693,00	2,0377	0,00	0,0000	27 693,00	2,0377	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
42	GENERAL ELECTRIC CO	2 775,00	0,2042	0,00	0,0000	2 775,00	0,2042	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
43	GLENCORE FINANCE EUROPE	3 679,00	0,2707	0,00	0,0000	3 679,00	0,2707	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
44	GRENKE FINANCE PLC	2 902,00	0,2135	0,00	0,0000	2 902,00	0,2135	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
45	HEIMSTADEN BOSTAD TRESRY	3 463,00	0,2548	0,00	0,0000	3 463,00	0,2548	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
46	HUNGARIAN DEVELOPMENT BA	37 014,00	2,7236	0,00	0,0000	37 014,00	2,7236	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
47	HUNGARY	19 182,00	1,4115	0,00	0,0000	19 182,00	1,4115	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
48	CHINA DEVELOPMENT BANK	16 164,00	1,1894	0,00	0,0000	16 164,00	1,1894	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0				

Názov dôchodkového fondu

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

Identifikačný kód

S2203060010

Stav ku dňu

31.12.2020

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, menovového 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		
56	LAND NIEDERSACHSEN	10 247,00	0,7540	0,00	0,0000	10 247,00	0,7540	0,00	0,0000					0,00	0,0000			0,0000		0,00	0,0000		
57	LB BADEN-WUERTEMBERG	25 921,00	1,9073	0,00	0,0000	25 921,00	1,9073	0,00	0,0000					0,0000	0,00	0,0000			0,0000		0,0000	0,00	0,0000
58	LITHUANIA GOVERNMENT BOND	12 319,00	0,9065	0,00	0,0000	12 319,00	0,9065	0,00	0,0000					0,0000	0,00	0,0000			0,0000		0,0000	0,00	0,0000
59	LOGICOR FINANCING SARL	2 007,00	0,1477	0,00	0,0000	2 007,00	0,1477	0,00	0,0000					0,0000	0,00	0,0000			0,0000		0,0000	0,00	0,0000
60	LUMINOR BANK ESTONIA	1 532,00	0,1127	0,00	0,0000	1 532,00	0,1127	0,00	0,0000					0,0000	0,00	0,0000			0,0000		0,0000	0,00	0,0000
61	Lyxor Barclays Floating Rate E	19 693,00	1,4491	0,00	0,0000	0,00	0,0000	19 693,00	1,4491					0,0000	0,00	0,0000			0,0000		0,0000	0,00	0,0000
62	MET LIFE GLOB FUNDING I	4 084,00	0,3005	0,00	0,0000	4 084,00	0,3005	0,00	0,0000					0,0000	0,00	0,0000			0,0000		0,0000	0,00	0,0000
63	MIZUHO FINANCIAL GROUP	8 288,00	0,6099	0,00	0,0000	8 288,00	0,6099	0,00	0,0000					0,0000	0,00	0,0000			0,0000		0,0000	0,00	0,0000
