

Ročná správa o hospodárení s majetkom v dôchodkovom fonde

k 31. 12. 2019

Solid – Dlhopisový garantovaný d.f.

NN dôchodková správcovská spoločnosť, a.s.



Hlásenie o najvýznamnejších skutočnostiach dôchodkového fondu

Názov dôchodkového fondu

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

Identifikačný kód

S2203060010

Stav ku dňu

31.12.2019

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

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

Situácia na svetových finančných trhoch v roku 2019 sa tak odrazila aj na výkonnosti fondu Solid - dlhopisového garantovaného d. f. NN dôchodková správcovská spoločnosť, a.s. Pod rast hodnoty dôchodkovej jednotky, ktorý za uplynulý polrok dosiahol +0,88 %, sa podpísali predovšetkým vládne a podnikové dlhopisy, ktorých výnosy výrazne klesli v dôsledku obnovenej aktivity centrálnych bánk. Pozitívny dopad na výkonnosť mali predovšetkým podnikové dlhopisy a vládne dlhopisy mimo jadra eurozóny, ktorých ceny vzrástli najvýraznejšie spomedzi všetkých investícií fondu.

Samotný pokles politického napätia, najmä vďaka deeskalácii americko-čínskej obchodnej vojny, k rastu výnosov dlhopisov stačiť nebude. Kľúčová bude proaktívna politika centrálnych bánk, ktoré majú v tejto chvíli obmedzený manévrovací priestor. V základnom scenári preto očakávame, že výnosy na dlhopisoch ostanú naďalej ukotvené na veľmi nízkych, v mnohých prípadoch záporných, úrovniach. Hlavným dôvodom je naše očakávanie, že ECB zotrvá pri súčasných výrazných stimuloch po celý rok. Priestor pre pokles výnosov však stále vidíme pri dlhopisoch s vyššou rizikovou prirážkou, zvlášť v prípade, ak by mala ECB prekvapiť investorov prípadným rozšírením doterajších menových stimulov pre ekonomiku eurozóny, keďže riziká pre vývoj ekonomiky sú stále viac vychýlené smerom dole.

