

dôchodOK

ROČNÁ SPRÁVA 2012

VÚB Generali KLASIK
dlhopisový dôchodkový fond
VÚB Generali d. s. s., a. s.

VÚB GENERALI
DŮCHODKOVÁ SPRÁVCOVSKÁ SPOLOČNOSŤ, a. s.

Dof (PAS) 31-02

Strana 1/1

Výkaz pasív dôchodkového fondu

Názov dôchodkového fondu

KLASIK, dlhopisový d.f. VUB Generali d.s.s., a.s.

Identifikačný kód

2203060004

Stav ku dňu

31.12.2012

| Označenie | Položka | č. r. | Hodnota v tis. eur |
|-----------|--|-------|--------------------|
| a | b | c | 1 |
| 1. | Závazky | 1 | 12 |
| a) | záväzky voči bankám | 2 | 0 |
| b) | záväzky z ukončenia dôchodkového sporenia | 3 | 0 |
| c) | záväzky voči dôchodkovej správcovskej spoločnosti | 4 | 4 |
| d) | záväzky z derivátových operácií | 5 | 0 |
| e) | ostatné záväzky | 6 | 8 |
| 2. | Vlastné imanie | 7 | 147 121 |
| a) | dôchodkové jednotky na osobných dôchodkových účtoch sporiteľov | 8 | 147 121 |
| b) | dôchodkové jednotky na garančnom účte | 9 | 0 |
| 3. | Pasíva v dôchodkovom fonde celkom | 10 | 147 133 |

Meno a priezvisko osoby zodpovednej za výkaz:

Andrea Semancová

Telefónne číslo osoby zodpovednej za výkaz:

02/59338850

Meno a priezvisko osoby, ktorá výkaz vypracovala:

Jana Neumahrová

Telefónne číslo osoby, ktorá výkaz vypracovala:

02/59338848

Dof (VVN) 32-02

Strana 1/1

Výkaz výnosov a nákladov dôchodkového fondu

Názov dôchodkového fondu

KLASIK, dlhopisový d.f. VUB Generali d.s.s., a.s.

Identifikačný kód

2203060004

Stav ku dňu

31.12.2012

| Označenie | Položka | č. r. | Hodnota v tis. eur |
|------------|---|-----------|--------------------|
| a | b | c | 1 |
| 1. | Výnosy z úrokov a obdobné výnosy | 1 | 2 905 |
| a) | z peňažných prostriedkov na bežnom účte | 2 | 2 |
| b) | z peňažných prostriedkov na vkladovom účte | 3 | 1 393 |
| c) | z dlhopisov a obdobných dlhových cenných papierov | 4 | 1 510 |
| d) | z nástrojov peňažného trhu | 5 | 0 |
| 2. | Výnosy z kapitálových cenných papierov a obdobné výnosy | 6 | 0 |
| 3. | Výnosy z podielových listov a obdobné výnosy | 7 | 2 |
| 4. | Výnosy z operácií s cennými papiermi | 8 | 1 605 |
| a) | z kapitálových cenných papierov a obdobných cenných papierov | 9 | 0 |
| b) | z dlhopisov a iných dlhových cenných papierov | 10 | 1 581 |
| c) | z nástrojov peňažného trhu | 11 | 0 |
| d) | z podielových listov a obdobných cenných papierov | 12 | 24 |
| 5. | Náklady na operácie s cennými papiermi | 13 | 167 |
| a) | kapitálové cenné papiere a obdobné cenné papiere | 14 | 0 |
| b) | dlhopisy a iné dlhové cenné papiere | 15 | 151 |
| c) | nástroje peňažného trhu | 16 | 0 |
| d) | podielové listy a obdobné cenné papiere | 17 | 16 |
| 6. | Zisk/strata z operácií s cennými papiermi | 18 | 1 438 |
| 7. | Zisk/strata z obchodov určených na obmedzenie devízového rizika | 19 | 0 |
| a) | swapy | 20 | 0 |
| b) | forwardy | 21 | 0 |
| c) | opcie | 22 | 0 |
| 8. | Zisk/strata z devízových operácií | 23 | 0 |
| 9. | Zisk/strata z predaja iného majetku | 24 | 0 |
| 10. | Iné výnosy | 25 | 0 |
| a) | výnosy z rozpustenia prostriedkov na garančnom účte | 26 | 0 |
| b) | výnosy z majetku doplneného zo zdrojov dôchodkovej správcovskej spoločnosti | 27 | 0 |
| c) | ostatné výnosy | 28 | 0 |
| 11. | Iné náklady | 29 | 510 |
| 12. | Náklady na dane vzťahujúce sa na majetok v dôchodkovom fonde | 30 | 2 |
| 13. | Zisk/strata za účtovné obdobie | 31 | 3 833 |

