

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

k 31.12.2012

GLOBAL indexový d. f., 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 GLOBAL indexový d. f. k 31.12.2012

Hlásenie o najvýznamnejších skutočnostiach dôchodkového fondu

Názov dôchodkového fondu

GLOBAL indexový d.f., Allianz- Slovenská d.s.s., a.s.

Identifikačný kód

0204120054

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

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

1. Zmena legislatívy - povinnosť vytvoriť fond vznikla spoločnosti k 01.04.2012
2. Postupné nakupovanie akciových investícií v závislosti od prílevu prostriedkov.
3. Časovanie investícií do cenných papierov - keďže objem príspevkov bol relatívne vysoký v porovnaní s celkovými aktívami fondu
3. Trhový vývoj
 - a) pokles cien akcií v prvej polovici druhého štvrťroka a ich následný rast v zvyšnej časti roka
 - b) vývoj eura voči menám v ktorých sú prevažne denominované akcie nachádzajúce sa v kopírovanom indexe - americký dolár, švajčiarsky frank, britská libra či japonský jen - oslabovanie eura voči týmto menám do júla 2012 a jeho následné zhodnocovanie v zvyšnej časti roka
4. Zníženie sadzby príspevkov do druhého piliera na 4%

Dodatočné náležitosti - použité metódy na meranie (výpočet) trhového rizika v majetku v dôchodkovom fonde.

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 a výpočet je uskutočnený minimálne raz denne. Pozorovacie obdobie je jeden rok.

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.

Hodnoty VaR z NAV (využitie limitu):

Limit	Min VaR	Max VaR	Priemerné VaR
15% z ČSH, NAV	5,22% (34,82%)	10,55% (70,32%)	9,06% (60,42%)

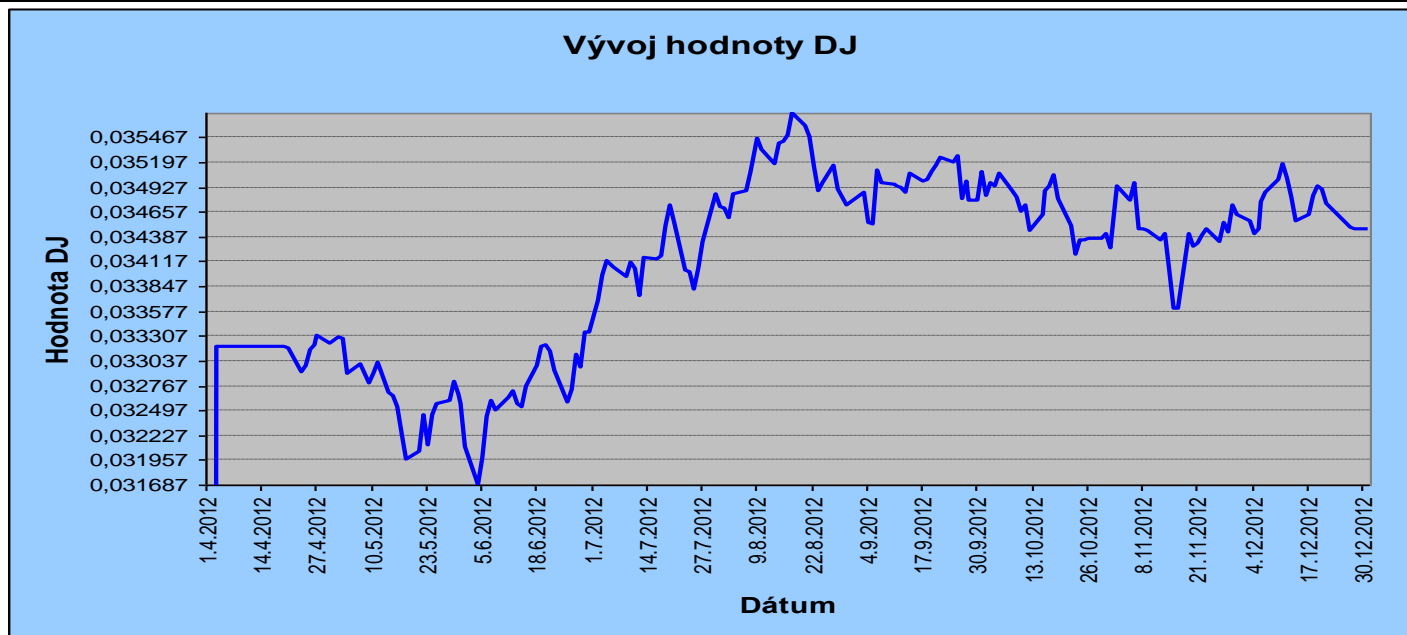
Model hodnoty v riziku je Delta-Gama model a vstupné dáta sú ceny, úrokové miery, výmenné kurzy, kreditné krivky / spready či iné trhové dáta, ktoré sú dostupné cez informačný systém.

Spoločnosť plánuje zlúčiť tento fond s akciovým negarantovaným fondom Progres v máji 2013.

V majetku fondu neboli realizované transakcie na obmedzenie menového rizika.