Názov dôchodkového fondu

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

Identifikačný kód

S2203060010

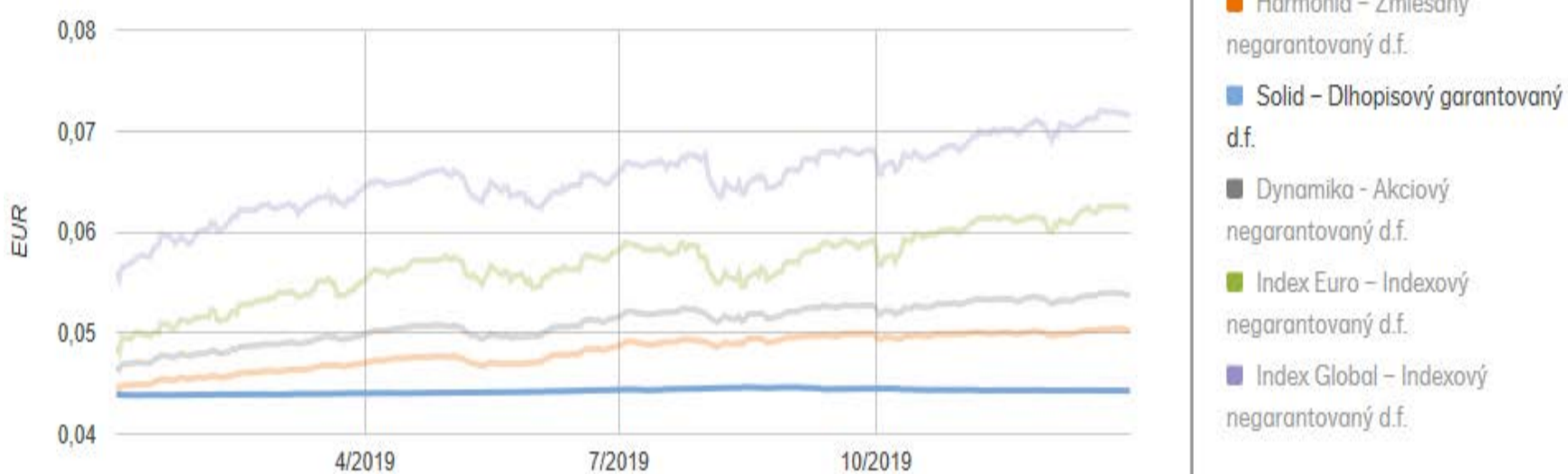
Stav ku dňu

31.12.2019

2. Grafické znázornenie vývoja hodnoty dôchodkovej jednotky

Vývoj hodnoty dôchodkovej jednotky

od 1.1.2019 do 31.12.2019



Hodnota DJ 31.12.2019

0,044284

Názov dôchodkového fondu

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

Identifikačný kód

S2203060010

Stav ku dňu

31.12.2019

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

Spoločnosť NN d.s.s., a.s. vypočítava celkové riziko, ktorému je majetok dôchodkového fondu vystavený, ako trhové riziko. Metóda použitá na výpočet trhového rizika je absolútna hodnota v riziku a je počítaná na 250-dňovom rade pozorovaní hodnôt dôchodkovej jednotky fondu. Na základe predpokladu normálneho rozdelenia zmien dôchodkovej jednotky je vypočítaná hodnota v riziku na 99%-nom jednostrannom intervale spoľahlivosti pre časový horizont 1 dňa. Tento výsledok je následne škálovaný pravidlom druhej odmocniny času na želaný časový horizont. Výsledky a predpoklady výpočtu sú spätne testované porovnaním vypočítanej jednodňovej hodnoty v riziku s následne realizovanou zmenou hodnoty majetku dôchodkového fondu, pričom v prípade, kedy výsledky spätného testovania naznačujú porušenie predpokladov výpočtu je výsledok výpočtu ďalej primerane navýšený. K 31.12.2019 je takto vypočítaná hodnota v riziku pre časový horizont 20 dní na úrovni 0,5% čistej hodnoty majetku v dôchodkovom fonde.

Hlásenie o stave majetku v dôchodkovom фонде

Názov dôchodkového fondu

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

Identifikačný kód

52203060010

Stav ku dňu

31.12.2019

Členenie podľa trhov

Druh majetku	Členenie	Č.r.	Hodnota v tis. eur	Podiel na majetku v dôchodkovom фонде 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 zrejme, že sa toto prijatie uskutoční do jedného roka od dátumu vydania emisie cenných papierov	4		0,0000
Dlhopisy a iné dlhové cenné papiere	Prijaté na obchodovanie na trhu kótovaných cenných papierov burzy cenných papierov	5	1028330,00	80,6308
	Prijaté na obchodovanie na trhu kótovaných cenných papierov zahraničnej burzy cenných papierov so sídlom v členskom štáte	6		0,0000
	Prijaté na obchodovanie na inom regulovanom trhu so sídlom v štáte, ktorý je súčasťou Európskeho hospodárskeho priestoru, a ktorý je uvedený v zozname zverejnenom Európskou komisiou	7		0,0000
	Z nových emisií cenných papierov, ak emisné podmienky obsahujú záväzok, že bude podaná žiadosť o prijatie cenných papierov na obchodovanie na regulovanom trhu a zo všetkých okolností je zrejme, že sa toto prijatie uskutoční do jedného roka od dátumu vydania emisie cenných papierov	8		0,0000
Podielové listy otvorených podielových fondov a cenné papiere zahraničných subjektov kolektívneho investovania podľa § 81 ods. 1 písm. c) zákona	Prijaté na obchodovanie na trhu kótovaných cenných papierov burzy cenných papierov	9		0,0000
	Prijaté na obchodovanie na trhu kótovaných cenných papierov zahraničnej burzy cenných papierov so sídlom v členskom štáte	10	118459,00	9,2883
	Prijaté na obchodovanie na inom regulovanom trhu so sídlom v štáte, ktorý je súčasťou Európskeho hospodárskeho priestoru, a ktorý je uvedený v zozname zverejnenom Európskou komisiou	11		0,0000
	Z nových emisií cenných papierov, ak emisné podmienky obsahujú záväzok, že bude podaná žiadosť o prijatie cenných papierov na obchodovanie na regulovanom trhu a zo všetkých okolností je zrejme, že sa toto prijatie uskutoční do jedného roka od dátumu vydania emisie cenných papierov	12		0,0000
Cenné papiere iných zahraničných subjektov kolektívneho investovania podľa § 81 ods. 1 písm. d) zákona	Prijaté na obchodovanie na trhu kótovaných cenných papierov burzy cenných papierov	13		0,0000
	Prijaté na obchodovanie na trhu kótovaných cenných papierov zahraničnej burzy cenných papierov so sídlom v členskom štáte	14		0,0000
	Prijaté na obchodovanie na inom regulovanom trhu so sídlom v štáte, ktorý je súčasťou Európskeho hospodárskeho priestoru, a ktorý je uvedený v zozname zverejnenom Európskou komisiou	15		0,0000
	Z nových emisií cenných papierov, ak emisné podmienky obsahujú záväzok, že bude podaná žiadosť o prijatie cenných papierov na obchodovanie na regulovanom trhu a zo všetkých okolností je zrejme, že sa toto prijatie uskutoční do jedného roka od dátumu vydania emisie cenných papierov	16		0,0000
Nástroje peňažného trhu podľa § 81 ods. 1 písm. e) zákona	Vydané alebo zaručené Ministerstvom financií SR alebo Národnou bankou Slovenska	17		0,0000
	Vydané alebo zaručené členským štátom a jeho centrálnymi orgánmi	18		0,0000
	Vydané alebo zaručené centrálnou bankou členského štátu	19		0,0000
	Vydané alebo zaručené orgánmi miestnej správy členského štátu	20		0,0000
	Vydané alebo zaručené ECB, EÚ, EIB, IBRD, IFA, CEB, IADB, ADB, AFDB, CDB, NIB, EBRD, EIF, IMF, BIS, MIGA	21		0,0000
	Vydané alebo zaručené emitentom, ktorého cenné papiere boli prijaté na obchodovanie na regulovanom trhu	22		0,0000
	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	28387,00	2,2258
	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	100080,00	7,8472
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 nespĺňali 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	101,00	0,0079	
Hodnota majetku v dôchodkovom фонде	34	1275357,00	100,0000	
Objem záväzkov dôchodkového fondu celkom	35	3414,00	0,2677	
Čistá hodnota majetku v dôchodkovom фонде	36	1271943,00	99,7323	