Meno a priezvisko osoby zodpovednej za výkaz:

Andrea Semancová

Telefónne číslo osoby zodpovednej za výkaz:

02/59338850

Meno a priezvisko osoby, ktorá výkaz vypracovala:

Jana Neumahrová

Telefónne číslo osoby, ktorá výkaz vypracovala:

02/59338848

Hlásenie o najvýznamnejších skutočnostiach dôchodkového fondu

Názov dôchodkového fondu

KLASIK, dlhopisový d.f. VÚB Generali d.s.s., a.s.

Identifikačný kód

2203060004

Stav ku dňu

31.12.2012

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

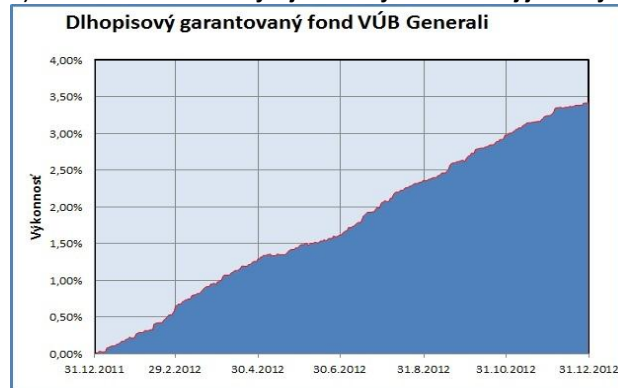
Hospodárenie s majetkom v dôchodkovom fonde VÚB Generali Klasik bolo ovplyvnené predovšetkým vývojom úrokových sadzieb, zmenou tvaru výnosovej krivky a pohybom rizikových premií. Swapová krivka sa posunula nadol pozdĺž všetkých splatností v priemere o 50-70bps, čo prispelo k nárastu cien dlhových cenných papierov. Vývoj rizikových prírážok nebol počas roka taký jednosmerný ako v prípade úrokovej zložky, a to najmä pre zvýšenú rizikovú averziu v letných mesiacoch. Na celoročnej báze však aj tieto faktory prispeli k nárastu cien finančných a korporátnych dlhopisov. V budúcom roku očakávame nízke úrokové prostredie, s postupným nárastom sadzieb.

Dodatočné informácie k výpočtu rizika počas príslušného obdobia

| | |
|---|--|
| Použitý prístup k výpočtu celkového rizika: | prístup hodnoty v riziku (VaR) |
| Metóda výpočtu: | parametrická |
| Jednostranný interval spoľahlivosti: | 99% |
| Obdobie výpočtu VaR (holding period): | 10 obchodných dní |
| dlhopisový fond | metóda absolútnej VaR |
| Obdobie pozorovaní: | 1 kalendárny rok (cca. 250 pracovných dní) |
| Frekvencia výpočtu: | denne |
| Mena výpočtu: | EUR |
| Úroveň pákového efektu vo fondoch: | minimálna |

| Obdobie 30.12.2011 - 31.12.2012 | Hodnota | Absolútna VaR [%] | Relatívna VaR [%] | Využitie VaR limitu | Modifikova ná dĺžka portfólia | MD zahŕňajúca termínované vklady | MD dlhopisovej časti |
|------------------------------------|------------|----------------------|----------------------|------------------------|-------------------------------------|---|----------------------------|
| Klasik | 31.12.2012 | 0,07% | | | 0,558 | 0,855 | 0,946 |
| | max | 0,11% | | | 0,616 | 0,895 | 1,019 |
| | avg | 0,07% | | | 0,480 | 0,658 | 0,797 |
| | min | 0,04% | | | 0,281 | 0,391 | 0,522 |

b) Grafické znázornenie vývoja hodnoty dôchodkovej jednotky



Meno a priezvisko osoby zodpovednej za výkaz:

Vladimír Mlynek

Telefónne číslo osoby zodpovednej za výkaz:

02/59338823

Meno a priezvisko osoby, ktorá výkaz vypracovala:

Ján Švač

Telefónne číslo osoby, ktorá výkaz vypracovala:

02/59338825

Dof (SP) 17-02

Strana 1/1

Hlásenie o vývoji počtu sporiteľov

Názov dôchodkového fondu

KLASIK, dlhopisový d.f. VUB Generali d.s.s., a.s.

