

# Ročná správa o hospodárení s majetkom v dôchodkovom fonde k 31.12.2016

**Tradícia – Dlhopisový garantovaný dôchodkový fond  
NN dôchodková správcovská spoločnosť, a.s.**

NN dôchodková správcovská spoločnosť, a.s.



## Hlásenie o najvýznamnejších skutočnostiach dôchodkového fondu

Názov dôchodkového fondu

Tradícia - Dlhopisový garantovaný dôchodkový fond NN d.s.s., a.s.

Identifikačný kód

S2203060010

Stav ku dňu

31.12.2016

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

Výnos fondu bol v sledovanom období ovplyvnený najmä vývojom výnosov vládnych, podnikových aj bankových dlhopisov denominovaných v EUR, a to slovenských ako aj európskych, spolu s úrokovými sadzbami peňažného trhu. Vývoj a sled udalostí mal v priebehu roku 2016, predovšetkým v jeho prvej polovici, priaznivý dopad na ceny dlhopisov, a tým aj na zhodnotenie ceny dôchodkovej jednotky vo fonde. V prvej polovici roka sa darilo štátnym dlhopisom, výrazne sa uťahovali rizikové prirážky na dlhopisoch krajín s nižším ratingom a významné zisky si pripísali aj podnikové dlhopisy. Druhá polovica minulého roku priniesla obrat na dlhopisových trhoch, keď sa globálne zlepšili makroekonomické ukazovatele a významne vzrástli inflačné očakávania. Výrazné straty zaznamenali hlavne dlhopisy na dlhom konci krivky, zatiaľ čo aktivita centrálnych bánk bránila väčším stratám dlhopisom s kratšími splatnosťami. Konzervatívna stratégia fondu s dĺžkou 2,9 roku tak v minulom roku zaznamenala zhodnotenie dôchodkovej jednotky o 1,07 %. V porovnaní s mierou inflácie na Slovensku na úrovni -0,5%, meranou medziročnou zmenou indexu spotrebiteľských cien k decembru 2016, došlo k reálnemu zhodnoteniu úspor o 1,57%.

O svižný a nepríjemný štart do nového roku, a to hlavne pre rizikové aktíva, sa postarali obavy z novej recesie v Spojených štátoch, spomaľovanie hospodárskeho rastu v Číne a prepad cien ropy. Naopak, neistota a obavy z budúceho vývoja priali trhom bezpečných štátnych dlhopisov, keď ich ceny od začiatku roka rástli, respektíve klesali ich výnosy. Výrazný prepad ceny ropy a obavy zo spomaľovania globálnej ekonomiky mali rovnako za následok pokles inflačných očakávaní, čo tiež viedlo k poklesu výnosov na bezpečných dlhopisoch.

K ďalšiemu nárastu záujmu o štátne dlhopisy došlo po marcovom zasadnutí Rady guvernérov Európskej centrálnej banky (ECB). Na ňom menová autorita rozhodla o navýšení programu kvantitatívneho uvoľňovania o 20 mld. EUR na 80 mld. EUR mesačne. Ceny štátnych dlhopisov tak ďalej rástli a výrazné zisky začali naberať aj korporátne dlhopisy, ktoré od júna začala nakupovať aj samotná ECB. Ďalším výrazným impulzom pre rast cien dlhopisov bolo júnové rozhodnutie britských voličov o vystúpení Británie z Európskej únie. Štátne dlhopisy sa po referende stali ešte žiadanejším „tovarom“ na finančných trhoch. Po „Brexite“ klesol výnos 10-ročného nemeckého štátneho dlhopisu (Bundu) historicky prvýkrát do záporu až k úrovni -0,20 %.

K obratu na dlhopisových trhoch došlo až v priebehu druhej polovice minulého roka, k čomu prispeli najmä zlepšujúce sa makroekonomické dáta, rast cien ropy a ďalších komodít, rastúce inflačné očakávania a výsledok amerických prezidentských volieb. Práve voľby v USA najviac púťali pozornosť finančných trhov. Dlhopisové výnosy po víťazstve republikánskeho kandidáta Donalda Trumpa významne narástli. Základom takéhoto vývoja bol predpoklad masívneho fiškálneho stimulu budúcej americkej vlády, ktorá zvýši ponuku dlhopisov, pomôže dvihnúť infláciu a prinúti americkú centrálnu banku (Fed) k rýchlejšiemu uťahovaniu menovej politiky. Všetky tieto faktory pritom pôsobia na výnosy rovnakým smerom. Globálne faktory nemohli ignorovať ani európske výnosy navzdory vysoko uvoľnenej menovej politike Európskej centrálnej banky (ECB). Makroekonomické prostredie sa zlepšilo aj v Európe, rástli inflačné očakávania a z dôvodu rastúcej politickej neistoty v regióne sa rozťahovali aj spready dlhopisov voči bezpečne vnímaným nemeckým štátnym dlhopisom. Rast inflačných očakávaní a zlepšujúce sa vyhliadky pre globálny rast prispeli k rýchlejšiemu rastu výnosov na dlhom konci výnosovej krivky, zatiaľ čo pretrvávajúca aktivita centrálnych bánk držala krátke výnosy na veľmi nízkych úrovniach. Krátke európske výnosy dokonca klesali hlbšie do záporu.

Pre vývoj na dlhopisových trhoch v roku 2017 bude kľúčové, či sa potvrdia zlepšené vyhliadky pre globálnu ekonomiku sprevádzané oživením inflácie. Do značnej miery to bude ovplyvnené krokmi nastupujúcej Trumpovej administratívy v Spojených štátoch a politickým vývojom v Európe. Od toho sa budú odvíjať aj ďalšie kroky globálnych centrálnych bánk. V základnom scenári očakávame mierny rast výnosov, ktorý by však nemal byť dramatický, a to hlavne v Európe z dôvodu stále nízkej jadrovej inflácie a pokračujúceho programu kvantitatívneho uvoľňovania z dielne ECB.

Názov dôchodkového fondu

Tradícia - Dlhopisový garantovaný dôchodkový fond NN d.s.s., a.s.