Názov dôchodkového fondu

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

Identifikačný kód

S2203060010

Stav ku dňu

31.12.2019

Členenie podľa emitentov

čís.r.	Emitenti/Banky	Spolu		Kapitálové CP a obdobné CP		Dlhopisy a iné dlhové CP		PL OPF a CP ZSKI		CP IZSKI		NPT		Peňažné prostriedky na BÚ a VÚ		Pohľadávky a záväzky vznikajúce pri obchodoch určených výlučne na obmedzenie úrokového rizika, menového rizika alebo iného rizika		Iný majetok		Pohľadávky dôchodkového fondu	
		objem v tis. eur	podiel v %	objem v tis. eur	podiel v %	objem v tis. eur	podiel v %	objem v tis. eur	podiel v %	objem v tis. eur	podiel v %	objem v tis. eur	podiel v %	objem v tis. eur	podiel v %	objem v tis. eur	podiel v %	objem v tis. eur	podiel v %	objem v tis. eur	podiel v %
a	b	1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13	14	15	16	17	18	19	20
0	CELKOM	1275357,00	100,00	0,00	0,00	1028330,00	80,63	118459,00	9,29	0,00	0,00	0,00	0,00	128467,00	10,07	0,00	0,00	0,00	0,00	101,00	0,01
1	AEGON BANK	1277,00	0,1001	0,00	0,0000	1277,00	0,1001	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
2	ACHMEA BANK NV	3961,00	0,3106	0,00	0,0000	3961,00	0,3106	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
3	AIR PRODUCTS & CHEMICALS	2523,00	0,1978	0,00	0,0000	2523,00	0,1978	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
4	AMERICAN HONDA FINANCE	3528,00	0,2766	0,00	0,0000	3528,00	0,2766	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
5	ASTRAZENECA PLC	3013,00	0,2362	0,00	0,0000	3013,00	0,2362	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
6	AUCHAN HOLDING SADIR	3099,00	0,2430	0,00	0,0000	3099,00	0,2430	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
7	BANK GOSPODARSTWA KRAJOW	10201,00	0,7999	0,00	0,0000	10201,00	0,7999	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
8	BANK OF CHINA/FRANKFURT	13222,00	1,0367	0,00	0,0000	13222,00	1,0367	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
9	BANK OF NOVA SCOTIA	10099,00	0,7919	0,00	0,0000	10099,00	0,7919	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
10	BERTELSMANN SE & CO KGAA	1712,00	0,1342	0,00	0,0000	1712,00	0,1342	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
11	BMW FINANCE NV	19568,00	1,5343	0,00	0,0000	19568,00	1,5343	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
12	BMW US CAPITAL LLC	5712,00	0,4479	0,00	0,0000	5712,00	0,4479	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
13	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	45829,00	3,5934	0,00	0,0000	45829,00	3,5934	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
14	BP CAPITAL MARKETS PLC	5634,00	0,4418	0,00	0,0000	5634,00	0,4418	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
15	BUONI POLIENNALI DEL TES	21477,00	1,6840	0,00	0,0000	21446,00	1,6816	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	31,00	0,0024
16	CA IMMOBILIEN ANLAGEN AG	2647,00	0,2075	0,00	0,0000	2647,00	0,2075	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
17	CARREFOUR	2075,00	0,1627	0,00	0,0000	2075,00	0,1627	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
18	CESKA EXPORTNI BANKA AS	27051,00	2,1211	0,00	0,0000	27051,00	2,1211	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
19	CESKE DRAHY	13846,00	1,0857	0,00	0,0000	13846,00	1,0857	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
20	CESKO OBCH BANKA(SLOVAK)	8555,00	0,6708	0,00	0,0000	8555,00	0,6708	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
21	CETIN FINANCE BV	3076,00	0,2412	0,00	0,0000	3076,00	0,2412	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
22	CEZ AS	14037,00	1,1006	0,00	0,0000	14037,00	1,1006	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
23	COCA-COLA HBC FINANCE BV	1558,00	0,1222	0,00	0,0000	1558,00	0,1222	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
24	COMMERZBANK AG	3554,00	0,2787	0,00	0,0000	3554,00	0,2787	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
25	CROATIA	519,00	0,0407	0,00	0,0000	519,00	0,0407	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
26	CZECH REPUBLIC	64675,00	5,0711	0,00	0,0000	64675,00	5,0711	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
27	DAIMLER INTL FINANCE BV	11126,00	0,8724	0,00	0,0000	11126,00	0,8724	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
28	DEUTSCHE BK SA ESPANOLA	4781,00	0,3749	0,00	0,0000	4781,00	0,3749	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
29	DEUTSCHE TELEKOM INT FIN	8065,00	0,6324	0,00	0,0000	8065,00	0,6324	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
30	EMERSON ELECTRIC CO	3034,00	0,2379	0,00	0,0000	3034,00	0,2379	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
31	EP INFRASTRUCTURE AS	8761,00	0,6869	0,00	0,0000	8761,00	0,6869	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
32	EQUINOR ASA	517,00	0,0405	0,00	0,0000	517,00	0,0405	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