Identifikačný kód

2203060004

Stav ku dňu

31.12.2012

| Počet sporiteľov spolu | Objem príspevkov v eurách spolu | Objem penále v eurách spolu | Počet sporiteľov podľa pohlavia | | Počet sporiteľov podľa spôsobu | | Zmena stavov sporiteľov | | | | |
|------------------------|---------------------------------|-----------------------------|---------------------------------|--------|--------------------------------|---------|-------------------------|--------|-------------------|--------|--------|
| | | | muži | ženy | aktívny | pasívny | medzi DF vrátenci DSS | | z DSS do inej DSS | | úmrčia |
| | | | | | | | prírastky | úbytky | prírastky | úbytky | |
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 | 8 | 9 | 10 | 11 | 12 |
| 35 376 | 19 322 192 | 1 512 | 17 104 | 18 272 | 27 188 | 8 188 | 25 527 | 34 | 2 766 | 612 | 33 |

Meno a priezvisko osoby zodpovednej za výkaz:

Beáta Haramiová

Telefónne číslo osoby zodpovednej za výkaz:

02/59338828

Meno a priezvisko osoby, ktorá výkaz vypracovala:

Henrich Matuška

Telefónne číslo osoby, ktorá výkaz vypracovala:

02/59338884

! druhy majetku sa upravujú podľa platného znenia zákona, uvedené platí aj pre ostatné časti prílohy

Dof (HMF) 03-02

Strana 1/5

Hlásenie o stave majetku v dôchodkovom fonde

Názov dôchodkového fondu

KLASIK, dlhopisový d.f. VUB Generali d.s.s., a.s.