64	MOL HUNGARIAN OIL & GAS	17 274,00	1,2711	0,00	0,0000	17 274,00	1,2711	0,00	0,0000					0,0000	0,00	0,0000			0,0000		0,0000	0,00	0,0000
65	MUENCHENER HYPOTHEKENBNK	4 049,00	0,2979	0,00	0,0000	4 049,00	0,2979	0,00	0,0000					0,0000	0,00	0,0000			0,0000		0,0000	0,00	0,0000
66	NET4GAS SRO	7 715,00	0,5677	0,00	0,0000	7 715,00	0,5677	0,00	0,0000					0,0000	0,00	0,0000			0,0000		0,0000	0,00	0,0000
67	NETHERLANDS GOVERNMENT	68 648,00	5,0513	0,00	0,0000	68 648,00	5,0513	0,00	0,0000					0,0000	0,00	0,0000			0,0000		0,0000	0,00	0,0000
68	NYKREDIT REALKREDIT AS	15 741,00	1,1583	0,00	0,0000	15 741,00	1,1583	0,00	0,0000					0,0000	0,00	0,0000			0,0000		0,0000	0,00	0,0000
69	OBERBANK AG	7 109,00	0,5231	0,00	0,0000	7 109,00	0,5231	0,00	0,0000					0,0000	0,00	0,0000			0,0000		0,0000	0,00	0,0000
70	OMV AG	14 143,00	1,0407	0,00	0,0000	14 143,00	1,0407	0,00	0,0000					0,0000	0,00	0,0000			0,0000		0,0000	0,00	0,0000
71	PACCAR FINANCIAL EUROPE	3 008,00	0,2213	0,00	0,0000	3 008,00	0,2213	0,00	0,0000					0,0000	0,00	0,0000			0,0000		0,0000	0,00	0,0000
72	RAIFFEISEN BANK INTL	10 119,00	0,7446	0,00	0,0000	10 119,00	0,7446	0,00	0,0000					0,0000	0,00	0,0000			0,0000		0,0000	0,00	0,0000
73	REPUBLIC OF CHILE	27 067,00	1,9917	0,00	0,0000	27 067,00	1,9917	0,00	0,0000					0,0000	0,00	0,0000			0,0000		0,0000	0,00	0,0000
74	REPUBLIC OF POLAND	88 870,00	6,5393	0,00	0,0000	88 870,00	6,5393	0,00	0,0000					0,0000	0,00	0,0000			0,0000		0,0000	0,00	0,0000
75	REPUBLIKA SLOVENIJA	7 347,00	0,5406	0,00	0,0000	7 347,00	0,5406	0,00	0,0000					0,0000	0,00	0,0000			0,0000		0,0000	0,00	0,0000
76	RLB OBEROESTERREICH	11 988,00	0,8821	0,00	0,0000	11 988,00	0,8821	0,00	0,0000					0,0000	0,00	0,0000			0,0000		0,0000	0,00	0,0000
77	ROMANIA	14 023,00	1,0319	0,00	0,0000	14 023,00	1,0319	0,00	0,0000					0,0000	0,00	0,0000			0,0000		0,0000	0,00	0,0000
78	SANTAN CONSUMER FINANCE	2 740,00	0,2016	0,00	0,0000	2 740,00	0,2016	0,00	0,0000					0,0000	0,00	0,0000			0,0000		0,0000	0,00	0,0000
79	SCANIA CV AB	3 543,00	0,2607	0,00	0,0000	3 543,00	0,2607	0,00	0,0000					0,0000	0,00	0,0000			0,0000		0,0000	0,00	0,0000
80	SID BANKA EXPORT AND DEV	3 037,00	0,2235	0,00	0,0000	3 037,00	0,2235	0,00	0,0000					0,0000	0,00	0,0000			0,0000		0,0000	0,00	0,0000
81	SIGNIFY NV	3 206,00	0,2359	0,00	0,0000	3 206,00	0,2359	0,00	0,0000					0,0000	0,00	0,0000			0,0000		0,0000	0,00	0,0000