31.12.2019

Členenie podľa emitentov

čís.r.	Emitenti/Banky	Spolu		Kapitálové CP a obdobné CP		Dlhopisy a iné dlhové CP		PL OPF a CP ZSKI		CP IZSKI		NPT		Peňažné prostriedky na BÚ a VÚ		Pohľadávky a záväzky vznikajúce pri obchodoch určených výlučne na obmedzenie úrokového rizika, menového rizika alebo iného rizika		Iný majetok		Pohľadávky dôchodkového fondu	
		objem v tis. eur	podiel v %	objem v tis. eur	podiel v %	objem v tis. eur	podiel v %	objem v tis. eur	podiel v %	objem v tis. eur	podiel v %	objem v tis. eur	podiel v %	objem v tis. eur	podiel v %	objem v tis. eur	podiel v %	objem v tis. eur	podiel v %	objem v tis. eur	podiel v %
a	b	1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13	14	15	16	17	18	19	20
33	ERSTE GROUP BANK AG	10179,00	0,7981	0,00	0,0000	10179,00	0,7981	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
34	EUROPEAN INVESTMENT BANK	11746,00	0,9210	0,00	0,0000	11746,00	0,9210	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
35	EXPORT-IMPORT BANK CHINA	5541,00	0,4345	0,00	0,0000	5541,00	0,4345	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
36	EXPORT-IMPORT BANK KOREA	53330,00	4,1816	0,00	0,0000	53330,00	4,1816	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
37	GE CAPITAL EURO FUNDING	6998,00	0,5487	0,00	0,0000	6998,00	0,5487	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
38	GENERAL ELECTRIC CO	2758,00	0,2163	0,00	0,0000	2758,00	0,2163	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
39	GLENCORE FINANCE EUROPE	3676,00	0,2882	0,00	0,0000	3676,00	0,2882	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
40	GRENKE FINANCE PLC	3066,00	0,2404	0,00	0,0000	3066,00	0,2404	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
41	HUNGARIAN DEVELOPMENT BA	16370,00	1,2836	0,00	0,0000	16370,00	1,2836	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
42	HUNGARY	1002,00	0,0786	0,00	0,0000	1002,00	0,0786	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
43	CHINA DEVELOPMENT BANK	16223,00	1,2720	0,00	0,0000	16223,00	1,2720	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
44	IBM CORP	8094,00	0,6346	0,00	0,0000	8094,00	0,6346	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
45	ING BANK NV	11608,00	0,9102	0,00	0,0000	11608,00	0,9102	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
46	IRISH TSY 3.9% 2023	11696,00	0,9171	0,00	0,0000	11696,00	0,9171	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
47	iShares Core Euro Corp Bond	21751,00	1,7055	0,00	0,0000	0,00	0,0000	21751,00	1,7055		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
48	iShares Euro Corporate Bond La	47067,00	3,6905	0,00	0,0000	0,00	0,0000	47067,00	3,6905		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
49	ITALGAS SPA	304,00	0,0238	0,00	0,0000	304,00	0,0238	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
50	KAERNTNER ELEKTRIZITAETS	3714,00	0,2912	0,00	0,0000	3714,00	0,2912	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
51	KNORR-BREMSE AG	1210,00	0,0949	0,00	0,0000	1210,00	0,0949	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
52	LB BADEN-WUERTTENBERG	6884,00	0,5398	0,00	0,0000	6884,00	0,5398	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
53	LINDE FINANCE BV	4041,00	0,3169	0,00	0,0000	4041,00	0,3169	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
54	LITHUANIA GOVERNMENT BOND	12260,00	0,9613	0,00	0,0000	12260,00	0,9613	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
55	LOGICOR FINANCING SARL	2021,00	0,1585	0,00	0,0000	2021,00	0,1585	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
56	LUMINOR BANK ESTONIA	1531,00	0,1200	0,00	0,0000	1531,00	0,1200	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
57	Lyxor Barclays Floating Rate E	49641,00	3,8923	0,00	0,0000	0,00	0,0000	49641,00	3,8923		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
58	MET LIFE GLOB FUNDING I	4039,00	0,3167	0,00	0,0000	4039,00	0,3167	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
59	MIZUHO FINANCIAL GROUP	8195,00	0,6426	0,00	0,0000	8195,00	0,6426	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
60	MUENCHENER HYPOTHEKENBNK	4041,00	0,3169	0,00	0,0000	4041,00	0,3169	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
61	NET4GAS SRO	7893,00	0,6189	0,00	0,0000	7893,00	0,6189	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
62	NYKREDIT REALKREDIT AS	13160,00	1,0319	0,00	0,0000	13160,00	1,0319	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
63	OBERBANK AG	7062,00	0,5537	0,00	0,0000	7062,00	0,5537	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
64	OBRIGACOES DO TESOURO	25754,00	2,0194	0,00	0,0000	25754,00	2,0194	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
65	OMV AG	14053,00	1,1019	0,00	0,0000	14053,00	1,1019	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
66	PKO BANK HIPOTECZNY	10441,00	0,8187	0,00	0,0000	10441,00	0,8187	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

