

Polročná správa o hospodárení s majetkom v doplnkovom dôchodkovom fonde k 30. 06. 2020

Indexový príspevkový d.d.f. NN Tatry – Sympatia, d.d.s., a.s.

NN Tatry – Sympatia d.d.s., a.s.



Hlásenie o najvýznamnejších skutočnostiach doplnkového dôchodkového fondu

Názov doplnkového dôchodkového fondu

Indexový príspevkový d.d.f. NN Tatry - Sympatia, d.d.s., a.s.

Identifikačný kód

S1005180001

Stav ku dňu

30.6.2020

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

V dôsledku pandémie vírusu Covid-19 bol prvý polrok tohto roka pre kapitálové trhy jedným z najhektickejších v histórii. Úrokové sadzby štátnych dlhopisov poklesli, ťažko boli zasiahnuté rizikovejšie triedy aktív a volatilita dosahovala rekordných úrovní. Nečakaný vývoj pokračoval aj v druhom štvrtroku. Kým medzi 21. februárom a 23. marcom sme boli svedkami historicky najprudkejšieho poklesu trhov, v druhom štvrtroku sme zažili najrýchlejšie zotavenie. Pozitívny sentiment investorov bol podporený tiež bezprecedentnými fiškálnymi a monetárnymi stimulmi v Európe i USA. Na konci júna začali trhy mierne kolísať kvôli zhoršujúcej sa dynamike šírenia Covidu-19 v rade rozvíjajúcich sa krajín a na juhu USA. Kľúčovou otázkou zostáva, ako rýchlo sa trhy vrátia na svoje predkrízové úrovne a či bude budúci rast udržateľný. To všetko bude závisieť od vývoja epidemiologickej situácie a ochoty centrálnych bankárov a politikov ešte viac podporiť ekonomiku. Čínska priemyselná aktivita sa už vrátila na svoju pôvodnú úroveň. To sa však nedá povedať o Latinskej Amerike, Strednom východe, Afrike a značnej časti južnej Ázie, kde denné prírastky nakazených zostávajú vysoké.

Situácia na svetových finančných trhoch v roku 2019 sa kladne odrazila na výkonnosti Indexového príspevkového d.d.f. NN Tatry - Sympatia, d.d.s., a.s. Pod pokles hodnoty dôchodkovej jednotky, ktorý od začiatku roku dosiahol -6,85 %, sa podpísal predovšetkým pokles globálnych akcií, keďže akciové investície tvoria významnú časť portfólia indexového fondu, spravidla 90 až 100%.

Kvôli neistote ohľadom vývoja šírenia Covidu-19 a nadchádzajúcim voľbám v USA zostávame opatrní. Rýchlosť zotavenia akciových trhov sa bude odvíjať od zdravotnej situácie vo svete. Aj keby už nedošlo k ďalšiemu plošnému sprísneniu vládnych opatrení, domácnosti a firmy môžu zmeniť svoje zvyklosti a pristúpiť na podobné opatrenia zo svojej vlastnej vôle. To môže ohroziť optimistický scenár, v ktorý investori dúfajú. Ďalší vývoj je potrebné starostlivo sledovať, pretože zotavenie je veľmi pravdepodobné, ale nie je isté. Napríklad finančný sektor zápasí s nízkymi sadzbami a oneskorenými splátkami hypoték. Skutočné dopady koronakrízy budú známe až s odstupom času. Náš výhľad pre akciovú triedu aktív je preto neutrálny.

2. Grafické znázornenie vývoja hodnoty doplnkovej dôchodkovej jednotky

Vývoj hodnoty dôchodkovej jednotky

od 1.1.2020 do 30.6.2020



Hodnota DJ 30.6.2020

0,033267

Hlásenie o stave majetku v doplnkovom dôchodkovom fonde

Názov doplnkového dôchodkového fondu

Indexový príspevkový d.d.f. NN Tatry - Sympatia, d.d.s., a.s.

