

**Ročná správa o hospodárení s majetkom
v dôchodkovom fonde**

k 31.12.2017

**PROGRES akciový negarantovaný
dôchodkový fond, Allianz - Slovenská d.s.s., a.s.**

Allianz - Slovenská d.s.s., a. s.

Račianska 62
831 02 Bratislava
Slovensko
IČO: 35 901 624
DIČ: 2021880322

**Ročná správa dôchodkovej správcovskej spoločnosti Allianz - Slovenská d.s.s., a. s.
o hospodárení s majetkom v dôchodkovom fonde PROGRES akciový negarantovaný d.f.
k 31.12.2017**

Príloha č. 6 k opatreniu č. 229/2016 Z. z.

Dof (HNS) 28-02

Strana 1/3

Hlásenie o najvýznamnejších skutočnostiach dôchodkového fondu

Názov dôchodkového fondu

PROGRES akciový negarantovaný dôchodkový fond, Allianz - Slovenská d.s.s., a.s.

Identifikačný kód

2203060011

Stav ku dňu

31.12.2017

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

Vývoj hospodárenia s majetkom v dôchodkovom fonde najvýraznejšie ovplyvnili nasledujúce skutočnosti:

1. Zloženie majetku fondu

- a) postupné mierné zníženie podielu akciových investícií počas prvého polroka a udržiavanie tohto stavu do konca roku
- b) postupné navýšenie a udržiavanie vyššieho podielu hotovosti na bežnom účte fondu
- c) udržiavanie stabilnej regionálnej štruktúry akciovej zložky
- d) udržiavanie nízkeho podielu investícií do zlata (okolo 3%).

2. Trhový vývoj

- a) masívny kontinuálny rast akciových trhov počas celého roka
- b) rast amerických a rozvíjajúcich sa trhov prekonal vývoj na európskom a japonskom akciovom trhu
- c) po raste ceny zlata do polovice septembra došlo ku korekcii a miernemu poklesu
- d) výrazné posilnenie eura voči menám (USD a JPY), v ktorých je denominovaná časť akciového portfólia fondu.

Očakávaný vývoj v nasledujúcom kalendárnom roku

Nadalej plánujeme udržiavať súčasný podiel akciových investícií na majetku fondu. Najvýznamnejším faktorom vyvolávajúcim prípadnú zmenu pomeru akciových investícií a podielu hotovosti je vývoj na akciových trhoch a vývoj výmenného kurzu EUR voči menám, v ktorých bude denominované portfólio fondu. V legislatívnej oblasti očakávame

Typ a rozsah uskutočnených obchodov určených na obmedzenie menového rizika v dôchodkovom fonde

V majetku fondu neboli realizované transakcie na obmedzenie menového rizika.

Výkon hlasovacích práv spojených s cennými papiermi v majetku v dôchodkovom fonde

V sledovanom období sa nerealizovali hlasovacie práva.

Názov dôchodkového fondu

PROGRES akciový negarantovaný dôchodkový fond, Allianz - Slovenská d.s.s., a.s.

Identifikačný kód

2203060011

Stav ku dňu

31.12.2017

2. Grafické znázornenie vývoja hodnoty dôchodkovej jednotky



Názov dôchodkového fondu

PROGRES akciový negarantovaný dôchodkový fond, Allianz - Slovenská d.s.s., a.s.

Identifikačný kód

2203060011

Stav ku dňu

31.12.2017

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

Spoločnosť v roku 2017 nerealizovala zmenu VaR modelu. Dátové súbory sú aktualizované na týždennej báze a výpočet VaR sa realizuje na dennej báze (pracovné dni).

Dôchodková správcovská spoločnosť na účely merania a výpočtu trhového rizika v majetku dôchodkového fondu používa metódu hodnoty v riziku, s jednostranným intervalom spoľahlivosti 99%, s časovým horizontom 1 deň, 5 dní a 22 dní. Dátové súbory sú aktualizované každý pracovný deň, štatistiky pre odvodzovanie VaR sú rátané na týždennej báze a výpočet VaR je uskutočnený minimálne raz denne. Pozorovacie obdobie sú tri roky.

Celkové riziko je merané a vypočítané v majetku dôchodkového fondu metódou hodnoty v riziku. Použitá metóda je metóda absolútnej hodnoty v riziku. Fondy neboli vystavené pákovému efektu.