31.12.2019

Členenie podľa emitentov

čís.r.	Emitenti/Banky	Spolu		Kapitálové CP a obdobné CP		Dlhopisy a iné dlhové CP		PL OPF a CP ZSKI		CP IZSKI		NPT		Peňažné prostriedky na BÚ a VÚ		Pohľadávky a záväzky vznikajúce pri obchodoch určených výlučne na obmedzenie úrokového rizika, menového rizika alebo iného rizika		Iný majetok		Pohľadávky dôchodkového fondu	
		objem v tis. eur	podiel v %	objem v tis. eur	podiel v %	objem v tis. eur	podiel v %	objem v tis. eur	podiel v %	objem v tis. eur	podiel v %	objem v tis. eur	podiel v %	objem v tis. eur	podiel v %	objem v tis. eur	podiel v %	objem v tis. eur	podiel v %	objem v tis. eur	podiel v %
a	b	1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13	14	15	16	17	18	19	20
67	RAIFFEISEN BANK INTL	10066,00	0,7893	0,00	0,0000	10066,00	0,7893	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
68	Republic of Ireland	5919,00	0,4641	0,00	0,0000	5919,00	0,4641	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
69	REPUBLIC OF LATVIA	21306,00	1,6706	0,00	0,0000	21306,00	1,6706	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
70	REPUBLIC OF POLAND	61144,00	4,7943	0,00	0,0000	61144,00	4,7943	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
71	REPUBLIKA SLOVENIJA	8457,00	0,6631	0,00	0,0000	8457,00	0,6631	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
72	RLB OBEROESTERREICH	11948,00	0,9368	0,00	0,0000	11948,00	0,9368	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
73	ROMANIA	45884,00	3,5977	0,00	0,0000	45884,00	3,5977	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
74	SANOFI	7143,00	0,5601	0,00	0,0000	7143,00	0,5601	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
75	SANTAN CONSUMER FINANCE	2708,00	0,2123	0,00	0,0000	2708,00	0,2123	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
76	SHELL INTERNATIONAL FIN	3121,00	0,2447	0,00	0,0000	3121,00	0,2447	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
77	SID BANKA EXPORT AND DEV	3058,00	0,2398	0,00	0,0000	3058,00	0,2398	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
78	SIEMENS FINANCIERINGSMAT	1727,00	0,1354	0,00	0,0000	1727,00	0,1354	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
79	SIKA CAPITAL BV	3310,00	0,2595	0,00	0,0000	3310,00	0,2595	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
80	SLOVAKIA GOVERNMENT BOND	59866,00	4,6941	0,00	0,0000	59866,00	4,6941	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
81	SLOVENSKA SPORITELNA AS	47666,00	3,7375	0,00	0,0000	19279,00	1,5117	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	28387,00	2,2258		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
82	SOCIETE GENERALE	5135,00	0,4026	0,00	0,0000	5135,00	0,4026	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
83	SPP DISTRIBUCIA AS	23235,00	1,8218	0,00	0,0000	23235,00	1,8218	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
84	SPP INFRASTRUCTURE FIN	11461,00	0,8987	0,00	0,0000	11461,00	0,8987	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
85	TAKEDA PHARMACEUTICAL	2042,00	0,1601	0,00	0,0000	2042,00	0,1601	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
86	TATRA BANKA	43095,00	3,3791	0,00	0,0000	8091,00	0,6344	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	35004,00	2,7446		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
87	TORONTO-DOMINION BANK	5052,00	0,3961	0,00	0,0000	5052,00	0,3961	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
88	TOYOTA FINANCE AUSTRALIA	3536,00	0,2773	0,00	0,0000	3536,00	0,2773	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
89	UNICREDIT BANK CZECH RE	3876,00	0,3039	0,00	0,0000	3876,00	0,3039	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
90	VERIZON COMMUNICATIONS	5071,00	0,3976	0,00	0,0000	5071,00	0,3976	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
91	VOLKSWAGEN INTL FIN NV	5553,00	0,4354	0,00	0,0000	5553,00	0,4354	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
92	VOLKSWAGEN LEASING GMBH	1514,00	0,1187	0,00	0,0000	1514,00	0,1187	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
93	VSEOBECNA UVEROVA BANKA	110033,00	8,6276	0,00	0,0000	44887,00	3,5196	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	65076,00	5,1026		0,0000		0,0000	70,00	0,0055
94	WELLS FARGO & COMPANY	8028,00	0,6295	0,00	0,0000	8028,00	0,6295	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
95	WESTPAC SEC NZ/LONDON	6020,00	0,4720	0,00	0,0000	6020,00	0,4720	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
96	ZAPADOSLOVENSKA ENRG AS	12302,00	0,9646	0,00	0,0000	12302,00	0,9646	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