82	SIKA CAPITAL BV	3 386,00	0,2492	0,00	0,0000	3 386,00	0,2492	0,00	0,0000					0,0000	0,00	0,0000			0,0000		0,0000	0,00	0,0000
83	SLOVAKIA GOVERNMENT BOND	96 869,00	7,1279	0,00	0,0000	96 869,00	7,1279	0,00	0,0000					0,0000	0,00	0,0000			0,0000		0,0000	0,00	0,0000
84	SLOVENSKA SPORITELNA AS	27 236,00	2,0041	0,00	0,0000	15 255,00	1,1225	0,00	0,0000					0,0000	11 981,00	0,8816			0,0000		0,0000	0,00	0,0000
85	SPP DISTRIBUCIA AS	15 823,00	1,1643	0,00	0,0000	15 823,00	1,1643	0,00	0,0000					0,0000	0,00	0,0000			0,0000		0,0000	0,00	0,0000
86	SPP INFRASTRUCTURE FIN	5 098,00	0,3751	0,00	0,0000	5 098,00	0,3751	0,00	0,0000					0,0000	0,00	0,0000			0,0000		0,0000	0,00	0,0000
87	TAKEDA PHARMACEUTICAL	2 026,00	0,1491	0,00	0,0000	2 026,00	0,1491	0,00	0,0000					0,0000	0,00	0,0000			0,0000		0,0000	0,00	0,0000
88	TELE2 AB	6 587,00	0,4847	0,00	0,0000	6 587,00	0,4847	0,00	0,0000					0,0000	0,00	0,0000			0,0000		0,0000	0,00	0,0000
89	TORONTO-DOMINION BANK	5 097,00	0,3751	0,00	0,0000	5 097,00	0,3751	0,00	0,0000					0,0000	0,00	0,0000			0,0000		0,0000	0,00	0,0000
90	UNICREDIT SPA	15 687,00	1,1543	0,00	0,0000	15 687,00	1,1543	0,00	0,0000					0,0000	0,00	0,0000			0,0000		0,0000	0,00	0,0000
91	VOLKSWAGEN BANK GMBH	5 207,00	0,3831	0,00	0,0000	5 207,00	0,3831	0,00	0,0000					0,0000	0,00	0,0000			0,0000		0,0000	0,00	0,0000
92	VOLKSWAGEN FIN SERV AG	1 706,00	0,1255	0,00	0,0000	1 706,00	0,1255	0,00	0,0000					0,0000	0,00	0,0000			0,0000		0,0000	0,00	0,0000
93	VOLKSWAGEN LEASING GMBH	3 099,00	0,2280	0,00	0,0000	3 099,00	0,2280	0,00	0,0000					0,0000	0,00	0,0000			0,0000		0,0000	0,00	0,0000
94	VSEOBECNA UVEROVA BANKA	25 782,00	1,8971	0,00	0,0000	25 757,00	1,8953	0,00	0,0000					0,0000	0,00	0,0000			0,0000		0,0000	25,00	0,0018
95	WELLS FARGO & COMPANY	8 009,00	0,5893	0,00	0,0000	8 009,00	0,5893	0,00	0,0000					0,0000	0,00	0,0000			0,0000		0,0000	0,00	0,0000
96	WESTPAC SEC NZ/LONDON	6 114,00	0,4499	0,00	0,0000	6 114,00	0,4499	0,00	0,0000					0,0000	0,00	0,0000			0,0000		0,0000	0,00	0,0000
97	WORLDLINE SA/FRANCE	22 911,00	1,6859	0,00	0,0000	22 911,00	1,6859	0,00	0,0000					0,0000	0,00	0,0000			0,0000		0,0000	0,00	0,0000
98	ZAPADOSLOVENSKA ENRG AS	12 295,00	0,9047	0,00	0,0000	12 295,00	0,9047	0,00	0,0000					0,0000	0,00	0,0000			0,0000		0,0000	0,00	0,0000
99	NN DSS, a.s.	108,00	0,0079	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000					0,0000	0,00	0,0000			0,0000	108,00	0,0079	0,00	0,0000