Identifikačný kód

S1005180001

Stav ku dňu

30.06.2020

Členenie podľa trhov

Druh majetku	Členenie	č.r.	Hodnota v tis. eur	Podiel na majetku v doplnkovom dôchodkovom fonde v %
a	b	c	1	2
Akcie	prijaté na obchodovanie na regulovanom trhu	1	0,00	0,00
	prijaté na obchodovanie na inom regulovanom trhu	2		0,00
	prijaté na obchodovanie na trhu kótovaných cenných papierov zahraničnej burzy cenných papierov alebo na inom regulovanom trhu v nečlenskom štáte	3		0,00
	z nových emisií cenných papierov	4		0,00
Dlhové cenné papiere	prijaté na obchodovanie na regulovanom trhu	5	0,00	0,00
	prijaté na obchodovanie na inom regulovanom trhu	6		0,00
	prijaté na obchodovanie na trhu kótovaných cenných papierov zahraničnej burzy cenných papierov alebo na inom regulovanom trhu v nečlenskom štáte	7		0,00
	z nových emisií cenných papierov	8		0,00
Nástroje peňažného trhu	prijaté na obchodovanie na regulovanom trhu	9		0,00
	Prijaté na obchodovanie na inom regulovanom trhu	10		0,00
	prijaté na obchodovanie na trhu kótovaných cenných papierov zahraničnej burzy cenných papierov alebo na inom regulovanom trhu v nečlenskom štáte	11		0,00
	z nových emisií cenných papierov	12		0,00
Podielové listy a cenné papiere	štandardných podielových fondov	13	21 848,00	90,09
	európskych štandardných fondov	14		0,00
	špeciálnych podielových fondov	15	2 041,00	8,42
	zahraničných subjektov kolektívneho investovania	16		0,00
	iných subjektov kolektívneho investovania	17		0,00
Prevoditeľné cenné papiere a nástroje peňažného trhu	neprijaté na obchodovanie na regulovanom trhu podľa § 53b ods. 5 zákona	18		0,00
Vklady na bežných účtoch a na vkladových účtoch	splatné na požiadanie alebo s lehotou splatnosti do 12 mesiacov v bankách so sídlom na území SR alebo zahraničných bankách so sídlom v členskom štáte alebo nečlenskom štáte	19	363,00	1,50
Finančné deriváty, ktorých podkladovým nástrojom sú prevoditeľné cenné	obchodované na regulovanom trhu	20		0,00
	uzatvárané mimo regulovaného trhu	21		0,00
Finančné deriváty, ktorých podkladovým aktívom sú komodity alebo komoditné indexy	obchodované na regulovanom trhu	22		0,00
	obchodované na komoditnej burze	23		0,00
	obchodované na inom regulovanom komoditnom trhu so sídlom v členskom štáte	24	0,00	0,00
Cenné papiere z nových emisií	neprijaté na obchodovanie do jedného roka od dátumu vydania emisie	25		0,00
Iný majetok		26		0,00
Objem pohľadávok doplnkového dôchodkového fondu celkom		27	0,00	0,00
Hodnota majetku v doplnkovom dôchodkovom fonde		28	24 252,00	100,00
Objem záväzkov doplnkového dôchodkového fondu celkom		29	40,00	0,16
Čistá hodnota majetku v doplnkovom dôchodkovom fonde		30	24 212,00	99,84

Dfo (HMF) 11-02

Názov doplnkového dôchodkového fondu

Indexový príspevkový d.d.f. NN Tatry - Sympatia, d.d.s., a.s.