31.12.2019

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	1275357,00	100,00	0,00	0,00	1028330,00	80,63	118459,00	9,29	0,00	0,00	0,00	0,00	128467,00	10,07	0,00	0,00	0,00	0,00	101,00	0,01
1	0899	3676,00	0,2882	0,00	0,0000	3676,00	0,2882	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
2	1107	1558,00	0,1222	0,00	0,0000	1558,00	0,1222	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
3	1920	23325,00	1,8289	0,00	0,0000	23325,00	1,8289	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
4	2059	6564,00	0,5147	0,00	0,0000	6564,00	0,5147	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
5	2120	12198,00	0,9564	0,00	0,0000	12198,00	0,9564	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
6	2361	3310,00	0,2595	0,00	0,0000	3310,00	0,2595	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
7	2790	7519,00	0,5896	0,00	0,0000	7519,00	0,5896	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
8	2932	1210,00	0,0949	0,00	0,0000	1210,00	0,0949	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
9	3511	38814,00	3,0434	0,00	0,0000	38814,00	3,0434	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
10	3522	42893,00	3,3632	0,00	0,0000	42893,00	3,3632	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
11	4729	5174,00	0,4057	0,00	0,0000	5174,00	0,4057	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
12	4920	13846,00	1,0857	0,00	0,0000	13846,00	1,0857	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
13	5911	1712,00	0,1342	0,00	0,0000	1712,00	0,1342	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
14	6120	16211,00	1,2711	0,00	0,0000	16211,00	1,2711	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
15	6209	8094,00	0,6346	0,00	0,0000	8094,00	0,6346	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
16	6430	118459,00	9,2883	0,00	0,0000	0,00	0,0000	118459,00	9,2883		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
17	6491	1514,00	0,1187	0,00	0,0000	1514,00	0,1187	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
18	6499	571781,00	44,8330	0,00	0,0000	443244,00	34,7545	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	128467,00	10,0730		0,0000		0,0000	70,00	0,0055
19	6511	4039,00	0,3167	0,00	0,0000	4039,00	0,3167	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
20	6820	4668,00	0,3660	0,00	0,0000	4668,00	0,3660	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000
21	8411	388792,00	30,4850	0,00	0,0000	388761,00	30,4825	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	0,00	0,0000		0,0000		0,0000	31,00	0,0024