Názov dôchodkového fondu

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

Identifikačný kód

S2203060010

Stav ku dňu

31.12.2020

Členenie podľa sektorového hľadiska

č. r.	Sekcie klasifikácie ekonomických činností	Spolu		Kapitálové CP a obdobné CP		Dlhopisy a iné dlhové CP		PL OPF a CP ZSKI		CP IZSKI		NPT		Peňažné prostriedky na BÚ a VÚ		Pohľadávky a záväzky vznikajúce pri obchodoch určených výlučne na obmedzenie úrokového rizika, menového rizika alebo iného rizika		Iný majetok		Pohľadávky dôchodkového fondu	
		objem v tis. eur	podiel v %	objem v tis. eur	podiel v %	objem v tis. eur	podiel v %	objem v tis. eur	podiel v %	objem v tis. eur	podiel v %	objem v tis. eur	podiel v %	objem v tis. eur	podiel v %	reálna hodnota v tis. eur	podiel v %	objem v tis. eur	podiel v %	objem v tis. eur	podiel v %
a	b	1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13	14	15	16	17	18	19	20
0	CELKOM																				
1	1107	1 599,00	0,1177	0,00	0,0000	1 599,00	0,1177	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
2	1920	37 196,00	2,7370	0,00	0,0000	37 196,00	2,7370	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
3	2059	4 591,00	0,3378	0,00	0,0000	4 591,00	0,3378	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
4	2120	15 450,00	1,1369	0,00	0,0000	15 450,00	1,1369	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
5	2361	3 386,00	0,2492	0,00	0,0000	3 386,00	0,2492	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
6	2790	9 040,00	0,6652	0,00	0,0000	9 040,00	0,6652	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
7	2910	19 752,00	1,4534	0,00	0,0000	19 752,00	1,4534	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
8	2932	5 701,00	0,4195	0,00	0,0000	5 701,00	0,4195	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
9	3030	8 019,00	0,5901	0,00	0,0000	8 019,00	0,5901	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
10	3511	36 361,00	2,6755	0,00	0,0000	36 361,00	2,6755	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
11	3522	71 770,00	5,2810	0,00	0,0000	71 770,00	5,2810	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
12	4729	2 139,00	0,1574	0,00	0,0000	2 139,00	0,1574	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
13	4920	13 677,00	1,0064	0,00	0,0000	13 677,00	1,0064	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
14	6120	9 627,00	0,7084	0,00	0,0000	9 627,00	0,7084	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
15	6209	22 910,00	1,6858	0,00	0,0000	22 910,00	1,6858	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
16	6430	89 801,00	6,6078	0,00	0,0000	0,00	0,0000	89 801,00	6,6078		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
17	6491	4 805,00	0,3536	0,00	0,0000	4 805,00	0,3536	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
18	6499	420 159,00	30,9165	0,00	0,0000	408 153,00	30,0330	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	11 981,00	0,8816		0,0000		0,0000	25,00	0,0018
19	6511	4 084,00	0,3005	0,00	0,0000	4 084,00	0,3005	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
20	6820	26 503,00	1,9502	0,00	0,0000	26 503,00	1,9502	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
21	8411	548 656,00	40,3717	0,00	0,0000	548 625,00	40,3694	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	31,00	0,0023
22	0899	3 679,00	0,2707	0,00	0,0000	3 679,00	0,2707	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
23	6530	108,00	0,0079	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000	108,00	0,0079	0,00	0,0000