Hodnody VaR z NAV (využitie limitu):

Limit	Min VaR	Max VaR	Priemerné VaR
15% z ČSH, NAV	7,22% (48,13%)	7,95% (53,02%)	7,49% (49,92%)

Hlásenie o stave majetku v dôchodkovom fonde

Názov dôchodkového fondu

PROGRES akciový negarantovaný dôchodkový fond, Allianz - Slovenská d.s.s., a.s.

Identifikačný kód

S2203060011

Stav ku dňu

31.12.2017

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		0,0000
	Prijaté na obchodovanie na trhu kótovaných cenných papierov zahraničnej burzy cenných papierov so sídlom v členskom štáte	2	109 183	27,7673
	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 zrejmé, 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		0,0000
	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	1 261	0,3207
	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		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	79 362	20,1833
	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
	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		0,0000
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		0,0000
	Prijaté na obchodovanie na trhu kótovaných cenných papierov zahraničnej burzy cenných papierov so sídlom v členskom štáte	14	79 557	20,2329
	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
	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		0,0000
Nástroje peňažného trhu podľa § 81 ods. 1 písm. e) zákona	Vydané alebo zaručené Ministerstvom financií SR alebo Národnou bankou Slovenska	17		0,0000
	Vydané alebo zaručené členským štátom 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
	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
Peňažné prostriedky na bežných účtoch a vkladových účtoch podľa § 81 ods. 1 písm. f) zákona	na bežnom účte u depozitára	24	25 551	6,4981
	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		0,0000
	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	14 001	3,5607
Pohľadávky a záväzky vznikajúce pri obchodoch určených výlučne na obmedzenie úrokového rizika, menového rizika alebo iného rizika podľa § 81 ods. 1 písm. g) zákona	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 nespĺňajú podmienku podľa § 81 ods. 1 písm. b) zákona a neboli prijaté na obchodovanie na regulovanom trhu do 1 roka	30	72 697	18,4882	
Cenné papiere, ktoré nie sú prijaté na obchodovanie na regulovanom trhu	31		0,0000	
Iný majetok	32	11 508	2,9267	
Objem pohľadávok dôchodkového fondu celkom	33	87	0,0221	
Hodnota majetku v dôchodkovom fonde	34	393 207	100,0000	
Objem záväzkov dôchodkového fondu celkom	35	2 328	0,5921	
Čistá hodnota majetku v dôchodkovom fonde	36	390 879	99,4079	

Názov dôchodkového fondu

PROGRES akciový negarantovaný dôchodkový fond, Allianz - Slovenská d.s.s., a.s.

