

VZOR

Hlásenie o najvýznamnejších skutočnostiach dôchodkového fondu

Názov dôchodkového fondu

BALANS-zmiešaný d.f., AEGON, d.s.s., a.s.

Identifikačný kód

2203060015

Stav ku dňu

31.12.2012

a) Informácie o najvýznamnejších skutočnostiach, ktoré ovplyvnili hospodárenie s majetkom v dôchodkovom fonde, informácie o jeho očakávanom vývoji v nasledujúcom období a použité metódy na meranie trhového rizika

Čistá hodnota majetku fondu dosiahla k 31.12.2012 hodnotu 117 422 733,81 EUR. Ťažiskom investícií boli predovšetkým štátne dlhopisy SR. Hodnota dôchodkovej jednotky v priebehu roka 2012 vzrástla o 3,63%. V roku 2012 prebehli viaceré legislatívne zmeny, pričom k tým najdôležitejším patrilo otvorenie druhého dôchodkového piliera a pokles sadzby príspevku na starobné dôchodkové sporenie z 9 na 4%. V roku 2013 očakávame významné presuny sporiteľov medzi jednotlivými dôchodkovými fondami a reštrukturalizáciu dôchodkových fondov. 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. Metóda bola použitá od 1.12.2012. Rozsah nameraných hodnôt je v intervale $<0,4 \% ; 0,5 \%$, priemer 0,48 %. Pákový efekt nebol použitý.

b) Grafické znázornenie vývoja hodnoty dôchodkovej jednotky