Identifikačný kód

2203060004

Stav ku dňu

31.12.2012

Členenie podľa trhov

| Druh majetku | Členenie | č.r. | Hodnota v tis. eur | Podiel na majetku v dôchodkovom fonde 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 | | |
| | Prijaté na obchodovanie na trhu kótovaných cenných papierov zahraničnej burzy cenných papierov so sídlom v členskom štáte | 2 | | |
| | 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 | | |
| | 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 zrejmé, že sa toto prijatie uskutoční do jedného roka od dátumu vydania emisie cenných papierov | 4 | | |
| Dlhové cenné papiere | Prijaté na obchodovanie na trhu kótovaných cenných papierov burzy cenných papierov | 5 | 35 272 | 23,9729 |
| | Prijaté na obchodovanie na trhu kótovaných cenných papierov zahraničnej burzy cenných papierov so sídlom v členskom štáte | 6 | 48 185 | 32,7493 |
| | 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 | | |
| | 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 zrejmé, že sa toto prijatie uskutoční do jedného roka od dátumu vydania emisie cenných papierov | 8 | 2 140 | 1,4545 |
| 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 | | |
| | Prijaté na obchodovanie na trhu kótovaných cenných papierov zahraničnej burzy cenných papierov so sídlom v členskom štáte | 10 | | |
| | 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 | | |
| | 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 zrejmé, že sa toto prijatie uskutoční do jedného roka od dátumu vydania emisie cenných papierov | 12 | | |
| Cenné papiere iných zahraničných subjektov kolektívneho investovania podľa § 81 ods. 1 písm. d) zákona | Prijaté na obchodovanie na trhu kótovaných cenných papierov burzy cenných papierov | 13 | | |
| | Prijaté na obchodovanie na trhu kótovaných cenných papierov zahraničnej burzy cenných papierov so sídlom v členskom štáte | 14 | 1 216 | 0,8265 |
| | 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 | | |
| | 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 zrejmé, že sa toto prijatie uskutoční do jedného roka od dátumu vydania emisie cenných papierov | 16 | | |
| Nástroje peňažného trhu podľa § 81 ods. 1 písm. e) zákona | Vydané alebo zaručené Ministerstvom financií SR alebo Národnou bankou Slovenska | 17 | | |
| | Vydané alebo zaručené členským štátom a jeho centrálnymi orgánmi | 18 | | |
| | Vydané alebo zaručené centrálnou bankou členského štátu | 19 | | |
| | Vydané alebo zaručené orgánmi miestnej správy členského štátu | 20 | | |
| | Vydané alebo zaručené ECB, EÚ, EIB, IBRD, IFA, CEB, IADB, ADB, AFDB, CDB, NIB, EBRD, EIF, IMF, BIS, MIGA | 21 | | |
| | Vydané alebo zaručené emitentom, ktorého cenné papiere boli prijaté na obchodovanie na regulovanom trhu | 22 | | |
| | 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 | | |
| Bežné účty a vkladové účty podľa § 81 ods. 1 písm. f) zákona | Peňažné prostriedky na bežnom účte u depozitára | 24 | 5 661 | 3,8475 |
| | Peňažné prostriedky na vkladovom účte u depozitára | 25 | | |
| | Peňažné prostriedky na bežných účtoch v bankách alebo pobočkách zahraničných bánk so sídlom v Slovenskej republike, v inom členskom štáte alebo nečlenskom štáte, ak táto banka alebo pobočka zahraničnej banky podlieha dohľadu | 26 | | |
| | Peňažné prostriedky na vkladových účtoch v bankách alebo pobočkách zahraničných bánk so sídlom v Slovenskej republike, v inom členskom štáte alebo nečlenskom štáte, ak táto banka alebo pobočka zahraničnej banky podlieha dohľadu | 27 | 54 651 | 37,1439 |
| Obchody na obmedzenie devízového rizika podľa § 81 ods. 1 písm. g) zákona | 28 | | | |
| Cenné papiere, ktoré prestali byť obchodované na regulovanom trhu cenných papierov podľa § 83 ods. 1 zákona | 29 | | | |
| Cenné papiere z nových emisií, ktoré nespĺnili podmienku podľa § 81 ods. 1 písm. b) zákona a neboli prijaté na obchodovanie do 1 roka | 30 | | | |
| Iný majetok | 31 | | | |
| Objem pohľadávok dôchodkového fondu celkom | 32 | 8 | 0,0054 | |
| Hodnota majetku v dôchodkovom fonde | 33 | 147 133 | 100,0000 | |
| Objem záväzkov dôchodkového fondu celkom | 34 | 12 | 0,0082 | |
| Čistá hodnota majetku v dôchodkovom fonde | 35 | 147 121 | 99,9918 | |

Hlásenie o stave majetku v dôchodkovom фонде

Názov dôchodkového fondu

KLASIK, dlhopisový d.f. VUB Generali d.s.s., a.s.