Identifikačný kód

S2203060010

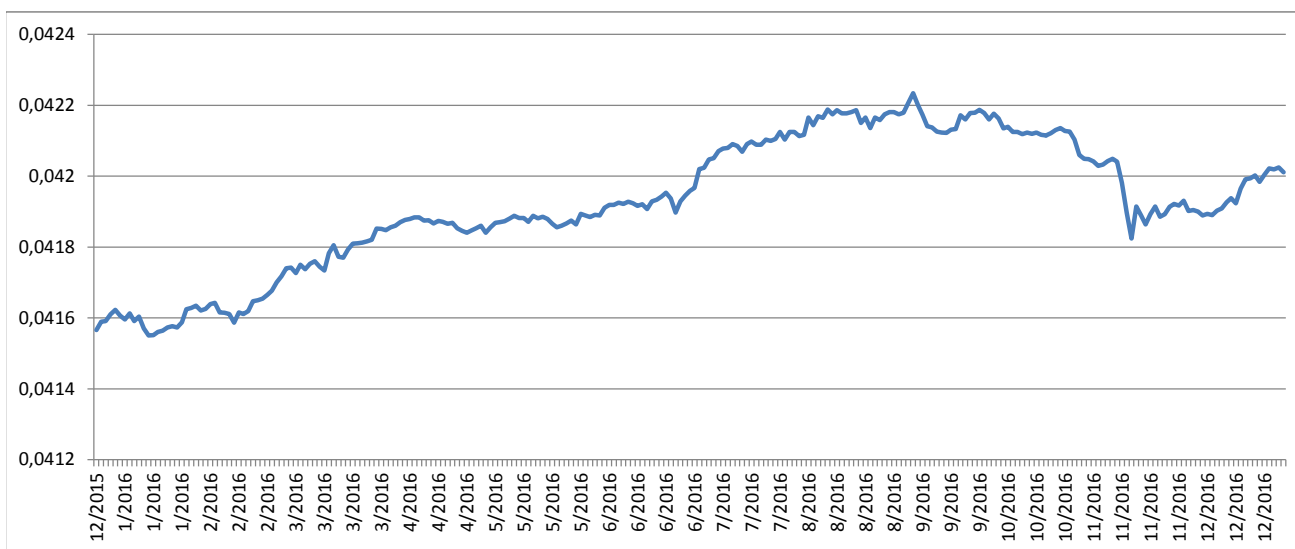
Stav ku dňu

31.12.2016

## 2. Grafické znázornenie vývoja hodnoty dôchodkovej jednotky

Vývoj hodnoty dôchodkovej jednotky

od 1.1.2016 do 31.12.2016



Hodnota DJ 31.12.2016

0,042011

Názov dôchodkového fondu

Tradícia - Dlhopisový garantovaný dôchodkový fond NN d.s.s., a.s.

Identifikačný kód

S2203060010

Stav ku dňu

31.12.2016

### 3. Informácie týkajúce sa merania a riadenia rizík v dôchodkovom fonde

Trhové riziko majetku dôchodkového fondu je merané prístupom hodnoty v riziku. Metóda použitá na výpočet je absolútna hodnota v riziku počítaná na 250 dňovom rade pozorovaní, na ktorom je na základe predpokladu normálneho rozdelenia zmien dôchodkovej jednotky vypočítaná hodnota v riziku na 99% intervale spoľahlivosti pre časový horizont 1 dňa. Výsledok je následne škálovaný pravidlom druhej odmocniny času na želaný časový horizont. Výsledky a predpoklady výpočtu sú spätne testované porovnaním vypočítanej jednodňovej hodnoty v riziku s následne realizovanou zmenou hodnoty majetku dôchodkového fondu.

## Hlásenie o stave majetku v dôchodkovom фонде

Názov dôchodkového fondu

Tradícia - Dlhopisový garantovaný dôchodkový fond NN d.s.s., a.s.

Identifikačný kód

S2203060010

Stav ku dňu

31.12.2016

## Členenie podľa trhov

| Druh majetku   | Členenie  | č. r.     | Hodnota v tis. eur | Podiel na majetku v dôchodkovom фонде v % |
|--|---|-----------|--------------------|---|
| a  | b   | c         | 1                  | 2   |
| Kapitálové cenné papiere a obdobné cenné papiere   | Prijaté na obchodovanie na trhu kótovaných cenných papierov burzy cenných papierov  | 1         |                    | 0,0000                                    |
|  | Prijaté na obchodovanie na trhu kótovaných cenných papierov zahraničnej burzy cenných papierov so sídlom v členskom štáte   | 2         |                    | 0,0000                                    |
|  | Prijaté na obchodovanie na inom regulovanom trhu so sídlom v štáte, ktorý je súčasťou Európskeho hospodárskeho priestoru, a ktorý je uvedený v zozname zverejnenom Európskou komisiou   | 3         |                    | 0,0000                                    |
|  | Z nových emisií cenných papierov, ak emisné podmienky obsahujú záväzok, že bude podaná žiadosť o prijatie cenných papierov na obchodovanie na regulovanom trhu a zo všetkých okolností je zrejme, že sa toto prijatie uskutoční do jedného roka od dátumu vydania emisie cenných papierov | 4         |                    | 0,0000                                    |
| Dlhopisy a iné dlhové cenné papiere  | Prijaté na obchodovanie na trhu kótovaných cenných papierov burzy cenných papierov  | 5         | 452846,00          | 78,5384                                   |
|  | Prijaté na obchodovanie na trhu kótovaných cenných papierov zahraničnej burzy cenných papierov so sídlom v členskom štáte   | 6         |                    | 0,0000                                    |
|  | Prijaté na obchodovanie na inom regulovanom trhu so sídlom v štáte, ktorý je súčasťou Európskeho hospodárskeho priestoru, a ktorý je uvedený v zozname zverejnenom Európskou komisiou   | 7         |                    | 0,0000                                    |
|  | Z nových emisií cenných papierov, ak emisné podmienky obsahujú záväzok, že bude podaná žiadosť o prijatie cenných papierov na obchodovanie na regulovanom trhu a zo všetkých okolností je zrejme, že sa toto prijatie uskutoční do jedného roka od dátumu vydania emisie cenných papierov | 8         |                    | 0,0000                                    |
| Podielové listy otvorených podielových fondov a cenné papiere zahraničných subjektov kolektívneho investovania podľa § 81 ods. 1 písm. c) zákona                     | Prijaté na obchodovanie na trhu kótovaných cenných papierov burzy cenných papierov  | 9         |                    | 0,0000                                    |
|  | Prijaté na obchodovanie na trhu kótovaných cenných papierov zahraničnej burzy cenných papierov so sídlom v členskom štáte   | 10        | 64087,00           | 11,1148                                   |
|  | Prijaté na obchodovanie na inom regulovanom trhu so sídlom v štáte, ktorý je súčasťou Európskeho hospodárskeho priestoru, a ktorý je uvedený v zozname zverejnenom Európskou komisiou   | 11        |                    | 0,0000                                    |
| Cenné papiere iných zahraničných subjektov kolektívneho investovania podľa § 81 ods. 1 písm. d) zákona   | Z nových emisií cenných papierov, ak emisné podmienky obsahujú záväzok, že bude podaná žiadosť o prijatie cenných papierov na obchodovanie na regulovanom trhu a zo všetkých okolností je zrejme, že sa toto prijatie uskutoční do jedného roka od dátumu vydania emisie cenných papierov | 12        |                    | 0,0000                                    |
|  | Prijaté na obchodovanie na trhu kótovaných cenných papierov burzy cenných papierov  | 13        |                    | 0,0000                                    |
|  | Prijaté na obchodovanie na trhu kótovaných cenných papierov zahraničnej burzy cenných papierov so sídlom v členskom štáte   | 14        |                    | 0,0000                                    |
|  | Prijaté na obchodovanie na inom regulovanom trhu so sídlom v štáte, ktorý je súčasťou Európskeho hospodárskeho priestoru, a ktorý je uvedený v zozname zverejnenom Európskou komisiou   | 15        |                    | 0,0000                                    |
| Nástroje peňažného trhu podľa § 81 ods. 1 písm. e) zákona  | Z nových emisií cenných papierov, ak emisné podmienky obsahujú záväzok, že bude podaná žiadosť o prijatie cenných papierov na obchodovanie na regulovanom trhu a zo všetkých okolností je zrejme, že sa toto prijatie uskutoční do jedného roka od dátumu vydania emisie cenných papierov | 16        |                    | 0,0000                                    |
|  | Vydané alebo zaručené Ministerstvom financií SR alebo Národnou bankou Slovenska   | 17        |                    | 0,0000                                    |
|  | Vydané alebo zaručené členskými štátmi a jeho centrálnymi orgánmi   | 18        |                    | 0,0000                                    |
|  | Vydané alebo zaručené centrálnou bankou členského štátu   | 19        |                    | 0,0000                                    |
|  | Vydané alebo zaručené orgánmi miestnej správy členského štátu   | 20        |                    | 0,0000                                    |
|  | Vydané alebo zaručené ECB, EÚ, EIB, IBRD, IFA, CEB, IADB, ADB, AFDB, CDB, NIB, EBRD, EIF, IMF, BIS, MIGA  | 21        |                    | 0,0000                                    |
|  | Vydané alebo zaručené emitentom, ktorého cenné papiere boli prijaté na obchodovanie na regulovanom trhu   | 22        |                    | 0,0000                                    |
| Peňažné prostriedky na bežných účtoch a vkladových účtoch podľa § 81 ods. 1 písm. f) zákona  | Vydané alebo zaručené finančnými inštitúciami so sídlom v členskom štáte alebo nečlenskom štáte; to platí, ak za splatenie nástrojov peňažného trhu prevzala záruku finančná inštitúcia   | 23        |                    | 0,0000                                    |
|  | na bežnom účte u depozitára   | 24        |                    | 0,0000                                    |
|  | na vkladovom účte u depozitára  | 25        |                    | 0,0000                                    |
|  | na bežnom účte v banke alebo zahraničnej banke konajúcej prostredníctvom pobočky zahraničnej banky so sídlom v SR, v inom členskom štáte alebo nečlenskom štáte, ak táto banka alebo zahraničná banka konajúca prostredníctvom pobočky zahraničnej banky podlieha dohľadu                 | 26        | 11535,00           | 2,0005                                    |
| Pohlľadávky a záväzky vznikajúce pri obchodoch určených výlučne na obmedzenie úrokového rizika, menového rizika alebo iného rizika podľa § 81 ods. 1 písm. g) zákona | prostriedky na vkladovom účte v banke alebo zahraničnej banke konajúcej prostredníctvom pobočky zahraničnej banky so sídlom v SR, v inom členskom štáte alebo nečlenskom štáte, ak táto banka alebo zahraničná banka konajúca prostredníctvom pobočky zahraničnej banky podlieha dohľadu  | 27        | 48111,00           | 8,3440                                    |
|  |   | 28        |                    | 0,0000                                    |
| Cenné papiere, s ktorými sa prestalo obchodovať na regulovanom trhu cenných papierov podľa § 83 ods. 1 zákona  |   | 29        |                    | 0,0000                                    |
| Cenné papiere z nových emisií, ktoré nespĺnili podmienku podľa § 81 ods. 1 písm. b) zákona a neboli prijaté na obchodovanie na regulovanom trhu do 1 roka            |   | 30        |                    | 0,0000                                    |
| Cenné papiere, ktoré nie sú prijaté na obchodovanie na regulovanom trhu  |   | 31        |                    | 0,0000                                    |
| Iný majetok  |   | 32        |                    | 0,0000                                    |
| Objem pohľadávok dôchodkového fondu celkom   |   | 33        | 13,00              | 0,0023                                    |
| <b>Hodnota majetku v dôchodkovom фонде</b>   |   | <b>34</b> | <b>576592,00</b>   | <b>100,0000</b>                           |
| Objem záväzkov dôchodkového fondu celkom   |   | 35        | 1302,00            | 0,2258                                    |
| <b>Čistá hodnota majetku v dôchodkovom фонде</b>   |   | <b>36</b> | <b>575290,00</b>   | <b>99,7742</b>                            |