Identifikačný kód

S1005180001

Stav ku dňu

30.06.2020

Členenie podľa emitentov

čís.r.	Emitenti/Banky	Spolu		Akcie		Dlhové CP		NPT		PL a CP		Prevoditeľné CP a NPT		vklady na BÚ a VÚ		Finančné deriváty		Iný majetok		Pohľadávky doplnkového 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	24 252,00	100,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	23 889,00	98,50	0,00	0,00	363,00	1,50	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
1	Amundi Euro Stoxx 50 UCITS DR	461,00	1,90	0,00	0,00	0,00	0,00		0,00	461,00	1,90		0,00	0,00	0,00	0,00	0,00		0,00	0,00	0,00
2	db x-trackers - DJ EURO STOXX	1 223,00	5,04	0,00	0,00	0,00	0,00		0,00	1 223,00	5,04		0,00	0,00	0,00	0,00	0,00		0,00	0,00	0,00
3	db x-trackers S&P 500 UCITS ET	2 315,00	9,55	0,00	0,00	0,00	0,00		0,00	2 315,00	9,55		0,00	0,00	0,00	0,00	0,00		0,00	0,00	0,00
4	DBX S&P500 EUR-HEDGED	1 134,00	4,68	0,00	0,00	0,00	0,00		0,00	1 134,00	4,68		0,00	0,00	0,00	0,00	0,00		0,00	0,00	0,00
5	Euro STOXX 50 THEAM ACT EUR	521,00	2,15	0,00	0,00	0,00	0,00		0,00	521,00	2,15		0,00	0,00	0,00	0,00	0,00		0,00	0,00	0,00
6	Invesco EURO STOXX 50 UCITS ET	3 103,00	12,79	0,00	0,00	0,00	0,00		0,00	3 103,00	12,79		0,00	0,00	0,00	0,00	0,00		0,00	0,00	0,00
7	ISHARES DAX DE	1 101,00	4,54	0,00	0,00	0,00	0,00		0,00	1 101,00	4,54		0,00	0,00	0,00	0,00	0,00		0,00	0,00	0,00
8	iShares II plc - iShares DJ Eu	654,00	2,70	0,00	0,00	0,00	0,00		0,00	654,00	2,70		0,00	0,00	0,00	0,00	0,00		0,00	0,00	0,00
9	iShares MSCI Emerging Markets	893,00	3,68	0,00	0,00	0,00	0,00		0,00	893,00	3,68		0,00	0,00	0,00	0,00	0,00		0,00	0,00	0,00
10	ISHARES S&P 500 EUR-HEDGED	809,00	3,34	0,00	0,00	0,00	0,00		0,00	809,00	3,34		0,00	0,00	0,00	0,00	0,00		0,00	0,00	0,00
11	iShares S&P 500 Index Fund/US	1 148,00	4,73	0,00	0,00	0,00	0,00		0,00	1 148,00	4,73		0,00	0,00	0,00	0,00	0,00		0,00	0,00	0,00
12	Lyxor S&P 500 UCITS ETF	1 078,00	4,45	0,00	0,00	0,00	0,00		0,00	1 078,00	4,45		0,00	0,00	0,00	0,00	0,00		0,00	0,00	0,00
13	SOURCE S&P 500 EUR HEDGED	3 226,00	13,30	0,00	0,00	0,00	0,00		0,00	3 226,00	13,30		0,00	0,00	0,00	0,00	0,00		0,00	0,00	0,00
14	Vanguard S&P 500 UCITS ETF	1 853,00	7,64	0,00	0,00	0,00	0,00		0,00	1 853,00	7,64		0,00	0,00	0,00	0,00	0,00		0,00	0,00	0,00
15	VSEOBECNA UVEROVA BANKA	363,00	1,50	0,00	0,00	0,00	0,00		0,00	0,00	0,00		0,00	363,00	1,50	0,00	0,00		0,00	0,00	0,00
16	Xtrackers MSCI Emerging Market	1 609,00	6,63	0,00	0,00	0,00	0,00		0,00	1 609,00	6,63		0,00	0,00	0,00	0,00	0,00		0,00	0,00	0,00
17	Xtrackers Nikkei 225 UCITS ETF	2 761,00	11,38	0,00	0,00	0,00	0,00		0,00	2 761,00	11,38		0,00	0,00	0,00	0,00	0,00		0,00	0,00	0,00

Dfo (HMF) 11-02

Názov doplnkového dôchodkového fondu

Indexový príspevkový d.d.f. NN Tatry - Sympatia, d.d.s., a.s.

