

VZOR

Hlásenie o najvýznamnejších skutočnostiach dôchodkového fondu

Názov dôchodkového fondu

SOLID - dlhopisový garantovaný d.f., AEGON, d.s.s., a.s.

Identifikačný kód

2203060016

Stav ku dňu

31.12.2013

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

Čistá hodnota majetku dosiahla k 31.12.2013 hodnotu 516,95 mil. Eur a aktuálna hodnota dôchodkovej jednotky predstavovala 0,041565 Eur. Hodnota dôchodkovej jednotky v priebehu roka 2013 vzrástla o 0,96 %. Výrazný nárast majetku vo fonde bol spôsobený najmä v súvislosti s novelou zákona o starobnom dôchodkovom sporení a presunom sporiteľov z negarantovaných fondov k 30.4.2013.

Portfólio fondu tvoria najmä štátne dlhopisy a korporátne dlhopisy s garanciou štátu. Medzi ďalšie preferované dlhopisy patria hypotekárne záložné listy a korporátne dlhopisy s implicitnou garanciou štátu. Podiel korporátnych dlhopisov mierne vzrástol a podiel vkladov v bankách klesol. Durácia fondu ku koncu roka dosiahla 1,74.

Na meranie trhového rizika je použitá metóda absolútnej hodnoty v riziku s nasledovnými parametrami: jednostranný interval spoľahlivosti 99 %, časový horizont 20 obchodných dní, metóda parametrická a dátové súbory sú aktualizované najmenej raz za štvrtrok. Pákový efekt nebol použitý.

b) Grafické znázornenie vývoja hodnoty dôchodkovej jednotky



Meno a priezvisko osoby zodpovednej za výkaz:

Martin Mečiar

Telefónne číslo osoby zodpovednej za výkaz:

02/20668 302

Meno a priezvisko osoby, ktorá výkaz vypracovala:

Martin Mečiar

Telefónne číslo osoby, ktorá výkaz vypracovala:

02/20668 302