Názov dôchodkového fondu

Tradícia - Dlhopisový garantovaný dôchodkový fond NN d.s.s., a.s.

Identifikačný kód

S230306010

Stav ku dňu

31.12.2016

Členenie podľa emitentov

| čís.r. | Emitenti/Banky                 | Spolu            |               | Kapitálové CP a obdobné CP |             | Dlhopisy a iné dlhové CP |              | PL OPF a CP ZSKI |              | CP IZSKI         |             | NPT              |             | Peňažné prostriedky na BU a VU |              | Pohľadávky a záväzky vznikajúce pri obchodoch určených výlučne na obmedzenie úrokového rizika, menového rizika alebo iného rizika |             | Iný majetok      |             | Pohľadávky 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 %  | 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      | <b>CELKOM</b>                  | <b>576592,00</b> | <b>100,00</b> | <b>0,00</b>                | <b>0,00</b> | <b>452846,00</b>         | <b>78,54</b> | <b>64087,00</b>  | <b>11,11</b> | <b>0,00</b>      | <b>0,00</b> | <b>0,00</b>      | <b>0,00</b> | <b>59646,00</b>                | <b>10,34</b> | <b>0,00</b>   | <b>0,00</b> | <b>0,00</b>      | <b>0,00</b> | <b>13,00</b>                  | <b>0,00</b> |
| 1      | ANHEUSER-BUSCH INBEV NV        | 4004,00          | 0,6944        |                            | 0,0000      | 4004,00                  | 0,6944       |                  | 0,0000       |                  | 0,0000      |                  | 0,0000      |                                | 0,0000       |   | 0,0000      |                  | 0,0000      |                               | 0,0000      |
| 2      | ARION BANKI HF                 | 5465,00          | 0,9478        |                            | 0,0000      | 5465,00                  | 0,9478       |                  | 0,0000       |                  | 0,0000      |                  | 0,0000      |                                | 0,0000       |   | 0,0000      |                  | 0,0000      |                               | 0,0000      |
| 3      | BASF SE                        | 2042,00          | 0,3541        |                            | 0,0000      | 2042,00                  | 0,3541       |                  | 0,0000       |                  | 0,0000      |                  | 0,0000      |                                | 0,0000       |   | 0,0000      |                  | 0,0000      |                               | 0,0000      |
| 4      | BMW FINANCE NV                 | 2195,00          | 0,3807        |                            | 0,0000      | 2195,00                  | 0,3807       |                  | 0,0000       |                  | 0,0000      |                  | 0,0000      |                                | 0,0000       |   | 0,0000      |                  | 0,0000      |                               | 0,0000      |
| 5      | BMW US CAPITAL LLC             | 5694,00          | 0,9875        |                            | 0,0000      | 5694,00                  | 0,9875       |                  | 0,0000       |                  | 0,0000      |                  | 0,0000      |                                | 0,0000       |   | 0,0000      |                  | 0,0000      |                               | 0,0000      |
| 6      | CESKA EXPORTNI BANKA AS        | 33822,00         | 5,8658        |                            | 0,0000      | 33822,00                 | 5,8658       |                  | 0,0000       |                  | 0,0000      |                  | 0,0000      |                                | 0,0000       |   | 0,0000      |                  | 0,0000      |                               | 0,0000      |
| 7      | CEZ AS                         | 8192,00          | 1,4208        |                            | 0,0000      | 8192,00                  | 1,4208       |                  | 0,0000       |                  | 0,0000      |                  | 0,0000      |                                | 0,0000       |   | 0,0000      |                  | 0,0000      |                               | 0,0000      |
| 8      | CZECH REPUBLIC                 | 70609,00         | 12,2459       |                            | 0,0000      | 70609,00                 | 12,2459      |                  | 0,0000       |                  | 0,0000      |                  | 0,0000      |                                | 0,0000       |   | 0,0000      |                  | 0,0000      |                               | 0,0000      |
| 9      | GE CAPITAL EURO FUNDING        | 8321,00          | 1,4431        |                            | 0,0000      | 8321,00                  | 1,4431       |                  | 0,0000       |                  | 0,0000      |                  | 0,0000      |                                | 0,0000       |   | 0,0000      |                  | 0,0000      |                               | 0,0000      |
| 10     | ING BANK NV                    | 5139,00          | 0,8913        |                            | 0,0000      | 5139,00                  | 0,8913       |                  | 0,0000       |                  | 0,0000      |                  | 0,0000      |                                | 0,0000       |   | 0,0000      |                  | 0,0000      |                               | 0,0000      |
| 11     | Irish Government Bond          | 24371,00         | 4,2267        |                            | 0,0000      | 24371,00                 | 4,2267       |                  | 0,0000       |                  | 0,0000      |                  | 0,0000      |                                | 0,0000       |   | 0,0000      |                  | 0,0000      |                               | 0,0000      |
| 12     | iShares Core Euro Corp Bond    | 10686,00         | 1,8533        |                            | 0,0000      |                          | 0,0000       | 10686,00         | 1,8533       |                  | 0,0000      |                  | 0,0000      |                                | 0,0000       |   | 0,0000      |                  | 0,0000      |                               | 0,0000      |
| 13     | iShares Euro Corporate Bond La | 53401,00         | 9,2615        |                            | 0,0000      |                          | 0,0000       | 53401,00         | 9,2615       |                  | 0,0000      |                  | 0,0000      |                                | 0,0000       |   | 0,0000      |                  | 0,0000      |                               | 0,0000      |
| 14     | Kingdom of Spain               | 11425,00         | 1,9815        |                            | 0,0000      | 11425,00                 | 1,9815       |                  | 0,0000       |                  | 0,0000      |                  | 0,0000      |                                | 0,0000       |   | 0,0000      |                  | 0,0000      |                               | 0,0000      |
| 15     | MFINANCE FRANCE SA             | 6832,00          | 1,1849        |                            | 0,0000      | 6832,00                  | 1,1849       |                  | 0,0000       |                  | 0,0000      |                  | 0,0000      |                                | 0,0000       |   | 0,0000      |                  | 0,0000      |                               | 0,0000      |
| 16     | NET4GAS SRO                    | 8175,00          | 1,4178        |                            | 0,0000      | 8175,00                  | 1,4178       |                  | 0,0000       |                  | 0,0000      |                  | 0,0000      |                                | 0,0000       |   | 0,0000      |                  | 0,0000      |                               | 0,0000      |
| 17     | OMV AG                         | 7327,00          | 1,2707        |                            | 0,0000      | 7327,00                  | 1,2707       |                  | 0,0000       |                  | 0,0000      |                  | 0,0000      |                                | 0,0000       |   | 0,0000      |                  | 0,0000      |                               | 0,0000      |