Identifikačný kód

2203060004

Stav ku dňu

31.12.2012

Členenie podľa emitentov

| čís.r. | Emitenti/Banky | Spolu | | Kapitálové CP a obdobné CP | | Dlhové CP | | PL OPF a CP ZSKI | | CP IZSKI | | NPT | | BÚ a VÚ | | Obchody na obmedzenie devizového 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 | 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 |
| 1 | CELKOM | 147 133 | 100,0000 | | | 85 597 | 58,1766 | | | | | | | 60 312 | 40,9915 | | | | | 8 | 0,0054 |
| 2 | ABN Amro Bank N.V. | 1 060 | 0,7204 | | | 1 060 | 0,7204 | | | | | | | | | | | | | | |
| 3 | Audová banka/Volksbank Slovensko | 498 | 0,3385 | | | 498 | 0,3385 | | | | | | | | | | | | | | |
| 4 | Bank of Scotland PLC | 2 318 | 1,5755 | | | 2 318 | 1,5755 | | | | | | | | | | | | | | |
| 5 | Barclays Bank plc | 1 730 | 1,1758 | | | 1 730 | 1,1758 | | | | | | | | | | | | | | |
| 6 | BBVA Senior Finance, S.A. Unipersonal | 1 036 | 0,7041 | | | 1 036 | 0,7041 | | | | | | | | | | | | | | |
| 7 | Bear Stearns | 98 | 0,0666 | | | 98 | 0,0666 | | | | | | | | | | | | | | |
| 8 | Bonos y Oblig Del Estado | 509 | 0,3460 | | | 509 | 0,3460 | | | | | | | | | | | | | | |
| 9 | Buoni Poliennali Del Tesoro | 2 870 | 1,9506 | | | 2 870 | 1,9506 | | | | | | | | | | | | | | |
| 10 | CITIGROUP INC. | 3 298 | 2,2415 | | | 3 298 | 2,2415 | | | | | | | | | | | | | | |
| 11 | Commerzbank AG | 3 072 | 2,0879 | | | 3 072 | 2,0879 | | | | | | | | | | | | | | |
| 12 | Credit Suisse London | 423 | 0,2875 | | | 423 | 0,2875 | | | | | | | | | | | | | | |
| 13 | Česká exportní banka, a.s. | 1 695 | 1,1520 | | | 1 695 | 1,1520 | | | | | | | | | | | | | | |
| 14 | Československá obchodní banka (KBC Bank) | 2 054 | 1,3960 | | | 333 | 0,2263 | | | | | | | 1 721 | 1,1697 | | | | | | |
| 15 | Danske Bank A/S | 2 240 | 1,5224 | | | 2 240 | 1,5224 | | | | | | | | | | | | | | |
| 16 | EESTI ENERGIA AS | 1 308 | 0,8890 | | | 1 308 | 0,8890 | | | | | | | | | | | | | | |
| 17 | Erste Group Bank AG | 2 234 | 1,5184 | | | 2 234 | 1,5184 | | | | | | | | | | | | | | |
| 18 | General Electric Corp | 126 | 0,0856 | | | 126 | 0,0856 | | | | | | | | | | | | | | |
| 19 | Goldman Sachs | 3 561 | 2,4203 | | | 3 561 | 2,4203 | | | | | | | | | | | | | | |
| 20 | Government of Romania | 1 326 | 0,9012 | | | 1 326 | 0,9012 | | | | | | | | | | | | | | |
| 21 | ING Group N.V. | 3 283 | 2,2313 | | | 3 283 | 2,2313 | | | | | | | | | | | | | | |
| 22 | KBC IFIMA NV | 3 318 | 2,2551 | | | 3 318 | 2,2551 | | | | | | | | | | | | | | |
| 23 | LLOYDS TSB BANK PLC | 1 394 | 0,9474 | | | 1 394 | 0,9474 | | | | | | | | | | | | | | |
| 24 | MFSR | 29 670 | 20,1654 | | | 29 670 | 20,1654 | | | | | | | | | | | | | | |
| 25 | Ministerstvo financii Polsko | 1 682 | 1,1432 | | | 1 682 | 1,1432 | | | | | | | | | | | | | | |
| 26 | National Australia Bank Limited | 771 | 0,5240 | | | 771 | 0,5240 | | | | | | | | | | | | | | |
| 27 | Nordea Bank AB | 270 | 0,1835 | | | 270 | 0,1835 | | | | | | | | | | | | | | |
| 28 | OTP Banka Slovensko, a.s. | 164 | 0,1115 | | | 164 | 0,1115 | | | | | | | | | | | | | | |
| 29 | Rabobank Nederland | 296 | 0,2012 | | | 296 | 0,2012 | | | | | | | | | | | | | | |
| 30 | Raiffeisen Bank | 1 805 | 1,2268 | | | 1 805 | 1,2268 | | | | | | | | | | | | | | |
| 31 | Republic of Lithuania | 2 957 | 2,0098 | | | 2 957 | 2,0098 | | | | | | | | | | | | | | |
| 32 | Santander International Debt, S.A. Unipe | 1 049 | 0,7130 | | | 1 049 | 0,7130 | | | | | | | | | | | | | | |
| 33 | SID Banka | 148 | 0,1006 | | | 148 | 0,1006 | | | | | | | | | | | | | | |
| 34 | Slovenská sporiteľňa (Erste Bank) | 3 415 | 2,3210 | | | 3 415 | 2,3210 | | | | | | | | | | | | | | |
| 35 | Societe Generale | 780 | 0,5301 | | | 780 | 0,5301 | | | | | | | | | | | | | | |
| 36 | Tatra Banka, a.s. | 3 332 | 2,2646 | | | 3 332 | 2,2646 | | | | | | | | | | | | | | |
| 37 | UBS AG | 527 | 0,3582 | | | 527 | 0,3582 | | | | | | | | | | | | | | |
| 38 | UniCredit S.p.A | 1 001 | 0,6803 | | | 1 001 | 0,6803 | | | | | | | | | | | | | | |
| 39 | iShares plc | 628 | 0,4268 | | | | | | | 628 | 0,4268 | | | | | | | | | | |
| 40 | iShares II plc | 588 | 0,3996 | | | | | | | 588 | 0,3996 | | | | | | | | | | |
| 41 | Banka Sparkasse SI d.d. | 7 268 | 4,9398 | | | | | | | | | | | 7 268 | 4,9398 | | | | | | |
| 42 | Unicredit Bulharsko | 6 618 | 4,4980 | | | | | | | | | | | 6 618 | 4,4980 | | | | | | |
| 43 | Banka Koper d.d. | 10 522 | 7,1514 | | | | | | | | | | | 10 522 | 7,1514 | | | | | | |
| 44 | Intesa Sanpaolo Romania S.A. | 14 012 | 9,5234 | | | | | | | | | | | 14 012 | 9,5234 | | | | | | |
| 45 | Raiffeisen Banka SI d.d. | 12 458 | 8,4672 | | | | | | | | | | | 12 458 | 8,4672 | | | | | | |
| 46 | Všeobecná úverová banka | 2 052 | 1,3947 | | | | | | | | | | | 2 052 | 1,3947 | | | | | | |
| 47 | ING Bank NV, pob. zahr. banky | 5 661 | 3,8475 | | | | | | | | | | | 5 661 | 3,8475 | | | | | | |
| 48 | KLASIK, dlhopisový d.f. VUB Generali d.s.s., a.s. | 8 | 0,0054 | | | | | | | | | | | | | | | | | 8 | 0,0054 |