Identifikačný kód

S1005180001

Stav ku dňu

30.06.2020

Členenie podľa geografického hľadiska

č.r.	Štáty	Spolu		Akcie		Dlhové CP		NPT		PL a CP		Prevoditeľné CP a NPT		vklady na BÚ a VÚ		Finančné deriváty		Iný majetok		Pohľadávky doplnkového dôchodkového fondu	
		objem v tis. eur	podiel v %	objem v tis. eur	podiel v %	objem v tis. eur	podiel v %	objem v tis. eur	podiel v %	objem v tis. eur	podiel v %	objem v tis. eur	podiel v %	objem v tis. eur	podiel v %	reálna hodnota v tis. eur	podiel v %	objem v tis. eur	podiel v %	objem v tis. eur	podiel v %
a	b	1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13	14	15	16	17	18	19	20
1a	Členské štáty	24 252,00	100,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	23 889,00	98,50	0,00	0,00	363,00	1,50	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
1b	Nečlenské štáty	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	
1	CELKOM	24 252,00	100,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	23 889,00	98,50	0,00	0,00	363,00	1,50	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
2	DE	1 102,00	4,54	0,00	0,00	0,00	0,00		0,00	1 102,00	4,54		0,00	0,00	0,00	0,00	0,00		0,00	0,00	
3	FR	521,00	2,15	0,00	0,00	0,00	0,00		0,00	521,00	2,15		0,00	0,00	0,00	0,00	0,00		0,00	0,00	
4	IE	12 387,00	51,08	0,00	0,00	0,00	0,00		0,00	12 387,00	51,08		0,00	0,00	0,00	0,00	0,00		0,00	0,00	
5	LU	7 839,00	32,32	0,00	0,00	0,00	0,00		0,00	7 839,00	32,32		0,00	0,00	0,00	0,00	0,00		0,00	0,00	
6	SK	363,00	1,50	0,00	0,00	0,00	0,00		0,00	0,00	0,00		0,00	363,00	1,50	0,00	0,00		0,00	0,00	
7	US	2 040,00	8,41	0,00	0,00	0,00	0,00		0,00	2 040,00	8,41		0,00	0,00	0,00	0,00	0,00		0,00	0,00	

Dfo (HMF) 11-02

Názov doplnkového dôchodkového fondu

Indexový príspevkový d.d.f. NN Tatry - Sympatia, d.d.s., a.s.

Identifikačný kód

S1005180001

Stav ku dňu

30.06.2020

Členenie podľa menového hľadiska

čís.r.	Mena	Zostatková fixácia úrokových mier	Spolu		Akcie		Dlhové CP		NPT		PL a CP		Prevoditeľné CP a NPT		vklady na BÚ a VÚ		Finančné deriváty			Iný majetok		Pohľadávky doplnkového dôchodkového fondu		
			objem v tis. eur	podiel v %	objem v tis. eur	podiel v %	objem v tis. eur	podiel v %	objem v tis. eur	podiel v %	objem v tis. eur	podiel v %	objem v tis. eur	podiel v %	objem v tis. eur	podiel v %	objem v tis. eur	podiel v %	reálna hodnota v tis. eur	hodnota podkladového nástroja v tis. eur	podiel v %	objem v tis. eur	podiel v %	objem v tis. eur
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		18 017,00	74,29	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	17 680,00	72,90	0,00	0,00	337,00	1,39	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
0b	CELKOM USD		6 235,00	25,71	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	6 209,00	25,60	0,00	0,00	26,00	0,11	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
0c	CELKOM CZK		0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
0d	CELKOM HUF		0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
0e	CELKOM PLN		0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
0f	CELKOM JPY		0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
0g	CELKOM OSTATNÉ		0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
1	EUR	M1	337,00	1,39	0,00	0,00	0,00	0,00		0,00	0,00	0,00		0,00	337,00	1,39	0,00		0,00		0,00		0,00	0,00
2	EUR	NA	17 680,00	72,90	0,00	0,00	0,00	0,00		0,00	17 680,00	72,90		0,00	0,00	0,00	0,00		0,00		0,00		0,00	0,00
3	JPY	M1	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00		0,00	0,00	0,00		0,00	0,00	0,00	0,00		0,00		0,00		0,00	0,00
4	USD	M1	26,00	0,11	0,00	0,00	0,00	0,00		0,00	0,00	0,00		0,00	26,00	0,11	0,00		0,00		0,00		0,00	0,00
5	USD	NA	6 209,00	25,60	0,00	0,00	0,00	0,00		0,00	6 209,00	25,60		0,00	0,00	0,00	0,00		0,00		0,00		0,00	0,00

Dfo (PU) 47-02

Hlásenie o vývoji počtu účastníkov a poberateľov dávok

Názov doplnkového dôchodkového fondu

Indexový príspevkový d.d.f. NN Tatry - Sympatia, d.d.s., a.s.