Názov dôchodkového fondu

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

Identifikačný kód

S2203060010

Stav ku dňu

31.12.2019

Členenie podľa menového hľadiska

č.r.	Mena	Zostatková fixácia úrokových mier	Spolu		Kapitálové CP a obdobné CP		Dlhopisy a iné dlhové CP		PL OPF a CP ZSKI		CP IZSKI		NPT		Peňažné prostriedky na BÚ a VÚ		Pohľadávky a záväzky vznikajúce pri obchodoch určených výlučne na obmedzenie úrokového rizika, menového rizika alebo iného rizika			Iný majetok		Pohľadávky dôchodkového fondu	
			objem v tis. eur	podiel v %	objem v tis. eur	podiel v %	objem v tis. eur	podiel v %	objem v tis. eur	podiel v %	objem v tis. eur	podiel v %	objem v tis. eur	podiel v %	objem v tis. eur	podiel v %	objem v tis. eur	podiel v %	reálna hodnota v tis. eur	hodnota podkladového nástroja v tis.	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		1275357,00	100,0000	0,00	0,0000	1028330,00	80,6308	118459,00	9,2883	0,00	0,0000	0,00	0,0000	128467,00	10,0730	0,00	0,00	0,0000	0,00	0,0000	101,00	0,0079
0b	CELKOM USD		0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000
0c	CELKOM CZK		0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000
0d	CELKOM HUF		0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000
0e	CELKOM PLN		0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000
0f	CELKOM JPY		0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000
0g	CELKOM OSTATNE		0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000
1	EUR	M1	35486,00	2,7824	0,00	0,0000	6998,00	0,5487	0,00	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	28387,00	2,2258			0,00		0,00	101,0000	0,01
2	EUR	O1M3M	22050,00	1,7289	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,00	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	22050,00	1,7289			0,00		0,00	0,0000	0,00
3	EUR	O3M6M	26218,00	2,0557	0,00	0,0000	14206,00	1,1139	0,00	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	12012,00	0,9419			0,00		0,00	0,0000	0,00
4	EUR	6M1R	85189,00	6,6796	0,00	0,0000	19171,00	1,5032	0,00	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	66018,00	5,1764			0,00		0,00	0,0000	0,00
5	EUR	R1PR3	428847,00	33,6256	0,00	0,0000	428847,00	33,6256	0,00	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,00	0,0000			0,00		0,00	0,0000	0,00
6	EUR	R3PR5	351412,00	27,5540	0,00	0,0000	351412,00	27,5540	0,00	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,00	0,0000			0,00		0,00	0,0000	0,00
7	EUR	R5PR10	207696,00	16,2853	0,00	0,0000	207696,00	16,2853	0,00	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,00	0,0000			0,00		0,00	0,0000	0,00
8	EUR	NA	118459,00	9,2883	0,00	0,0000	0,00	0,0000	118459,00	9,2883	0,0000	0,0000	0,0000	0,0000	0,00	0,0000			0,00		0,00	0,0000	0,00

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

31.12.2019

Počet sporiteľov spolu	Objem príspevkov v eurách spolu	Objem penále v eurách spolu	Počet sporiteľov podľa pohlavia		Počet sporiteľov podľa spôsobu prispievania		Zmena stavov sporiteľov				
			muži	ženy	aktívny	pasívny	medzi DF vrámci DSS		z DSS do inej DSS		úmrtia
							prírastky	úbytky	prírastky	úbytky	
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12
229 131	63 222 691	1 082	118 488	110 643	160 936	68 195	11 421	11 880	1 899	5 096	227

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

31.12.2019

Označenie	Položka	č. r.	Hodnota v tis. eur
a	b	c	1
1.	Závazky	1	3414
a)	záväzky voči bankám	2	0
b)	záväzky z ukončenia dôchodkového sporenia	3	2987
c)	záväzky voči dôchodkovej správcovskej spoločnosti	4	325
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	102
2.	Vlastné imanie	9	1271942
a)	dôchodkové jednotky na osobných dôchodkových účtoch sporeiteľov	10	1267917
b)	zisk alebo strata za účtovné obdobie	11	4025
3.	Pasíva spolu	12	1275356

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

31.12.2019

Označenie	Položka	č. r.	Hodnota v tis. eur
a	b	c	1
1.	Výnosy z úrokov a obdobné výnosy	1	4173
a)	z peňažných prostriedkov na bežnom účte	2	0
b)	z peňažných prostriedkov na vkladovom účte	3	77
c)	z dlhopisov a obdobných dlhových cenných papierov	4	4096
d)	z nástrojov peňažného trhu	5	0
2.	Výnosy z podielových listov a obdobné výnosy	6	112
3.	Výnosy z dividend a iných podielov na zisku	7	0
4.	Výnosy z operácií s cennými papiermi a podielmi	8	11817
a)	z kapitálových cenných papierov a obdobných cenných papierov	9	0
b)	z dlhopisov a iných dlhových cenných papierov	10	11718
c)	z nástrojov peňažného trhu	11	0
d)	z podielových listov a obdobných cenných papierov	12	99
5.	Náklady na operácie s cennými papiermi a podielmi	13	8389
a)	kapitálové cenné papiere a obdobné cenné papiere	14	0
b)	dlhopisy a iné dlhové cenné papiere	15	8046
c)	nástroje peňažného trhu	16	0
d)	podielové listy a obdobné cenné papiere	17	343
6.	Zisk/strata z operácií s cennými papiermi a podielmi	18	3428
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	7713
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	256
a)	bankové odplaty a poplatky	28	256
b)	burzové odplaty a poplatky	29	0
II.	Čistý výnos z majetku vo fonde	30	7457
13.	Náklady na financovanie dôchodkového fondu	31	0
III.	Čistý zisk/strata zo správy majetku	32	7457
14.	Iné výnosy	33	0
15.	Náklady na odplaty	34	3432
a)	náklady na odplatu za správu DF	35	2173
b)	náklady na odplatu za zhodnotenie majetku v DF	36	1259
c)	náklady na iné odplaty	37	0
IV.	Zisk/strata dôchodkového fondu za účtovné obdobie	38	4025

Skrátená verzia ročnej správy o hospodárení s majetkom v dôchodkovom fonde

Názov dôchodkového fondu

Stav ku dňu

SOLID - Dlhopisový garantovaný dôchodkový fond NN dôchodková správcovská spoločnosť, a.s.