| 18     | PGE SWEDEN AB                  | 7897,00          | 1,3696        |                            | 0,0000      | 7897,00                  | 1,3696       |                  | 0,0000       |                  | 0,0000      |                  | 0,0000      |                                | 0,0000       |   | 0,0000      |                  | 0,0000      |                               | 0,0000      |
| 19     | Raiffeisenbank AS              | 7070,00          | 1,2262        |                            | 0,0000      | 7070,00                  | 1,2262       |                  | 0,0000       |                  | 0,0000      |                  | 0,0000      |                                | 0,0000       |   | 0,0000      |                  | 0,0000      |                               | 0,0000      |
| 20     | REPUBLIC OF LATVIA             | 13609,00         | 2,3602        |                            | 0,0000      | 13609,00                 | 2,3602       |                  | 0,0000       |                  | 0,0000      |                  | 0,0000      |                                | 0,0000       |   | 0,0000      |                  | 0,0000      |                               | 0,0000      |
| 21     | REPUBLIC OF LITHUANIA          | 36096,00         | 6,2602        |                            | 0,0000      | 36096,00                 | 6,2602       |                  | 0,0000       |                  | 0,0000      |                  | 0,0000      | 0,00                           | 0,0000       |   | 0,0000      |                  | 0,0000      |                               | 0,0000      |
| 22     | REPUBLIC OF POLAND             | 51778,00         | 8,9800        |                            | 0,0000      | 51778,00                 | 8,9800       |                  | 0,0000       |                  | 0,0000      |                  | 0,0000      | 0,00                           | 0,0000       |   | 0,0000      |                  | 0,0000      |                               | 0,0000      |
| 23     | REPUBLIKA SLOVENIJA            | 12617,00         | 2,1882        |                            | 0,0000      | 12617,00                 | 2,1882       |                  | 0,0000       |                  | 0,0000      |                  | 0,0000      | 0,00                           | 0,0000       |   | 0,0000      |                  | 0,0000      |                               | 0,0000      |
| 24     | ROMANIA                        | 20750,00         | 3,5987        |                            | 0,0000      | 20750,00                 | 3,5987       |                  | 0,0000       |                  | 0,0000      |                  | 0,0000      | 0,00                           | 0,0000       |   | 0,0000      |                  | 0,0000      |                               | 0,0000      |
| 25     | SBERBANK SLOVENSKO             | 4035,00          | 0,6998        |                            | 0,0000      | 4035,00                  | 0,6998       |                  | 0,0000       |                  | 0,0000      |                  | 0,0000      | 0,00                           | 0,0000       |   | 0,0000      |                  | 0,0000      |                               | 0,0000      |
| 26     | SID BANKA EXPORT AND DEV       | 7592,00          | 1,3167        |                            | 0,0000      | 7592,00                  | 1,3167       |                  | 0,0000       |                  | 0,0000      |                  | 0,0000      | 0,00                           | 0,0000       |   | 0,0000      |                  | 0,0000      |                               | 0,0000      |
| 27     | SLOVAKIA GOVERNMENT BOND       | 22653,00         | 3,9288        |                            | 0,0000      | 22653,00                 | 3,9288       |                  | 0,0000       |                  | 0,0000      |                  | 0,0000      | 0,00                           | 0,0000       |   | 0,0000      |                  | 0,0000      |                               | 0,0000      |
| 28     | SLOVENSKA SPORITELNA AS        | 18064,88         | 3,1330        |                            | 0,0000      | 10055,00                 | 1,7439       |                  | 0,0000       |                  | 0,0000      |                  | 0,0000      | 8009,88                        | 1,3892       |   | 0,0000      |                  | 0,0000      |                               | 0,0000      |
| 29     | SPP DISTRIBUCIA AS             | 9535,00          | 1,6537        |                            | 0,0000      | 9535,00                  | 1,6537       |                  | 0,0000       |                  | 0,0000      |                  | 0,0000      | 0,00                           | 0,0000       |   | 0,0000      |                  | 0,0000      |                               | 0,0000      |
| 30     | SPP INFRASTRUCTURE FIN         | 8450,00          | 1,4655        |                            | 0,0000      | 8450,00                  | 1,4655       |                  | 0,0000       |                  | 0,0000      |                  | 0,0000      | 0,00                           | 0,0000       |   | 0,0000      |                  | 0,0000      |                               | 0,0000      |
| 31     | UNICREDIT BANK CZECH RE        | 4019,00          | 0,6970        |                            | 0,0000      | 4019,00                  | 0,6970       |                  | 0,0000       |                  | 0,0000      |                  | 0,0000      | 0,00                           | 0,0000       |   | 0,0000      |                  | 0,0000      |                               | 0,0000      |
| 32     | UNICREDIT SPA                  | 7820,00          | 1,3562        |                            | 0,0000      | 7820,00                  | 1,3562       |                  | 0,0000       |                  | 0,0000      |                  | 0,0000      | 0,00                           | 0,0000       |   | 0,0000      |                  | 0,0000      |                               | 0,0000      |
| 33     | VOLKSWAGEN BANK GMBH           | 2082,00          | 0,3611        |                            | 0,0000      | 2082,00                  | 0,3611       |                  | 0,0000       |                  | 0,0000      |                  | 0,0000      | 0,00                           | 0,0000       |   | 0,0000      |                  | 0,0000      |                               | 0,0000      |
| 34     | Volkswagen Leasing GmbH        | 4248,00          | 0,7367        |                            | 0,0000      | 4248,00                  | 0,7367       |                  | 0,0000       |                  | 0,0000      |                  | 0,0000      | 0,00                           | 0,0000       |   | 0,0000      |                  | 0,0000      |                               | 0,0000      |
| 35     | VSEOBECNÁ UVEROVÁ BANKA        | 62392,12         | 10,8208       |                            | 0,0000      | 10756,00                 | 1,8654       |                  | 0,0000       |                  | 0,0000      |                  | 0,0000      | 51636,12                       | 8,9554       |   | 0,0000      |                  | 0,0000      |                               | 0,0000      |
| 36     | ZAPADOSLOVENSKA ENRG AS        | 8171,00          | 1,4171        |                            | 0,0000      | 8171,00                  | 1,4171       |                  | 0,0000       |                  | 0,0000      |                  | 0,0000      | 0,00                           | 0,0000       |   | 0,0000      |                  | 0,0000      |                               | 0,0000      |
| 37     | NN DSS, a.s.                   | 13,00            | 0,0023        |                            | 0,0000      |                          | 0,0000       |                  | 0,0000       |                  | 0,0000      |                  | 0,0000      |                                | 0,0000       |   | 0,0000      |                  | 0,0000      | 13,00                         | 0,0023      |

