

Dof (HNS) 28-02

Strana 1/1

VZOR

Hlásenie o najvýznamnejších skutočnostiach dôchodkového fondu

Názov dôchodkového fondu

INDEX - indexový negarantovaný d.f., AEGON, d.s.s., a.s.

Identifikačný kód

2203060014

Stav ku dňu

31.12.2014

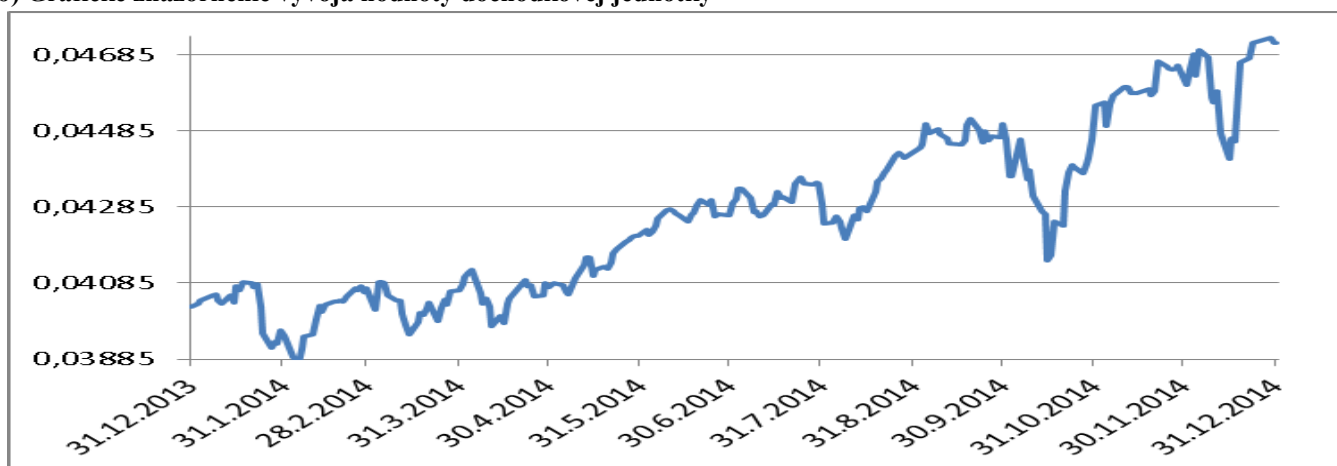
a) Informácie o najvýznamnejších skutočnostiach, ktoré ovplyvnili hospodárenie s majetkom v dôchodkovom fonde a informácie o jeho očakávanom vývoji v nasledujúcom období

Situácia na finančných trhoch v roku 2014 bola ovplyvnená viacerými faktormi – geopolitickým napätím (Ukrajina, Sýria), zlepšujúcou sa makroekonomickou situáciou a hlavne politikou centrálnych bánk. Európska centrálna banka znížila hlavnú refinančnú sadzbu z 0,25% na 0,05% a depozitnú posunula dokonca do negatívneho teritoria a to na hodnotu -0,20%. Hlavný dôvod tohto kroku naštartovanie ekonomického rastu a naplnenie stanoveného inflačného cieľa. Snaha o stimuláciu ekonomiky viedla ECB ku spusteniu programov TLTRO (targeted long-term refinancing operation) a ABS (collateral covered bonds). Keďže komerčné banky neprejavili dostatočný záujem o tieto programy, môžeme v budúcnosti čakať istú formu kvantitatívneho uvoľňovania v eurozóne. Americký Fed ponechal základnú úrokovú sadzbu nezmenenú a to na úrovni 0,25%, ale po pozitívnom vývoji z trhu práce zároveň ukončil kvantitatívne uvoľňovanie v USA. Prebytok likvidity sa odrazil v klesajúcich výnosoch a rastúcich cenách dlhopisov. Úspešný rok na akciových trhoch sa pozitívne prejavil na výnosoch INDEX indexového negarantovaného fondu. Hodnota spravovaného majetku vo fonde k 31.12.2014 bola 5 555 488,19 EUR a hodnota dôchodkovej jednotky bola 0,047157 EUR.

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

| FOND | MIN(vyuzitie limitu) | MAX(vyuzitie limitu) | AVG(vyuzitie limitu) |
|-------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|
| INDEX | 6,3% (42%) | 8,05% (53,6%) | 7,18% (47,8%) |

b) Grafické znázornenie vývoja hodnoty dôchodkovej jednotky



Meno a priezvisko osoby zodpovednej za výkaz:

Martin Mečiar

Telefónne číslo osoby zodpovednej za výkaz:

02/20668 402

Meno a priezvisko osoby, ktorá výkaz vypracovala:

Martin Mečiar

Telefónne číslo osoby, ktorá výkaz vypracovala:

02/20668 402