Hlásenie o stave majetku v dôchodkovom fonde

Názov dôchodkového fondu

KLASIK, dlhopisový d.f. VÚB Generali d.s.s., a.s.

Identifikačný kód

2203060004

Stav ku dňu

31.12.2012

Členenie podľa menového hľadiska

| č.r. | Zostatková fixácia úrokových mier | Spolu | | Kapitálové CP a obdobné CP | | Dlhové CP | | PL OPF a CP ZSKI | | CP IZSKI | | NPT | | BÚ a VÚ | | Obchody na obmedzenie devízového 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 | 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 | 8 | 9 | 10 | 11 | 12 | 13 | 14 | 15 | 16 | 17 | 18 | 19 | 20 | 21 |
| 1 | Majetok denominovaný v EUR | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 2 | na požiadanie a do 1 mesiaca vrátane | 7 873 | 5,3509 | | | 2 204 | 1,4980 | | | | | | | 5 661 | 3,8475 | | | | | | 8 | 0,0054 |
| 3 | od 1 do 3 mesiacov vrátane | 29 434 | 20,0050 | | | 6 883 | 4,6781 | | | | | | | 22 551 | 15,3270 | | | | | | | |
| 4 | od 3 do 6 mesiacov vrátane | 15 690 | 10,6638 | | | 2 753 | 1,8711 | | | | | | | 12 937 | 8,7927 | | | | | | | |
| 5 | od 6 mesiacov do 1 roka vrátane | 31 324 | 21,2896 | | | 14 213 | 9,6600 | | | | | | | 17 111 | 11,6296 | | | | | | | |
| 6 | od 1 do 3 rokov vrátane | 38 670 | 26,2823 | | | 36 618 | 24,8877 | | | | | | | 2 052 | 1,3947 | | | | | | | |
| 7 | od 3 do 5 rokov vrátane | 20 227 | 13,7474 | | | 20 227 | 13,7474 | | | | | | | | | | | | | | | |
| 8 | od 5 do 10 rokov vrátane | 2 699 | 1,8344 | | | 2 699 | 1,8344 | | | | | | | | | | | | | | | |
| 9 | od 10 do 15 rokov vrátane | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 10 | nad 15 rokov | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 11 | nedefinované | 1 216 | 0,8265 | | | | | | | 1 216 | 0,8265 | | | | | | | | | | | |
| 12 | CELKOM | 147 133 | 100,0000 | | | 85 597 | 58,1766 | | | 1 216 | 0,8265 | | | 60 312 | 40,9915 | | | | | | 8 | 0,0054 |

Meno a priezvisko osoby zodpovednej za výkaz:

Beáta Haramiová

Telefónne číslo osoby zodpovednej za výkaz:

02/59338828

Meno a priezvisko osoby, ktorá výkaz vypracovala:

Edita Marková

Telefónne číslo osoby, ktorá výkaz vypracovala:

02/59338826

Skrátená verzia ročnej správy o hospodárení s majetkom v dôchodkovom fonde
KLASIK, dlhopisový dôchodkový fond VÚB Generali dôchodková správcovská spoločnosť, a.s. ku dňu 31.12.2012

VÝKAZ AKTÍV A PASÍV DÔCHODKOVÉHO FONDU

| Ozna- čenie | Položka | Hodnota | Hodnota | Hodnota |
|---|---|----------------------------|----------------------------|----------------------------|
| | | v tis. Eur k 31.12.2012 | v tis. Eur k 31.12.2011 | v tis. Eur k 31.12.2010 |
| I. | Investičný majetok | 141 464 | 41 957 | 32 392 |
| 1. | Dlhopisy | 85 597 | 24 944 | 21 319 |
| a) | bez kupónov | 2 482 | 100 | 4 840 |
| b) | s kupónmi | 83 115 | 24 844 | 16 479 |
| 2. | Akcie | 1 216 | | |
| 3. | Podielové listy | | | |
| a) | otvorených podielových fondov | | | |
| b) | ostatné | | | |
| 4. | Krátkodobé pohľadávky | 52 599 | 13 863 | 7 924 |
| 5. | Dlhodobé pohľadávky | 2 052 | 3 150 | 3 149 |
| 6. | Deriváty | | | |
| II. | Neinvestičný majetok | 5 669 | 904 | 58 |
| 7. | Peňažné prostriedky a ekvivalenty peňažných prostriedkov | 5 661 | 901 | 58 |
| 8. | Ostatný majetok | 8 | 3 | |
| Aktíva v dôchodkovom fonde spolu | | 147 133 | 42 861 | 32 450 |
| I. | Závazky | 12 | 3 | 3 |
| 1. | Závazky voči bankám | | | |
| 2. | Závazky z ukončenia dôchodkového sporenia | | | |
| 3. | Závazky voči dôchodkovej správcovskej spoločnosti | 4 | 3 | 3 |
| 4. | Závazky z derivátových operácií | | | |
| 5. | Ostatné záväzky | 8 | | |
| II. | Vlastné imanie | 147 121 | 42 858 | 32 447 |
| 1. | Dôchodkové jednotky na osobných dôchodkových účtoch sporiťel'ov | 147 121 | 42 828 | 32 424 |
| 2. | Dôchodkové jednotky na garančnom účte | | 30 | 23 |
| Pasíva v dôchodkovom fonde spolu | | 147 133 | 42 861 | 32 450 |

**Skrátená verzia ročnej správy o hospodárení s majetkom v dôchodkovom fonde
 KLASIK, dlhopisový dôchodkový fond VÚB Generali dôchodková správcovská spoločnosť, a.s. ku dňu 31.12.2012**

VÝKAZ VÝNOSOV A NÁKLADOV DÔCHODKOVÉHO FONDU

| Ozna- čenie | Položka | Hodnota v tis. Eur k 31.12.2012 | Hodnota v tis. Eur k 31.12.2011 | Hodnota v tis. Eur k 31.12.2010 |
|----------------|---|---------------------------------------|---------------------------------------|---------------------------------------|
| 1. | Výnosy z úrokov | 2 905 | 903 | 644 |
| 2. | Výnosy z podielových listov | | | |
| 3. | Výnosy z dividend | 2 | | |
| 4.a | Čistý zisk/(strata) z operácií s cennými papiermi | 8 | -21 | -62 |
| 5.b | Čistý zisk/(strata) z devízových operácií | | | |
| 6.c | Čistý zisk/(strata) z derivátových operácií | | | |
| 7.d | Čistý zisk/(strata) z operácií s iným majetkom | | | |
| 8.e | Čistý zisk/(strata) z precenenia cenných papierov | 1 430 | -127 | -57 |
| II. | Čistý výnos z majetku vo fonde | 4 345 | 755 | 525 |
| f | Náklady (na financovanie fondu) | 510 | | |
| III. | Čistý zisk/(strata) zo správy majetku vo fonde | 3 835 | 755 | 525 |
| g | Dane | 2 | | 1 |
| IV. | Zisk/(strata) dôchodkového fondu | 3 833 | 755 | 524 |