Názov dôchodkového fondu

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

Identifikačný kód

S2203060010

Stav ku dňu

31.12.2020

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 %	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
0a	Členské štáty	1 301 933,00	95,7999	0,00	0,0000	1 199 987,00	88,2984	89 801,00	6,6078	0,00	0,0000	0,00	0,0000	11 981,00	0,8816	0,00	0,0000	108,00	0,0079	56,00	0,0041
0b	Nečlenské štáty	57 080,00	4,2001	0,00	0,0000	57 080,00	4,2001	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																				
1	4W	4 109,00	0,3024	0,00	0,0000	4 109,00	0,3024	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
2	AT	58 614,00	4,3130	0,00	0,0000	58 614,00	4,3130	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
3	BE	27 693,00	2,0377	0,00	0,0000	27 693,00	2,0377	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
4	CA	15 172,00	1,1164	0,00	0,0000	15 172,00	1,1164	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
5	CL	27 067,00	1,9917	0,00	0,0000	27 067,00	1,9917	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
6	CN	21 697,00	1,5965	0,00	0,0000	21 697,00	1,5965	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
7	CZ	50 458,00	3,7128	0,00	0,0000	50 458,00	3,7128	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
8	DE	104 477,00	7,6877	0,00	0,0000	104 477,00	7,6877	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
9	DK	15 741,00	1,1583	0,00	0,0000	15 741,00	1,1583	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
10	EE	1 532,00	0,1127	0,00	0,0000	1 532,00	0,1127	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
11	ES	18 619,00	1,3700	0,00	0,0000	18 619,00	1,3700	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
12	FI	13 735,00	1,0107	0,00	0,0000	13 735,00	1,0107	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
13	FR	78 159,00	5,7512	0,00	0,0000	78 159,00	5,7512	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
14	GB	11 892,00	0,8750	0,00	0,0000	11 892,00	0,8750	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
15	HR	528,00	0,0389	0,00	0,0000	528,00	0,0389	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
16	HU	73 469,00	5,4061	0,00	0,0000	73 469,00	5,4061	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
17	CH	30 582,00	2,2503	0,00	0,0000	30 582,00	2,2503	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
18	IE	75 793,00	5,5771	0,00	0,0000	5 685,00	0,4183	70 108,00	5,1587		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
19	IT	124 599,00	9,1683	0,00	0,0000	124 568,00	9,1661	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	31,00	0,0023
20	JE	3 679,00	0,2707	0,00	0,0000	3 679,00	0,2707	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
21	JP	10 314,00	0,7589	0,00	0,0000	10 314,00	0,7589	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
22	KR	39 197,00	2,8842	0,00	0,0000	39 197,00	2,8842	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
23	LT	12 319,00	0,9065	0,00	0,0000	12 319,00	0,9065	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
24	LU	45 220,00	3,3274	0,00	0,0000	25 527,00	1,8783	19 693,00	1,4491		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
25	NL	138 099,00	10,1617	0,00	0,0000	138 099,00	10,1617	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
26	PL	100 313,00	7,3813	0,00	0,0000	100 313,00	7,3813	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
27	RO	14 023,00	1,0319	0,00	0,0000	14 023,00	1,0319	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
28	SE	10 129,00	0,7453	0,00	0,0000	10 129,00	0,7453	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
29	SI	10 384,00	0,7641	0,00	0,0000	10 384,00	0,7641	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
30	SK	197 425,00	14,5271	0,00	0,0000	185 311,00	13,6357	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	11 981,00	0,8816		0,0000	108,00	0,0079	25,00	0,0018
31	US	23 975,00	1,7641	0,00	0,0000	23 975,00	1,7641	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000

Názov dôchodkového fondu

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

Identifikačný kód

S2203060010

Stav ku dňu

31.12.2020

Čítenie 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.	podiel v %	objem v tis. eur	podiel v %	objem v tis. eur
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		1 359 013,00	100,0000	0,00	0,0000	1 257 067,00	92,4985	89 801,00	6,6078	0,00	0,0000	0,00	0,0000	11 981,00	0,8816	0,00	0,0000	0,00	0,0000	108,00	0,0079	56,00	0,0041
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	0,0000	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	0,0000	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	0,0000	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	0,0000	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	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000
0g	CELKOM OSTATNÉ		0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000
1	EUR	M1	12 006,00	0,8834	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	11 981,00	0,8816			0,0000		0,0000		25,00	0,0018
2	EUR	O3M6M	20 340,00	1,4967	0,00	0,0000	20 340,00	1,4967	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000			0,0000		0,0000		0,00	0,0000
3	EUR	6M1R	30 155,00	2,2189	0,00	0,0000	30 155,00	2,2189	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000			0,0000		0,0000		0,00	0,0000
4	EUR	R1PR3	231 460,00	17,0315	0,00	0,0000	231 460,00	17,0315	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000			0,0000		0,0000		0,00	0,0000
5	EUR	R3PR5	425 480,00	31,3080	0,00	0,0000	425 480,00	31,3080	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000			0,0000		0,0000		0,00	0,0000
6	EUR	R5PR10	492 151,00	36,2139	0,00	0,0000	492 151,00	36,2139	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000			0,0000		0,0000		0,00	0,0000
7	EUR	R10PR15	57 481,00	4,2296	0,00	0,0000	57 481,00	4,2296	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000			0,0000		0,0000		0,00	0,0000
8	EUR	NA	89 940,00	6,6180	0,00	0,0000	0,00	0,0000	89 801,00	6,6078		0,0000		0,0000	0,00	0,0000			0,0000	108,00	0,0079	31,00	0,0023	

