

VZOR

Hlásenie o najvýznamnejších skutočnostiach dôchodkového fondu

Názov dôchodkového fondu

INDEX - indexový dôchodkový fond, AEGON, d.s.s., a.s.

Identifikačný kód

0204120054

Stav ku dňu

30.06.2014

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 dôchodkového fondu INDEX – indexový negarantovaný d.f., AEGON, d.s.s., a.s. dosiahla k 30.06.2014 hodnotu 4 213 617,56 EUR a aktuálna hodnota dôchodkovej jednotky predstavovala 0,04263 EUR.

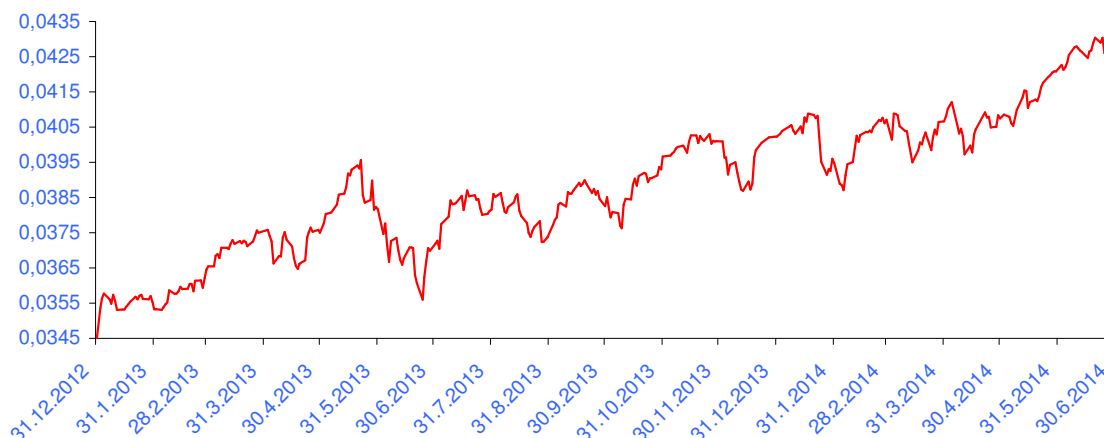
Portfólio fondu tvoria hlavne prevoditeľné cenné papiere ETF (verejne obchodované fondy) renomovaných správcov (99,70 %) a peňažné prostriedky (0,30 %). Investičná stratégia tohto fondu bude dlhodobo realizovaná najmä prostredníctvom nákupov prevoditeľných cenných papierov naviazaných na akciový index MSCI World.

Čo sa týka očakávaného vývoja, ekonomický rast doteraz ťahali predovšetkým stimuly centrálnych bánk. Ukazuje sa však, že v nasledujúcom období nemusia byť kroky centrálnych bánk rovnaké. Napríklad americký FED drží menovú politiku uvoľnenú, no postupne obmedzuje menové stimuly a počíta s možným zvyšovaním sadzieb. Naopak ECB deklaruje, že bude na trhu držať sadzby dlhodobo nízke. Je predpoklad, že ekonomický rast bude pokračovať a rizikové prémie by mohli ešte klesnúť.

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

Obdobie od	do	hodnota v riziku (využitie limitu)		priemer
		min	Max	
1.1.2014	30.06.2014	6,93 %	7,74%	7,38 %

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