Názov dôchodkového fondu

Tradícia - Dlhopisový garantovaný dôchodkový fond NN d.s., a.s.

Identifikačný kód

S220360010

Stav ku dňu

31.12.2016

## Členenie podľa sektorového hľadiska

| č. r. | Sektore klasifikácie ekonomických činností | Spolu            |               | Kapitálové CP a obdobné CP |             | Dlhopisy a iné dlhové CP |              | PL OPF a CP ZSKI |              | CP IZSKI         |             | NPT              |             | Peňažné prostriedky na BÚ a VÚ |              | Pohľadávky a záväzky vznikajúce pri obchodoch určených výlučne na obmedzenie úrokového rizika, menového rizika alebo iného rizika |             | Iný majetok      |             | Pohľadávky 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  | 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     | <b>CELKOM</b>                              | <b>576592,00</b> | <b>100,00</b> | <b>0,00</b>                | <b>0,00</b> | <b>452846,00</b>         | <b>78,54</b> | <b>64087,00</b>  | <b>11,11</b> | <b>0,00</b>      | <b>0,00</b> | <b>0,00</b>      | <b>0,00</b> | <b>59646,00</b>                | <b>10,34</b> | <b>0,00</b>   | <b>0,00</b> | <b>0,00</b>      | <b>0,00</b> | <b>13,00</b>                  | <b>0,00</b> |
| 1     | 1105                                       | 4004,00          | 0,6944        |                            | 0,0000      | 4004,00                  | 0,6944       |                  | 0,0000       |                  | 0,0000      |                  | 0,0000      | 0,00                           | 0,0000       |   | 0,0000      |                  | 0,0000      |                               | 0,0000      |
| 2     | 1920                                       | 7327,00          | 1,2707        |                            | 0,0000      | 7327,00                  | 1,2707       |                  | 0,0000       |                  | 0,0000      |                  | 0,0000      | 0,00                           | 0,0000       |   | 0,0000      |                  | 0,0000      |                               | 0,0000      |
| 3     | 2059                                       | 2042,00          | 0,3541        |                            | 0,0000      | 2042,00                  | 0,3541       |                  | 0,0000       |                  | 0,0000      |                  | 0,0000      | 0,00                           | 0,0000       |   | 0,0000      |                  | 0,0000      |                               | 0,0000      |
| 4     | 3511                                       | 24260,00         | 4,2075        |                            | 0,0000      | 24260,00                 | 4,2075       |                  | 0,0000       |                  | 0,0000      |                  | 0,0000      | 0,00                           | 0,0000       |   | 0,0000      |                  | 0,0000      |                               | 0,0000      |
| 5     | 3522                                       | 26160,00         | 4,5370        |                            | 0,0000      | 26160,00                 | 4,5370       |                  | 0,0000       |                  | 0,0000      |                  | 0,0000      | 0,00                           | 0,0000       |   | 0,0000      |                  | 0,0000      |                               | 0,0000      |
| 6     | 6430                                       | 64087,00         | 11,1148       |                            | 0,0000      |                          | 0,0000       | 64087,00         | 11,1148      |                  | 0,0000      |                  | 0,0000      | 0,00                           | 0,0000       |   | 0,0000      |                  | 0,0000      |                               | 0,0000      |
| 7     | 6491                                       | 4248,00          | 0,7367        |                            | 0,0000      | 4248,00                  | 0,7367       |                  | 0,0000       |                  | 0,0000      |                  | 0,0000      | 0,00                           | 0,0000       |   | 0,0000      |                  | 0,0000      |                               | 0,0000      |
| 8     | 6499                                       | 180543,00        | 31,3121       |                            | 0,0000      | 120897,00                | 20,9675      |                  | 0,0000       |                  | 0,0000      |                  | 0,0000      | 59646,00                       | 10,3446      |   | 0,0000      |                  | 0,0000      |                               | 0,0000      |
| 9     | 8411                                       | 263908,00        | 45,7703       |                            | 0,0000      | 263908,00                | 45,7703      |                  | 0,0000       |                  | 0,0000      |                  | 0,0000      | 0,00                           | 0,0000       |   | 0,0000      |                  | 0,0000      |                               | 0,0000      |
| 10    | 6530                                       | 13,00            | 0,0023        |                            | 0,0000      |                          | 0,0000       |                  | 0,0000       |                  | 0,0000      |                  | 0,0000      | 0,0000                         | 0,0000       |   | 0,0000      |                  | 0,0000      | 13,00                         | 0,0023      |





Názov dôchodkového fondu

Tradicia - Dlhopisový garantovaný dôchodkový fond NN d.s., a.s.