Identifikačný kód

S2203060011

Stav ku dňu

31.12.2017

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 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 %	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
73	MasterCard Inc	1 082	0,2752	1 082	0,2752	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000		0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000
74	McDonald's Corporation	1 131	0,2876	1 131	0,2876	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000		0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000
75	Medtronic Plc	839	0,2134	835	0,2124	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000		0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	4	0,0010
76	Merck & Co. Inc	1 149	0,2922	1 141	0,2902	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000		0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	8	0,0020
77	MetLife, Inc.	403	0,1025	403	0,1025	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000		0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000
78	Microsoft Corp.	4 948	1,2584	4 948	1,2584	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000		0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000
79	Mondelez International Inc	497	0,1264	495	0,1259	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000		0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	2	0,0005
80	Monsanto Company	380	0,0966	380	0,0966	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000		0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000
81	Morgan Stanley	581	0,1478	581	0,1478	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000		0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000
82	NEXTERA ENERGY INC	527	0,1340	527	0,1340	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000		0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000
83	NIKE, Inc.	616	0,1567	614	0,1562	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000		0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	2	0,0005
84	Nomura Asset Management Co., Ltd.Nomura ETF	29 461	7,4925	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	29 461	7,4925		0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000
85	Occidental Petroleum Corporation	412	0,1048	408	0,1038	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000		0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	4	0,0010
86	Oracle Corp.	1 094	0,2782	1 094	0,2782	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000		0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000
87	PAYPAL HOLDINGS INC	597	0,1518	597	0,1518	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000		0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000
88	PepsiCo, Inc.	1 275	0,3243	1 268	0,3225	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000		0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	7	0,0018
89	Pfizer Inc.	1 607	0,4087	1 607	0,4087	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000		0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000
90	Philip Morris International Inc.	1 207	0,3070	1 197	0,3044	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000		0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	10	0,0025
91	Pictet Index EuropePictet Funds Europe	2 304	0,5860	0	0,0000	0	0,0000	2 304	0,5860	0	0,0000		0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000
92	Priceline.com	623	0,1584	623	0,1584	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000		0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000
93	Qualcomm Inc.	698	0,1775	698	0,1775	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000		0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000
94	Raytheon Company	410	0,1043	410	0,1043	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000		0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000
95	Schlumberger Limited	690	0,1755	685	0,1742	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000		0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	5	0,0013
96	Simon Property Group, Inc	392	0,0997	392	0,0997	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000		0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000
97	Source Markets PLCMSCI Europe	31 546	8,0227	0	0,0000	0	0,0000	31 546	8,0227	0	0,0000		0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000
98	Source Physical Markets PLC	11 508	2,9267	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000		0,0000	0	0,0000	0	0,0000	11 508	2,9267	0	0,0000
99	Starbucks Corporation	624	0,1587	624	0,1587	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000		0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000
100	Target Corporation	288	0,0732	288	0,0732	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000		0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000
101	Tatra banka, a.s.	25 551	6,4981	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000		0,0000	25 551	6,4981	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000
102	Texas Instrument Incorporated	775	0,1971	775	0,1971	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000		0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000
103	The Procter and Gamble Company	1 782	0,4532	1 782	0,4532	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000		0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000
104	The Southern Company	323	0,0821	323	0,0821	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000		0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000
105	Time Warner Inc.	534	0,1358	534	0,1358	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000		0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000
106	Twenty First Century Fox, Inc.	388	0,0987	388	0,0987	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000		0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000
107	Union Pacific Corporation	832	0,2116	832	0,2116	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000		0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000
108	United Health Group Inc	1 531	0,3894	1 531	0,3894	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000		0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000
109	United Parcel Service, Inc.	599	0,1523	599	0,1523	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000		0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000
110	United Technologies Corp.	722	0,1836	722	0,1836	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000		0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000
111	US BANCORP	642	0,1633	639	0,1625	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000		0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	3	0,0008
112	Verizon Communication Inc	1 574	0,4003	1 574	0,4003	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000		0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000
113	VISA INC-CLASS A SHARES	1 600	0,4069	1 600	0,4069	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000		0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000
114	WALGREEN BOOTS ALLIANCE INC	462	0,1175	462	0,1175	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000		0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000
115	Wai-Mart Stores Inc	1 140	0,2899	1 135	0,2887	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000		0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	5	0,0013
116	Walt Disney Co/The	1 190	0,3026	1 182	0,3006	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000		0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	8	0,0020
117	Wells Fargo & Company	2 050	0,5214	2 050	0,5214	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000		0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000

č. r.	Sektory 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 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		
32	5320	469	0,1193	468	0,1190	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	1	0,0003
33	5630	1 131	0,2876	1 131	0,2876	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000
34	5911	921	0,2342	921	0,2342	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000
35	5913	1 423	0,3619	1 423	0,3619	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000
36	6110	549	0,1396	549	0,1396	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000
37	6120	3 322	0,8448	3 322	0,8448	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000
38	6190	698	0,1775	698	0,1775	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000
39	6201	7 457	1,8965	7 457	1,8965	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000
40	6312	7 758	1,9730	7 758	1,9730	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000
41	6419	51 985	13,2208	11 161	2,8385	1 261	0,3207	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	39 552	10,0588	0	0,0000	0	0,0000	11	0,0028	0	0,0000
42	6420	2 796	0,7111	2 796	0,7111	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000
43	6430	243 599	61,9518	475	0,1208	0	0,0000	152 059	38,6715	79 557	20,2329	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	11 508	2,9267	0	0,0000	0	0,0000
44	6499	2 050	0,5214	2 050	0,5214	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000
45	6511	1 244	0,3164	1 243	0,3161	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	1	0,0003	0	0,0000
46	6630	3 253	0,8273	3 253	0,8273	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000
47	7022	702	0,1785	702	0,1785	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000
48	8690	1 531	0,3894	1 531	0,3894	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000
49	9003	1 190	0,3026	1 182	0,3006	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	8	0,0020	0	0,0000

Názov dôchodkového fondu

PROGRES akciový negarantovaný dôchodkový fond, Allianz - Slovenská d.s.s., a.s.