31.12.2019

*) údaje za fond Tradícia - Dlhopisový garantovaný dôchodkový fond NN d.s.s.,a.s.

fond SOLID vznikol 1.11.2019 integráciou fondov Tradícia - Dlhopisového garantovaného dôchodkového fondu NN d.s.s, a.s. s fondom SOLID - Dlhopisovým garantovaným dôchodkovým fondom AEGON d.s.s, a.s.

Výkaz aktív a pasív dôchodkového fondu

Označenie	Položka	č.r.	V tis. EUR 31.12.2019	V tis. EUR 31.12.2018	V tis. EUR 31.12.2017
I.	Investičný majetok	1	1 246 869	601 559	573 068
1.	Dlhopisy oceňované umorovanou hodnotou	2	-		
a)	bez kupónov	3	-		
b)	s kupónmi	4	-		
2.	Dlhopisy oceňované reálnou hodnotou	5	1 028 330	405 858	412 127
a)	bez kupónov	6	-		
b)	s kupónmi	7	1 028 330	405 858	412 127
3.	Akcie a podiely v obchodných spoločnostiach	8	-		
a)	obchodovateľné	9	-		
b)	neobchodovateľné	10	-		
c)	podieľ v obchodných spoločnostiach, ktoré nemajú formu cenného papiera	11	-		
d)	obstaranie neobchodovateľných akcií a podielov v obchodných spoločnostiach	12	-		
4.	Podielové listy	13	118 459	111 563	98 836
a)	otvorených podielových fondov	14	118 459	111 563	98 836
b)	ostatné	15	-		
5.	Krátkodobé pohľadávky	16	100 080	51	18
a)	krátkodobé vklady v bankách	17	100 080	51	18
b)	krátkodobé pôžičky obchodným spoločnostiam, v ktorých má dôchodkový fond majetkový podiel	18	-		
c)	iné	19	-		
d)	obrátené repoobchody	20	-		
6.	Dlhodobé pohľadávky	21	-	84 087	62 087
a)	dlhodobé vklady v bankách	22	-	84 087	62 087
b)	dlhodobé pôžičky obchodným spoločnostiam, v ktorých má dôchodkový fond majetkový podiel	23	-		
7.	Deriváty	24	-		
8.	Drahé kovy	25	-		
II.	Neinvestičný majetok	26	28 488	10 802	28 619
9.	Peňažné prostriedky a ekvivalenty peňažných prostriedkov	27	28 387	10 802	28 619
10.	Ostatný majetok	28	101		
	Aktíva spolu	29	1 275 357	612 361	601 687

I.	Záväzky	30	3 414	1 247	1 476
1.	Záväzky voči bankám	31	-		
2.	Záväzky z ukončenia dôchodkového sporenia	32	2 987	1 019	1 251
3.	Záväzky voči dôchodkovej správcovskej spoločnosti	33	325	155	153
4.	Záväzky z derivátových operácií	34	-		
5.	Záväzky z repoobchodov	35	-		
6.	Záväzky z vypožičania finančného majetku	36	-		
7.	Ostatné záväzky	37	102	73	72
II.	Vlastné imanie	38	1 271 943	611 114	600 211
1.	Dôchodkové jednotky na osobných dôchodkových účtoch sporiteľov, z toho	39	1 271 943	611 114	600 211
a)	zisk alebo strata za účtovné obdobie	40	4 025	(3 653)	2 244
	Pasíva spolu	41	1 275 357	612 361	601 687

Výkaz výnosov a nákladov dôchodkového fondu

Označenie	Položka	č.r.	V tis. EUR 1.1.-31.12.2019	V tis. EUR 1.1.-31.12.2018	V tis. EUR 1.1.-31.12.2017
1.	Výnosy z úrokov	1.	4 174	2 751	3 103
2.	Výnosy z podielových listov	2.	112		
3.	Výnosy z dividend a z iných podielov na zisku	3.	-	681	747
4.	Zisk / strata z operácií s cennými papiermi	4.	3 428	(4 750)	772
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.	7 714	(1 318)	4 622
9.	Transakčné náklady	10.	-	4	11
10.	Bankové a iné poplatky	11.	256	368	368
II.	Čistý výnos z majetku	12.	7 458	(1 690)	4 243
11.	Náklady na financovanie fondu	13.	-		
III.	Čistý zisk / strata zo správy majetku	14.	7 458	(1 690)	4 243
12.	Náklady na odplaty	15.	3 433	1 963	1 999
IV.	Zisk / strata dôchodkového fondu za účtovné obdobie	16.	4 025	(3 653)	2 244