Identifikačný kód

S2203060010

Stav ku dňu

31.12.2016

Členenie podľa menového hľadiska

| č.r. | Mena           | Zostatková fixácia úrokových mier | Spolu            |            | Kapitálové CP a obdobné CP |            | Dlhopisy a iné dlhové CP |            | PL OPF a CP ZSKI |            | CP IZSKI         |            | NPT              |            | Peňažné prostriedky na BÚ a VÚ |            | Pohľadávky a záväzky vznikajúce pri obchodoch určených výlučne na obmedzenie úrokového rizika, menového rizika alebo iného rizika |  |            | Iný majetok      |            | Pohľadávky 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   | hodnota podkladového nástroja v tis. eur | podiel v % | objem v tis. eur | podiel v % | objem v tis. eur              | podiel v % |
| 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     |                                   | 576592,00        | 100,0000   | 0,00                       | 0,0000     | 452846,00                | 78,5384    | 64087,00         | 11,1148    | 0,00             | 0,0000     | 0,00             | 0,0000     | 59646,00                       | 10,3446    | 0,00  | 0,00                                     | 0,0000     | 0,00             | 0,0000     | 13,00                         | 0,0023     |
| 0b   | CELKOM USD     |                                   | 0,00             | 0,0000     | 0,00                       | 0,0000     | 0,00                     | 0,0000     | 0,00             | 0,0000     | 0,00             | 0,0000     | 0,00             | 0,0000     | 0,00                           | 0,0000     | 0,00  | 0,00                                     | 0,0000     | 0,00             | 0,0000     | 0,00                          | 0,0000     |
| 0c   | CELKOM CZK     |                                   | 0,00             | 0,0000     | 0,00                       | 0,0000     | 0,00                     | 0,0000     | 0,00             | 0,0000     | 0,00             | 0,0000     | 0,00             | 0,0000     | 0,00                           | 0,0000     | 0,00  | 0,00                                     | 0,0000     | 0,00             | 0,0000     | 0,00                          | 0,0000     |
| 0d   | CELKOM HUF     |                                   | 0,00             | 0,0000     | 0,00                       | 0,0000     | 0,00                     | 0,0000     | 0,00             | 0,0000     | 0,00             | 0,0000     | 0,00             | 0,0000     | 0,00                           | 0,0000     | 0,00  | 0,00                                     | 0,0000     | 0,00             | 0,0000     | 0,00                          | 0,0000     |
| 0e   | CELKOM PLN     |                                   | 0,00             | 0,0000     | 0,00                       | 0,0000     | 0,00                     | 0,0000     | 0,00             | 0,0000     | 0,00             | 0,0000     | 0,00             | 0,0000     | 0,00                           | 0,0000     | 0,00  | 0,00                                     | 0,0000     | 0,00             | 0,0000     | 0,00                          | 0,0000     |
| 0f   | CELKOM JPY     |                                   | 0,00             | 0,0000     | 0,00                       | 0,0000     | 0,00                     | 0,0000     | 0,00             | 0,0000     | 0,00             | 0,0000     | 0,00             | 0,0000     | 0,00                           | 0,0000     | 0,00  | 0,00                                     | 0,0000     | 0,00             | 0,0000     | 0,00                          | 0,0000     |
| 0g   | CELKOM OSTATNE |                                   | 0,00             | 0,0000     | 0,00                       | 0,0000     | 0,00                     | 0,0000     | 0,00             | 0,0000     | 0,00             | 0,0000     | 0,00             | 0,0000     | 0,00                           | 0,0000     | 0,00  | 0,00                                     | 0,0000     | 0,00             | 0,0000     | 0,00                          | 0,0000     |
| 1    | EUR            | M1                                | 16050,00         | 2,7836     |                            | 0,0000     | 4502,00                  | 0,7808     |                  | 0,0000     |                  | 0,0000     |                  | 0,0000     | 11535,00                       | 2,0005     |   |  | 0,0000     |                  | 0,0000     | 13,00                         | 0,0023     |
| 2    | EUR            | O1M3M                             | 0,00             | 0,0000     |                            | 0,0000     |                          | 0,0000     |                  | 0,0000     |                  | 0,0000     |                  | 0,0000     |                                | 0,0000     |   |  | 0,0000     |                  | 0,0000     |                               | 0,0000     |
| 3    | EUR            | O3M6M                             | 7820,00          | 1,3562     |                            | 0,0000     | 7820,00                  | 1,3562     |                  | 0,0000     |                  | 0,0000     |                  | 0,0000     |                                | 0,0000     |   |  | 0,0000     |                  | 0,0000     |                               | 0,0000     |
| 4    | EUR            | 6M1R                              | 47552,40         | 8,2471     |                            | 0,0000     | 14463,00                 | 2,5084     |                  | 0,0000     |                  | 0,0000     |                  | 0,0000     | 33089,40                       | 5,7388     |   |  | 0,0000     |                  | 0,0000     |                               | 0,0000     |
| 5    | EUR            | R1PR3                             | 155746,60        | 27,0116    |                            | 0,0000     | 140725,00                | 24,4063    |                  | 0,0000     |                  | 0,0000     |                  | 0,0000     | 15021,60                       | 2,6052     |   |  | 0,0000     |                  | 0,0000     |                               | 0,0000     |
| 6    | EUR            | R3PR5                             | 215969,00        | 37,4561    |                            | 0,0000     | 215969,00                | 37,4561    |                  | 0,0000     |                  | 0,0000     |                  | 0,0000     |                                | 0,0000     |   |  | 0,0000     |                  | 0,0000     |                               | 0,0000     |
| 7    | EUR            | R5PR10                            | 69367,00         | 12,0305    |                            | 0,0000     | 69367,00                 | 12,0305    |                  | 0,0000     |                  | 0,0000     |                  | 0,0000     |                                | 0,0000     |   |  | 0,0000     |                  | 0,0000     |                               | 0,0000     |
| 8    | EUR            | R10PR15                           | 0,00             | 0,0000     |                            | 0,0000     |                          | 0,0000     |                  | 0,0000     |                  | 0,0000     |                  | 0,0000     |                                | 0,0000     |   |  | 0,0000     |                  | 0,0000     |                               | 0,0000     |
| 9    | EUR            | R15P                              | 0,00             | 0,0000     |                            | 0,0000     |                          | 0,0000     |                  | 0,0000     |                  | 0,0000     |                  | 0,0000     |                                | 0,0000     |   |  | 0,0000     |                  | 0,0000     |                               | 0,0000     |
| 10   | EUR            | NA                                | 64087,00         | 11,1148    |                            | 0,0000     |                          | 0,0000     | 64087,00         | 11,1148    |                  | 0,0000     |                  | 0,0000     |                                | 0,0000     |   |  | 0,0000     |                  | 0,0000     |                               | 0,0000     |

Dof (SP) 17-02

## Hlásenie o vývoji počtu sporiteľov

Názov dôchodkového fondu

Tradícia - Dlhopisový garantovaný dôchodkový fond NN d.s., a.s.

Identifikačný kód

S2203060010

Stav ku dňu

31.12.2016

| Počet sporiteľov spolu | Objem príspevkov v eurách spolu | Objem penále v eurách spolu | Počet sporiteľov podľa pohlavia |       | Počet sporiteľov podľa spôsobu prispievania |         | Zmena stavov sporiteľov |        |                   |        |        |
|------------------------|---------------------------------|-----------------------------|---------------------------------|-------|---|---------|-------------------------|--------|-------------------|--------|--------|
|                        |                                 |                             | muži                            | ženy  | aktívny                                     | pasívny | medzi DF rámci DSS      |        | z DSS do inej DSS |        | úmrčia |
|                        |                                 |                             |                                 |       |   |         | prírastky               | úbytky | prírastky         | úbytky |        |
| 1                      | 2                               | 3                           | 4                               | 5     | 6   | 7       | 8                       | 9      | 10                | 11     | 12     |
| 111903                 | 40260306                        | 1103                        | 57852                           | 54051 | 83933                                       | 27970   | 2255                    | 2553   | 565               | 1693   | 153    |

Dof (PAS) 31-02

### Výkaz pasív dôchodkového fondu

Názov dôchodkového fondu

Tradícia - Dlhopisový garantovaný dôchodkový fond NN d.s.s., a.s.