Dof (SP) 17-02

Hlásenie o vývoji počtu sporiteľov

Názov dôchodkového fondu

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

Identifikačný kód

S2203060010

Stav ku dňu

31.12.2020

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
221 079	113 551 254	143	114 128	106 951	150 546	70 533	8 592	15 293	2 546	3 807	474

Dof (PAS) 31-02

Výkaz pasív dôchodkového fondu

Názov dôchodkového fondu

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

Identifikačný kód

S2203060010

Stav ku dňu

31.12.2020

Označenie	Položka	č. r.	Hodnota v tis. eur
a	b	c	1
1.	Závazky	1	2498
a)	záväzky voči bankám	2	0
b)	záväzky z ukončenia dôchodkového sporenia	3	1726
c)	záväzky voči dôchodkovej správcovskej spoločnosti	4	632
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	140
2.	Vlastné imanie	9	1356515
a)	dôchodkové jednotky na osobných dôchodkových účtoch sporiteľov	10	1321059
b)	zisk alebo strata za účtovné obdobie	11	35456
3.	Pasíva spolu	12	1359013

Výkaz výnosov a nákladov dôchodkového fondu

Názov dôchodkového fondu

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

Identifikačný kód

S2203060010

Stav ku dňu

31.12.2020

Označenie	Položka	č. r.	Hodnota v tis. eur
a	b	c	1
1.	Výnosy z úrokov a obdobné výnosy	1	6 883
a)	z peňažných prostriedkov na bežnom účte	2	0
b)	z peňažných prostriedkov na vkladovom účte	3	46
c)	z dlhopisov a obdobných dlhových cenných papierov	4	6 837
d)	z nástrojov peňažného trhu	5	0
2.	Výnosy z podielových listov a obdobné výnosy	6	592
3.	Výnosy z dividend a iných podielov na zisku	7	0
4.	Výnosy z operácií s cennými papiermi a podielmi	8	42 016
a)	z kapitálových cenných papierov a obdobných cenných papierov	9	0
b)	z dlhopisov a iných dlhových cenných papierov	10	41 104
c)	z nástrojov peňažného trhu	11	0
d)	z podielových listov a obdobných cenných papierov	12	912
5.	Náklady na operácie s cennými papiermi a podielmi	13	6 600
a)	kapitálové cenné papiere a obdobné cenné papiere	14	0
b)	dlhopisy a iné dlhové cenné papiere	15	6 915
c)	nástroje peňažného trhu	16	0
d)	podielové listy a obdobné cenné papiere	17	-315
6.	Zisk/strata z operácií s cennými papiermi a podielmi	18	35 416
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	42 891
11.	Transakčné náklady	24	0
a)	náklady na transakcie s CP platené depozitárovi	25	0
b)	poplatky pri nákupe a predaji CP platené tretej strane	26	0
12.	Bankové a iné poplatky	27	500
a)	bankové odplaty a poplatky	28	500
b)	burzové odplaty a poplatky	29	0
II.	Čistý výnos z majetku vo фонде	30	42 391
13.	Náklady na financovanie dôchodkového fondu	31	0
III.	Čistý zisk/strata zo správy majetku	32	42 391
14.	Iné výnosy	33	0
15.	Náklady na odplaty	34	6 935
a)	náklady na odplatu za správu DF	35	3 899
b)	náklady na odplatu za zhodnotenie majetku v DF	36	3 036
c)	náklady na iné odplaty	37	0
IV.	Zisk/strata dôchodkového fondu za účtovné obdobie	38	35 456

Skrátená verzia ročnej správy o hospodárení s majetkom v dôchodkovom fonde

Názov dôchodkového fondu

Stav ku dňu

SOLID- Dlhopisový garantovaný dôchodkový fond NN d.s.s., a.s.**31.12.2020**

*) údaje za fond Tradícia- dlhopisový garantovaný fond NN d.s.s.

