

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

31.12.2015

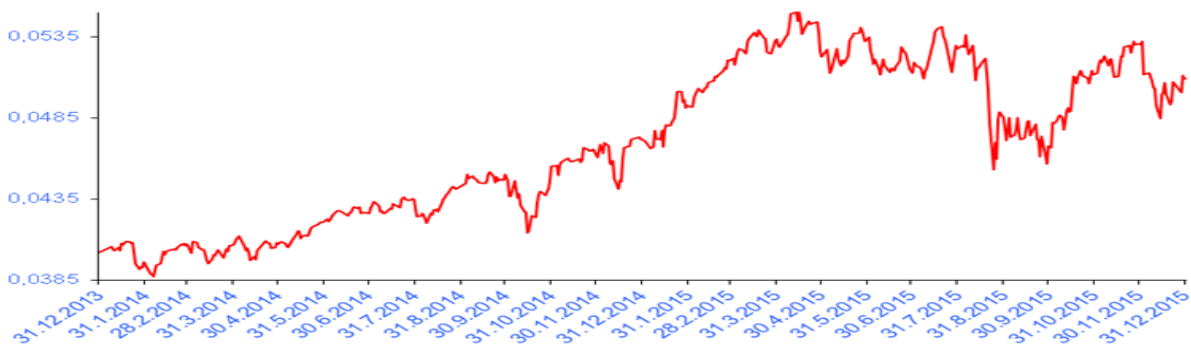
a) Informácie o najvýznamnejších skutočnostiach, ktoré ovplyvnili hospodárenie s majetkom v dôchodkovom fonde a informácie o jeho očakávanom vývoji v nasledujúcom období

Situácia na finančných trhoch v roku 2015 bola ovplyvnená vývojom ekonomickej situácie v Číne, poklesom ceny základných komodít (ropa na 7 ročných cenových minimách) a politikou centrálnych bánk ECB a FED-u. V marci 2015 začala ECB program nákupu štátnych dlhopisov vydaných v eurozóne. Mesačné nákupy dosahujú 60 miliárd €. Tieto nákupy budú trvať do marca roka 2017. Celkovo tak ECB plánuje vložiť do trhu cca 1,5 bilióna EUR s cieľom podporiť ekonomiku a v strednodobom horizonte dosiahnuť mieru inflácie tesne pod 2%. Európska centrálna banka znížila hlavnú refinančnú sadzbu na 0,05% a depozitnú sadzbu posunula až na hodnotu -0,30%. Americký Fed naopak, už začiatkom roka ukončil svoj program kvantitatívneho uvoľňovania. V priebehu roka bol trh v očakávaní zvyšovania úrokových sadzieb. FED nakoniec zvýšil svoju základnú sadzbu až v decembri a to o 0,25%. Bolo to prvé ceny zvýšenie sadzieb po siedmich rokoch prakticky nulových sadzieb. Úspešný rok na akciových trhoch sa pozitívne prejavil predovšetkým na výnosoch INDEX indexového negarantovaného fondu, čo malo výrazný vplyv na náraste počtu sporiteľov indexového fondu, ktorý sa takmer zdvojnásobil. Hodnota spravovaného majetku vo fonde k 31.12.2015 bola 12 137 792,70 EUR a hodnota dôchodkovej jednotky bola 0,048156 EUR.

Na meranie trhového rizika je použitá metóda absolútnej hodnoty v riziku s nasledovnými parametrami: jednostranný interval spoľahlivosti 99 %, časový horizont 1 obchodný deň, dátové súbory sú aktualizované mesačne. Pákový efekt nebol použitý.

FOND	MIN	MAX	AVG
INDEX	4,32 %	2,16 %	3,14 %

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