Identifikačný kód

S2203060011

Stav ku dňu

31.12.2017

Členenie podľa geografického hľadiska

č.r.	Štáty	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 %	objem v tis. eur	podiel v %	reálna hodnota 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
0a	Členské štáty	391 946	99,6793	109 183	27,7673	0	0,0000	152 059	38,6715	79 557	20,2329	0	0,0000	39 552	10,0588	0	0,0000	11 508	2,9267	87	0,0221
0b	Nečlenské štáty	1 261	0,3207	0	0,0000	1 261	0,3207	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000
0	CELKOM	393 207	100	109 183	28	1 261	0	152 059	39	79 557	20	0	0	39 552	10	0	0	11 508	3	87	0
1	IE	50 329	12,7996	1 537	0,3909		0,0000	37 280	9,4810		0,0000		0,0000		0,0000		0,0000	11 508	2,9267	4	0,0010
2	JP	29 462	7,4927		0,0000		0,0000		0,0000	29 462	7,4927		0,0000		0,0000		0,0000		0,0000		0,0000
3	LU	126 748	32,2344		0,0000		0,0000	114 779	29,1905	11 969	3,0439		0,0000		0,0000		0,0000		0,0000		0,0000
4	RU	1 261	0,3207		0,0000	1 261	0,3207		0,0000		0,0000		0,0000		0,0000		0,0000		0,0000		0,0000
5	SK	39 552	10,0588		0,0000		0,0000		0,0000		0,0000		0,0000	39 552	10,0588		0,0000		0,0000		0,0000
6	US	145 855	37,0937	107 646	27,3764		0,0000		0,0000	38 126	9,6962		0,0000		0,0000		0,0000		0,0000	83	0,0211

Dof (HMF) 03-02

Názov dôchodkového fondu

PROGRES akciový negarantovaný dôchodkový fond, Allianz - Slovenská d.s.s., a.s.

Identifikačný kód

S2203060011

Stav ku dňu

31.12.2017

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 %	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		204 320	51,9625	0	0,0000	1 261	0,3207	152 059	38,6715	11 969	3,0439	0	0,0000	39 031	9,9263	0	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000		
0b	CELKOM USD		159 425	40,5448	109 183	27,7673	0	0,0000	0	0,0000	38 126	9,6962	0	0,0000	521	0,1325	0	0	0,0000	11 508	2,9267	87	0,0221		
0c	CELKOM CZK		0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000		
0d	CELKOM HUF		0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000		
0e	CELKOM PLN		0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000		
0f	CELKOM JPY		29 462	7,4927	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	29 462	7,4927	0	0,0000	0	0,0000	0	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000		
0g	CELKOM OSTATNÉ		0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000	0	0	0,0000	0	0,0000	0	0,0000		
1	EUR	M1	39 031	9,9263		0,0000		0,0000		0,0000		0,0000		0,0000	39 031	9,9263					0,0000		0,0000		
2	EUR	R1PR3	1 261	0,3207		0,0000	1 261	0,3207		0,0000		0,0000		0,0000		0,0000					0,0000		0,0000		
3	EUR	NA	164 028	41,7154		0,0000		0,0000	152 059	38,6715	11 969	3,0439		0,0000		0,0000					0,0000		0,0000		
4	JPY	NA	29 462	7,4927		0,0000		0,0000		0,0000	29 462	7,4927		0,0000		0,0000					0,0000		0,0000		
5	USD	M1	521	0,1325		0,0000		0,0000		0,0000		0,0000		0,0000	521	0,1325					0,0000		0,0000		
6	USD	NA	158 904	40,4123	109 183	27,7673		0,0000		0,0000	38 126	9,6962		0,0000		0,0000					0,0000	11 508	2,9267	87	0,0221

Dof (SP) 17-02

Hlásenie o vývoji počtu sporiteľov

Názov dôchodkového fondu

PROGRES akciový negarantovaný dôchodkový fond, Allianz - Slovenská d.s.s., a.s.

Identifikačný kód

S2203060011

Stav ku dňu

31.12.2017

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 vrátenci DSS		z DSS do inej DSS		úmrtia
							prírastky	úbytky	prírastky	úbytky	
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12
102 617	32 422 440	339	52 667	49 950	94 351	8 266	2 896	299	5 783	2 311	45

Dof (PAS) 31-02

Výkaz pasív dôchodkového fondu

Názov dôchodkového fondu

PROGRES akciový negarantovaný dôchodkový fond, Allianz - Slovenská d.s.s., a.s.