**) fond Solid vznikol 1.11.2019 integráciou fondov Tradícia- dlhopisového garantovaného fondu NN d.s.s s fondom Solid-dlhopisovým garantovaným fondom AEGON d.s.s

Výkaz aktív a pasív dôchodkového fondu

Označenie	Položka	č.r.	**)		*)
			V tis. EUR 31.12.2020	V tis. EUR 31.12.2019	
I.	Investičný majetok	1	1 346 868	1 246 869	601 559
1.	Dlhopisy oceňované umorovanou hodnotou	2	41 037	41 130	
a)	bez kupónov	3	4 923	4 897	
b)	s kupónmi	4	36 114	36 233	
2.	Dlhopisy oceňované reálnou hodnotou	5	1 216 030	987 199	405 858
a)	bez kupónov	6	-	37 048	
b)	s kupónmi	7	1 216 030	950 151	405 858
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	89 801	118 459	111 563
a)	otvorených podielových fondov	14	89 801	118 459	111 563
b)	ostatné	15	-	-	
5.	Krátkodobé pohľadávky	16	-	100 080	51
a)	krátkodobé vklady v bankách	17	-	100 080	51
b)	krátkodobé pôžičky obchodným spoločnostiam, v ktorých má dôchodkový fond majetkový podiel	18	-	-	
c)	iné	19	-	-	
d)	obrátené repoobchody	20	-	-	
6.	Dlhodobé pohľadávky	21	-	-	84 087
a)	dlhodobé vklady v bankách	22	-	-	84 087
b)	dlhodobé pôžičky obchodným spoločnostiam, v ktorých má dôchodkový fond majetkový podiel	23	-	-	
7.	Deriváty	24	-	-	
8.	Drahé kovy	25	-	-	
II.	Neinvestičný majetok	26	12 145	28 488	10 802
9.	Peňažné prostriedky a ekvivalenty peňažných prostriedkov	27	11 981	28 387	10 802
10.	Ostatný majetok	28	164	101	
Aktíva spolu		29	1 359 013	1 275 357	612 361

I.	Závazky	30	2 498	3 414	1 247
1.	Závazky voči bankám	31	-	-	
2.	Závazky z ukončenia dôchodkového sporenia	32	-	2 987	1 019
3.	Závazky voči dôchodkovej správcovskej spoločnosti	33	632	325	155
4.	Závazky z derivátových operácií	34	-	-	
5.	Závazky z repoobchodov	35	-	-	
6.	Závazky z vypožičania finančného majetku	36	-	-	
7.	Ostatné záväzky	37	1 866	102	73
II.	Vlastné imanie	38	1 356 515	1 271 943	611 114
1.	Dôchodkové jednotky na osobných dôchodkových účtoch sporetelov, z toho	39	1 356 515	1 271 943	611 114
a)	zisk alebo strata za účtovné obdobie	40	35 456	4 025	(3 653)
Pasíva spolu		41	1 359 013	1 275 357	612 361

Výkaz výnosov a nákladov dôchodkového fondu

Označenie	Položka	č.r.	*)		*)
			tis. EUR 1.1.-31.12.2020	tis. EUR 1.1.-31.12.2019	
1.	Výnosy z úrokov	1.	6 883	4 174	2 751
2.	Výnosy z podielových listov	2.	592	112	
3.	Výnosy z dividend a z iných podielov na zisku	3.	-	-	681
4.	Zisk / strata z operácií s cennými papiermi	4.	35 416	3 428	(4 750)
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.	42 891	7 714	(1 318)
9.	Transakčné náklady	10.	-	-	4
10.	Bankové a iné poplatky	11.	500	256	368
II.	Čistý výnos z majetku	12.	42 391	7 458	(1 690)
11.	Náklady na financovanie fondu	13.	-	-	
III.	Čistý zisk / strata zo správy majetku	14.	42 391	7 458	(1 690)
12.	Náklady na odplaty	15.	6 935	3 433	1 963
IV.	Zisk / strata dôchodkového fondu za účtovné obdobie	16.	35 456	4 025	(3 653)