Identifikačný kód

S1005180001

Stav ku dňu

30.06.2020

Počet účastníkov/ poberateľov dávok	Objem príspevkov/ vyplatených dávok v eurách spolu	Počet účastníkov/poberateľov dávok podľa pohlavia		Počet účastníkov/poberateľov dávok podľa veku								Počet účastníkov/poberateľov dávok podľa spôsobu prispievania/poberania dávok	
		muži	ženy	18-25 vrátane	26-30 vrátane	31-35 vrátane	36-40 vrátane	41-45 vrátane	46-50 vrátane	51-60 vrátane	nad 60	aktívny	pasívny
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13	14
21 923	4 539 079	12 420	9 503	2 512	4 641	4 486	3 644	3 096	2 037	1 432	75	17 618	4 305

1

Dfo (PAS) 42-02

Výkaz pasív doplnkového dôchodkového fondu

Názov doplnkového dôchodkového fondu

Indexový príspevkový d.d.f. NN Tatry - Sympatia, d.d.s., a.s.

Identifikačný kód

S1005180001

Stav ku dňu

30.06.2020

Označenie	Položka	č. r.	Hodnota v tis. eur
a	b	c	1
1.	Závazky	1	40
a)	záväzky voči bankám	2	0
b)	záväzky z ukončenia doplnkového dôchodkového sporenia	3	15
c)	záväzky voči doplnkovej dôchodkovej spoločnosti	4	19
d)	záväzky z derivátových operácií	5	0
e)	záväzky voči bankám z repoobchodov	6	0
f)	záväzky z vypožičania finančného majetku	7	0
g)	ostatné záväzky	8	6
2.	Vlastné imanie	9	24 212
a)	doplnkové dôchodkové jednotky na osobných účtoch účastníkov	10	24 906
b)	doplnkové dôchodkové jednotky na osobných účtoch poberateľov	11	
c)	zisk alebo strata za účtovné obdobie	12	-694
3.	Pasíva spolu	13	24 252

Výkaz výnosov a nákladov doplnkového dôchodkového fondu

Názov doplnkového dôchodkového fondu

Indexový príspevkový d.d.f. NN Tatry - Sympatia, d.d.s., a.s.

Identifikačný kód

S1005180001

Stav ku dňu

30.06.2020

Označenie	Položka	č. r.	Hodnota v tis. eur
a	b	c	1
1.	Výnosy z úrokov a obdobné výnosy	1	0
a)	z peňažných prostriedkov na bežnom účte	2	0
b)	z peňažných prostriedkov na vkladovom účte	3	0
c)	z dlhopisov a obdobných dlhových cenných papierov	4	0
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	95
4.	Výnosy z operácií s cennými papiermi a podielmi	8	-218
a)	z kapitálových cenných papierov a obdobných cenných papierov	9	0
b)	z dlhopisov a iných dlhových cenných papierov	10	0
c)	z nástrojov peňažného trhu	11	0
d)	z podielových listov a obdobných cenných papierov	12	-218
5.	Náklady na operácie s cennými papiermi a podielmi	13	376
a)	kapitálové cenné papiere a obdobné cenné papiere	14	0
b)	dlhopisy a iné dlhové cenné papiere	15	0
c)	nástroje peňažného trhu	16	0
d)	podielové listy a obdobné cenné papiere	17	376
6.	Zisk/strata z operácií s cennými papiermi a podielmi	18	-594
7.	Zisk/strata z operácií s devízami	19	-52
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	3
I.	Výnos z majetku	23	-548
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	12
a)	bankové odplaty a poplatky	28	12
b)	burzové odplaty a poplatky	29	0
II.	Čistý výnos z majetku	30	-560
13.	Náklady na financovanie doplnkového dôchodkového fondu	31	0
III.	Čistý zisk/strata zo správy majetku	32	-560
14.	Iné výnosy	33	0
15.	Náklady na odplaty	34	134
a)	náklady na odplatu za správu	35	90
b)	náklady na odplatu za zhodnotenie majetku v DDF	36	44
c)	náklady na odplatu za prestup účastníka do inej DDS	37	0
IV.	Zisk/strata doplnkového dôchodkového fondu za účtovné obdobie	38	-694