Identifikačný
kód

2203060011

Stav ku dňu

31.12.2017

Ozna- čenie	Položka	č. r.	Hodnota v tis. eur
a	b	c	1
1.	Záväzky	1	2 328
a)	záväzky voči bankám	2	
b)	záväzky z ukončenia dôchodkového sporenia	3	139
c)	záväzky voči dôchodkovej správcovskej spoločnosti	4	208
d)	záväzky z derivátových operácií	5	
e)	záväzky voči bankám z repoobchodov	6	
f)	záväzky z vypožičania finančného majetku	7	
g)	ostatné záväzky	8	1 981
2.	Vlastné imanie	9	390 879
a)	dôchodkové jednotky na osobných dôchodkových účtoch sporeiteľov	10	365 593
b)	zisk alebo strata za účtovné obdobie	11	25 286
3.	Pasíva v dôchodkovom fonde celkom	12	393 207

Výkaz výnosov a nákladov dôchodkového fondu

Názov dôchodkového fondu

PROGRES akciový negarantovaný dôchodkový fond, Allianz - Slovenská d.s.s., a.s.

Identifikačný kód

2203060011

Stav ku dňu

31.12.2017

Označenie	Položka	č. r.	Hodnota v tis. eur
a	b	c	1
1.	Výnosy z úrokov a obdobné výnosy	1	52
a)	z peňažných prostriedkov na bežnom účte	2	
b)	z peňažných prostriedkov na vkladovom účte	3	10
c)	z dlhopisov a obdobných dlhových cenných papierov	4	42
d)	z nástrojov peňažného trhu	5	
2.	Výnosy z podielových listov a obdobné výnosy	6	
3.	Výnosy z dividend a iných podielov na zisku	7	3 467
4.	Výnosy z operácií s cennými papiermi	8	234 067
a)	z kapitálových cenných papierov a obdobných cenných papierov	9	135 448
b)	z dlhopisov a iných dlhových cenných papierov	10	62
c)	z nástrojov peňažného trhu	11	
d)	z podielových listov a obdobných cenných papierov	12	98 557
5.	Náklady na operácie s cennými papiermi	13	187 690
a)	kapitálové cenné papiere a obdobné cenné papiere	14	111 848
b)	dlhopisy a iné dlhové cenné papiere	15	78
c)	nástroje peňažného trhu	16	
d)	podielové listy a obdobné cenné papiere	17	75 764
6.	Zisk/strata z operácií s cennými papiermi a podielmi	18	46 377
7.	Zisk/strata z operácií s devízami	19	(21 419)
8.	Zisk/strata z derivátov	20	
9.	Zisk/strata z operácií s drahými kovmi	21	1 097
10.	Zisk/strata z operácií s iným majetkom	22	51
I.	Výnos z majetku	23	29 625
11.	Transakčné náklady	24	9
a)	náklady na transakcie s CP platené depozitárovi	25	5
b)	poplatky pri nákupe a predaji CP platené tretej strany	26	4
12.	Bankové a iné poplatky	27	
a)	bankové odplaty a poplatky	28	
b)	burzové odplaty a poplatky	29	
II	Čistý výnos z majetku	30	29 616
13.	Náklady na financovanie dôchodkového fondu	31	464
III.	Čistý zisk/strata zo správy majetku	32	29 152
14.	Iné výnosy	33	
15.	Náklady na odplaty	34	3 866
a)	náklady na odplatu za správu DF	35	1 056
b)	náklady na odplatu za zhodnotenie majetku v DF	36	2 620
c)	náklady na iné odplaty	37	190
IV.	Zisk/strata dôchodkového fondu za účtovné obdobie	38	25 286

Účtovná zázvierka dôchodkového fondu

Súčasťou ročnej správy dôchodkovej správcovskej spoločnosti Allianz - Slovenská d.s.s., a. s. o hospodárení s majetkom v dôchodkovom fonde PROGRES akciový negarantovaný d. f. k 31.12.2017 je účtovná zázvierka dôchodkového fondu k 31.12.2017, ktorá tvorí osobitnú prílohu tejto správy.

Skrátená verzia ročnej správy o hospodárení s majetkom v dôchodkovom fonde

Názov dôchodkového fondu

Stav ku dňu

PROGRES akciový negarantovaný dôchodkový fond, Allianz - Slovenská d.s.s., a.s.