Identifikačný kód

S2203060010

Stav ku dňu

31.12.2016

| Označenie | Položka  | č. r. | Hodnota v tis. eur |
|-----------|--|-------|--------------------|
| a         | b  | c     | 1                  |
| <b>1.</b> | <b>Závazky</b>   | 1     | <b>1302</b>        |
| a)        | záväzky voči bankám  | 2     |                    |
| b)        | záväzky z ukončenia dôchodkového sporenia                      | 3     | 1086               |
| c)        | záväzky voči dôchodkovej správcovskej spoločnosti              | 4     | 146                |
| d)        | záväzky z derivátových operácií                                | 5     |                    |
| e)        | záväzky voči bankám z repoobchodov                             | 6     |                    |
| f)        | záväzky z vypožičania finančného majetku                       | 7     |                    |
|           | ostatné záväzky  | 8     | 70                 |
| <b>2.</b> | <b>Vlastné imanie</b>  | 9     | <b>575290</b>      |
| a)        | dôchodkové jednotky na osobných dôchodkových účtoch sporiteľov | 10    | 569404             |
|           | zisk alebo strata za účtovné obdobie                           | 11    | 5886               |
| <b>3.</b> | <b>Pasíva spolu</b>  | 12    | <b>576592</b>      |

## Výkaz výnosov a nákladov dôchodkového fondu

Názov dôchodkového fondu

Tradícia - Dlhopisový garantovaný dôchodkový fond NN d.s.s., a.s.

Identifikačný kód

S2203060010

Stav ku dňu

31.12.2016

| Označenie   | Položka  | č. r.     | Hodnota v tis. eur |
|-------------|--|-----------|--------------------|
| a           | b  | c         | 1                  |
| <b>1.</b>   | <b>Výnosy z úrokov a obdobné výnosy</b>                      | <b>1</b>  | <b>3598</b>        |
| a)          | z peňažných prostriedkov na bežnom účte                      | 2         | 15                 |
| b)          | z peňažných prostriedkov na vkladovom účte                   | 3         | 163                |
| c)          | z dlhopisov a obdobných dlhových cenných papierov            | 4         | 3420               |
| d)          | z nástrojov peňažného trhu                                   | 5         |                    |
| <b>2.</b>   | <b>Výnosy z podielových listov a obdobné výnosy</b>          | <b>6</b>  | <b>222</b>         |
| <b>3.</b>   | <b>Výnosy z dividend a iných podielov na zisku</b>           | <b>7</b>  |                    |
| <b>4.</b>   | <b>Výnosy z operácií s cennými papiermi a podielmi</b>       | <b>8</b>  | <b>5284</b>        |
| a)          | z kapitálových cenných papierov a obdobných cenných papierov | 9         |                    |
| b)          | z dlhopisov a iných dlhových cenných papierov                | 10        | 4499               |
| c)          | z nástrojov peňažného trhu                                   | 11        |                    |
| d)          | z podielových listov a obdobných cenných papierov            | 12        | 785                |
| <b>5.</b>   | <b>Náklady na operácie s cennými papiermi a podielmi</b>     | <b>13</b> | <b>204</b>         |
| a)          | kapitálové cenné papiere a obdobné cenné papiere             | 14        |                    |
| b)          | dlhopisy a iné dlhové cenné papiere                          | 15        | 204                |
| c)          | nástroje peňažného trhu                                      | 16        |                    |
| d)          | podielové listy a obdobné cenné papiere                      | 17        |                    |
| <b>6.</b>   | <b>Zisk/strata z operácií s cennými papiermi a podielmi</b>  | <b>18</b> | <b>5080</b>        |
| <b>7.</b>   | <b>Zisk/strata z operácií s devízami</b>                     | <b>19</b> |                    |
| <b>8.</b>   | <b>Zisk/strata z derivátov</b>                               | <b>20</b> |                    |
| <b>9.</b>   | <b>Zisk/strata z operácií s drahými kovmi</b>                | <b>21</b> |                    |
| <b>10.</b>  | <b>Zisk/strata z operácií s iným majetkom</b>                | <b>22</b> |                    |
| <b>I.</b>   | <b>Výnos z majetku</b>                                       | <b>23</b> | <b>8900</b>        |
| <b>11.</b>  | <b>Transakčné náklady</b>                                    | <b>24</b> | <b>21</b>          |
| a)          | náklady na transakcie s CP platené depozitárovi              | 25        | 18                 |
| b)          | poplatky pri nákupe a predaji CP platené tretej strane       | 26        | 3                  |
| <b>12.</b>  | <b>Bankové a iné poplatky</b>                                | <b>27</b> | <b>328</b>         |
| a)          | bankové odplaty a poplatky                                   | 28        |                    |
| b)          | burzové odplaty a poplatky                                   | 29        | 328                |
| <b>II.</b>  | <b>Čistý výnos z majetku vo fonde</b>                        | <b>30</b> | <b>8551</b>        |
| <b>13.</b>  | <b>Náklady na financovanie dôchodkového fondu</b>            | <b>31</b> |                    |
| <b>III.</b> | <b>Čistý zisk/strata zo správy majetku</b>                   | <b>32</b> | <b>8551</b>        |
| <b>14.</b>  | <b>Iné výnosy</b>  | <b>33</b> |                    |
| <b>15.</b>  | <b>Náklady na odplaty</b>                                    | <b>34</b> | <b>2665</b>        |
| a)          | náklady na odplatu za správu DF                              | 35        | 1681               |
| b)          | náklady na odplatu za zhodnotenie majetku v DF               | 36        | 824                |
| c)          | náklady na iné odplaty                                       | 37        | 160                |
| <b>IV.</b>  | <b>Zisk/strata dôchodkového fondu za účtovné obdobie</b>     | <b>38</b> | <b>5886</b>        |

## Skrátená verzia ročnej správy o hospodárení s majetkom v dôchodkovom fonde a polročnej správy o hospodárení s majetkom v dôchodkovom fonde

Názov dôchodkového fondu

Stav ku dňu

Tradícia - Dlhopisový garantovaný dôchodkový fond NN d.s.s., a.s.