31.12.2017

Výkaz aktív a pasív dôchodkového fondu

Označenie	Položka	Č. r.	Hodnota v tis. eur k 31.12.2017	Hodnota v tis. eur k 31.12.2016	Hodnota v tis. eur k 31.12.2015
I.	Investičný majetok	1	367 656	298 671	241 614
1.	Dlhopisy oceňované umorovanou hodnotou	2	0	0	0
a)	bez kupónov	3			
b)	s kupónmi	4			
2.	Dlhopisy oceňované reálnou hodnotou	5	1 261	1 278	1 219
a)	bez kupónov	6			
b)	s kupónmi	7	1 261	1 278	1 219
3.	Akcie a podiely v obchodných spoločnostiach	8	109 183	102 802	67 430
a)	obchodovateľné	9	109 183	102 802	67 430
b)	neobchodovateľné	10			
c)	podiely v obchodných spoločnostiach, ktoré nemajú formu cenného papiera	11			
d)	obstaranie neobchodovateľných akcií a podielov v obchodných spoločnostiach	12			
4.	Podielové listy	13	231 616	185 330	149 080
a)	otvorených podielových fondov	14	72 697	56 741	
b)	ostatné	15	158 919	128 589	149 080
5.	Krátkodobé pohľadávky	16	14 088	111	16 998
a)	krátkodobé vklady v bankách	17	14 001		16 998
b)	krátkodobé pôžičky obchodným spoločnostiam, v ktorých má dôchodkový fond majetkový podiel	18			
c)	iné	19	87	111	
d)	obrátené repoobchody	20			
6.	Dlhodobé pohľadávky	21			
a)	dlhodobé vklady v bankách	22			
b)	dlhodobé pôžičky obchodným spoločnostiam, v ktorých má dôchodkový fond majetkový podiel	23			
7.	Deriváty	24			
8.	Drahé kovy	25	11 508	9 150	6 887
II.	Neinvestičný majetok	26	25 551	9 775	636
9.	Peňažné prostriedky a ekvivalenty peňažných prostriedkov	27	25 551	9 775	472
10.	Ostatný majetok	28	0		164
	Aktíva spolu	29	393 207	308 446	242 250
I.	Závazky	30	2 328	301	120
1.	Závazky voči bankám	31			
2.	Závazky z ukončenia dôchodkového sporenia	32	139	185	32
3.	Závazky voči dôchodkovej správcovskej spoločnosti	33	208	75	55
4.	Závazky z derivátových operácií	34			
5.	Závazky z repoobchodov	35			
6.	Závazky z vypožičania finančného majetku	36			
7.	Ostatné záväzky	37	1 981	41	33
II.	Vlastné imanie	38	390 879	308 145	242 130
1.	Dôchodkové jednotky na osobných dôchodkových účtoch sporiteľov, z toho	39	390 879	308 145	242 130
a)	zisk/strata za účtovné obdobie	40	25 286	31 113	3 664
	Pasíva celkom	41	393 207	308 446	242 250

Výkaz výnosov a nákladov dôchodkového fondu

Označenie	Položka	Č. r.	Hodnota v tis. eur k 31.12.2017	Hodnota v tis. eur k 31.12.2016	Hodnota v tis. eur k 31.12.2015
1.	Výnosy z úrokov	1	52	45	146
2.	Výnosy z podielových listov	2			1 314
3.	Výnosy z dividend a z iných podielov na zisku	3	3 467	3 054	1 402
4.	Zisk/strata z operácií s cennými papiermi	4	46 377	23 708	(5 800)
5.	Zisk/strata z operácií s devízami	5	(21 419)	5 053	12 219
6.	Zisk/strata z derivátov	6	0		
7.	Zisk/strata z operácií s drahými kovmi	7	1 097	645	(817)
8.	Zisk/strata z operácií s iným majetkom	8	51		
I.	Výnos z majetku	9	29 625	32 505	8 464
9.	Transakčné náklady	10	(9)	(48)	(65)
10.	Bankové a iné poplatky	11			
II.	Čistý výnos z majetku	12	29 616	32 457	8 399
11.	Náklady na financovanie dôchodkového fondu	13	(464)	(403)	(371)
III.	Čistý zisk/strata zo správy majetku	14	29 152	32 054	8 028
12.	Náklady na odplaty	15	(3 866)	(941)	(4 364)
IV.	Zisk/(strata) dôchodkového fondu za účtovné obdobie	16	25 286	31 113	3 664