31.12.2016

## Výkaz aktív a pasív dôchodkového fondu

| Označenie  | Položka   | č. r. | Hodnota v tis. eur<br>k 31.12.2016 | Hodnota v tis. eur<br>k 31.12.2015 | Hodnota v tis. eur<br>k 31.12.2014 |
|------------|---|-------|------------------------------------|------------------------------------|------------------------------------|
| <b>I.</b>  | <b>Investičný majetok</b>   | 1     | 565 057                            | 488 158                            | 560 329                            |
| <b>1.</b>  | <b>Dlhopisy oceňované umorovanou hodnotou</b>   | 2     | 0                                  | 0                                  | 0                                  |
| a)         | bez kupónov   | 3     | 0                                  | 0                                  | 0                                  |
| b)         | s kupónmi   | 4     | 0                                  | 0                                  | 0                                  |
| <b>2.</b>  | <b>Dlhopisy oceňované reálnou hodnotou</b>  | 5     | 452 845                            | 457 590                            | 417 602                            |
| a)         | bez kupónov   | 6     | 0                                  | 0                                  | 0                                  |
| b)         | s kupónmi   | 7     | 452 845                            | 457 590                            | 417 602                            |
| <b>3.</b>  | <b>Akcie a podiely v obchodných spoločnostiach</b>  | 8     | 0                                  | 0                                  | 0                                  |
| a)         | obchodovateľné  | 9     | 0                                  | 0                                  | 0                                  |
| b)         | neobchodovateľné  | 10    | 0                                  | 0                                  | 0                                  |
| c)         | podiely v obchodných spoločnostiach, ktoré nemajú formu ceného papiera                    | 11    | 0                                  | 0                                  | 0                                  |
| d)         | obstaranie neobchodovateľných akcií a podielov v obchodných spoločnostiach                | 12    | 0                                  | 0                                  | 0                                  |
| <b>4.</b>  | <b>Podielové listy</b>  | 13    | 64 087                             | 4 533                              | 0                                  |
| a)         | otvorených podielových fondov   | 14    | 64 087                             | 4 533                              | 0                                  |
| b)         | ostatné   | 15    | 0                                  | 0                                  | 0                                  |
| <b>5.</b>  | <b>Krátkodobé pohľadávky</b>  | 16    | 14                                 | 10                                 | 0                                  |
| a)         | krátkodobé vklady v bankách   | 17    | 14                                 | 10                                 | 0                                  |
| b)         | krátkodobé pôžičky obchodným spoločnostiam, v ktorých má dôchodkový fond majetkový podiel | 18    | 0                                  | 0                                  | 0                                  |
| c)         | iné   | 19    | 0                                  | 0                                  | 0                                  |
| d)         | obrátené repoobchody  | 20    | 0                                  | 0                                  | 0                                  |
| <b>6.</b>  | <b>Dlhodobé pohľadávky</b>  | 21    | 48 111                             | 26 025                             | 142 727                            |
| a)         | dlhodobé vklady v bankách   | 22    | 48 111                             | 26 025                             | 142 727                            |
| b)         | dlhodobé pôžičky obchodným spoločnostiam, v ktorých má dôchodkový fond majetkový podiel   | 23    | 0                                  | 0                                  | 0                                  |
| <b>7.</b>  | <b>Deriváty</b>   | 24    | 0                                  | 0                                  | 0                                  |
| <b>8.</b>  | <b>Drahé kovy</b>   | 25    | 0                                  | 0                                  | 0                                  |
| <b>II.</b> | <b>Neinvestičný majetok</b>   | 26    | 11 535                             | 54 825                             | 17 443                             |
| <b>9.</b>  | Peňažné prostriedky a ekvivalenty peňažných prostriedkov                                  | 27    | 11 535                             | 54 825                             | 17 443                             |
| <b>10.</b> | Ostatný majetok   | 28    | 0                                  | 0                                  | 0                                  |
|            | <b>Aktíva spolu</b>   | 29    | <b>576 592</b>                     | <b>542 983</b>                     | <b>577 772</b>                     |
| <b>I.</b>  | <b>Závazky</b>  | 30    | 1 302                              | 1 007                              | 560                                |
| 1.         | Závazky voči bankám   | 31    | 0                                  | 0                                  | 0                                  |
| 2.         | Závazky z ukončenia dôchodkového sporenia   | 32    | 1 086                              | 790                                | 353                                |
| 3.         | Závazky voči dôchodkovej správcovskej spoločnosti   | 33    | 146                                | 151                                | 147                                |
| 4.         | Závazky z derivátových operácií   | 34    | 0                                  | 0                                  | 0                                  |
| 5.         | Závazky z repoobchodov  | 35    | 0                                  | 0                                  | 0                                  |
| 6.         | Závazky z vypožičania finančného majetku  | 36    | 0                                  | 0                                  | 0                                  |
| 7.         | Ostatné záväzky   | 37    | 70                                 | 66                                 | 60                                 |
| <b>II.</b> | <b>Vlastné imanie</b>   | 38    | 575 290                            | 541 976                            | 577 212                            |
| 1.         | Dôchodkové jednotky na osobných dôchodkových účtoch sporiteľov, z toho                    | 39    | 575 290                            | 541 976                            | 577 212                            |
| a)         | zisk / strata za účtovné obdobie  | 40    | 5 886                              | 1 387                              | 6 854                              |
|            | <b>Pasíva spolu</b>   | 41    | <b>576 592</b>                     | <b>542 983</b>                     | <b>577 772</b>                     |

## Výkaz výnosov a nákladov dôchodkového fondu

| Označenie   | Položka  | č. r. | Hodnota v tis. eur<br>k 31.12.2016 | Hodnota v tis. eur<br>k 31.12.2015 | Hodnota v tis. eur<br>k 31.12.2014 |
|-------------|--|-------|------------------------------------|------------------------------------|------------------------------------|
| 1.          | Výnosy z úrokov  | 1     | 3 598                              | 4 444                              | 4 744                              |
| 2.          | Výnosy z podielových listov                                | 2     | 0                                  | 0                                  | 0                                  |
| 3.          | Výnosy z dividend a z iných podielov na zisku              | 3     | 222                                | 17                                 | 0                                  |
| 4.          | Zisk / strata z operácií s cennými papiermi                | 4     | 5 080                              | -656                               | 4 846                              |
| 5.          | Zisk / strata z operácií s devízami                        | 5     | 0                                  | 0                                  | 0                                  |
| 6.          | Zisk / strata z derivátov                                  | 6     | 0                                  | 0                                  | 0                                  |
| 7.          | Zisk / strata z operácií s drahými kovmi                   | 7     | 0                                  | 0                                  | 0                                  |
| 8.          | Zisk / strata z operácií s iným majetkom                   | 8     | 0                                  | 0                                  | 0                                  |
| <b>I.</b>   | <b>Výnos z majetku</b>                                     | 9     | <b>8 900</b>                       | <b>3 805</b>                       | <b>9 590</b>                       |
| 9.          | Transakčné náklady   | 10    | 21                                 | 3                                  | 2                                  |
| 10.         | Bankové a iné poplatky                                     | 11    | 328                                | 252                                | 168                                |
| <b>II.</b>  | <b>Čistý výnos z majetku</b>                               | 12    | <b>8 551</b>                       | <b>3 550</b>                       | <b>9 420</b>                       |
| 11.         | Náklady na financovanie dôchodkového fondu                 | 13    | 0                                  | 0                                  | 0                                  |
| <b>III.</b> | <b>Čistý zisk / strata zo správy majetku</b>               | 14    | <b>8 551</b>                       | <b>3 550</b>                       | <b>9 420</b>                       |
| 12.         | Náklady na odplaty   | 15    | 2 665                              | 2 163                              | 2 566                              |
| <b>IV.</b>  | <b>Zisk / strata dôchodkového fondu za účtovné obdobie</b> | 16    | <b>5 886</b>                       | <b>1 387</b>                       | <b>6 854</b>                       |