V majetku dôchodkového fondu sa nenachádzali cenné papiere s hlasovacím právom.

b) Grafické znázornenie vývoja hodnoty dôchodkovej jednotky



Hlásenie o stave majetku v dôchodkovom фонде

Názov dôchodkového fondu

GLOBAL indexový d.f., Allianz - Slovenská d.s.s., a.s.

Identifikačný kód

0204120054

Stav ku dňu

31.12.2012

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		
	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	4		
Dlhové cenné papiere	Prijaté na obchodovanie na trhu kótovaných cenných papierov burzy cenných papierov	5		
	Prijaté na obchodovanie na trhu kótovaných cenných papierov zahraničnej burzy cenných papierov so sídlom v členskom štáte	6		
	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	8		
Podielové listy otvorených podielových fondov a cenné papiere zahraničných subjektov kolektívneho investovania podľa § 81 ods. 1 písm. c)	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	1 703	95,5132
	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	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		
	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	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, EU, 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		
	Peňažné prostriedky na bežnom účete u depozitára	24	16	0,8974
Peňažné prostriedky na vkladovom účete u depozitára	25	44	2,4678	
Bežné účty a vkladové účty podľa § 81 ods. 1 písm. f) zákona	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		
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	20	1,1217
Hodnota majetku v dôchodkovom фонде		33	1 783	100,0000
Objem záväzkov dôchodkového fondu celkom		34	1	0,0561
Čistá hodnota majetku v dôchodkovom фонде		35	1 782	99,9439

Hlásenie o stave majetku v dôchodkovom fonde

Názov dôchodkového fondu

GLOBAL indexový d.f., Allianz - Slovenská d.s.s., a.s.

Identifikačný kód

0204120054

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 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 %	objem v tis. eur	podiel v %	reálna hodnota v tis. eur	podiel v %	objem v tis. eur	podiel v %	objem v tis. eur
a	b	1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13	14	15	16	17	18	19	20	
1	CELKOM	1 783	100,0000					1 703	95,5132					60	3,3651					20	1,1217	
2	Source Markets PLCMSCI World ETF	1 703	95,5132					1 703	95,5132													
3	Tatra banka, a.s.	60	3,3651											60	3,3651							
4	PROGRES a.d.f., Allianz - Slovenská d.s.s., a.s.	20	1,1217																	20	1,1217	

Hlásenie o stave majetku v dôchodkovom fonde

Názov dôchodkového fondu

GLOBAL indexový d.f., Allianz - Slovenská d.s.s., a.s.

Identifikačný kód

0204120054

Stav ku dňu

31.12.2012

Členenie podľa sektorového hľadiska

č. r.	Sektie klasifikácie ekonomických činností	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 %	objem v tis. eur	podiel v %	reálna hodnota v tis. eur	podiel v %	objem v tis. eur	podiel v %	objem v tis. eur
a	b	1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13	14	15	16	17	18	19	20	
1	CELKOM	1 783	100,0000			0		1 703	95,5132			0		60	3,3651					20	1,1217	
2	641	60,0000	3,3651											60	3,3651							
3	643	1 703,0000	95,5132					1 703	95,5132													
4	653	20,0000	1,1217																	20	1,1217	

Hlásenie o stave majetku v dôchodkovom fonde

Názov dôchodkového fondu

GLOBAL indexový d.f., Allianz - Slovenská d.s.s., a.s.

Identifikačný kód

0204120054

Stav ku dňu

31.12.2012

Členenie podľa geografického hľadiska

č.r.	Štáty	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	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
1a	Členské štáty	1 783	100,0000					1 703	95,5132					60	3,3651					20	1,1217
1b	Nečlenské štáty																				
1	CELKOM	1 783	100,0000					1 703	95,5132					60	3,3651					20	1,1217
2	IE	1703	95,51318		0		0	1703	95,5132		0		0		0		0		0		0
3	SK	80	4,48682		0		0		0		0		0	60	3,36511		0		0	20	1,1217

Hlásenie o vývoji počtu sporiteľov

Názov dôchodkového fondu

GLOBAL indexový d.f., Allianz - Slovenská d.s.s., a.s.

Identifikačný kód

0204120054

Stav ku dňu

31.12.2012

Počet sporiteľov spolu	Objem príspevkov v eurách spolu	Objem penále v eurách spolu	Počet sporiteľov podľa		Počet sporiteľov podľa		Zmena stavov sporiteľov				
			muži	ženy	aktívny	pasívny	medzi DF v rámci DSS		z DSS do inej DSS		úmrtnia
							prírastky	úbytky	prírastky	úbytky	
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12
1 339	133 915	5	746	593	606	733	139	1	194		

Výkaz pasív dôchodkového fondu

Názov dôchodkového fondu

GLOBAL indexový d.f., Allianz - Slovenská d.s.s., a.s.

Identifikačný kód

204120054

Stav ku dňu

31.12.2012

Ozna- čenie	Položka	č. r.	Hodnota v tis. eur
a	b	c	1
1.	Závazky	1	1
a)	záväzky voči bankám	2	
b)	záväzky z ukončenia dôchodkového sporenia	3	
c)	záväzky voči dôchodkovej správcovskej spoločnosti	4	
d)	záväzky z derivátových operácií	5	
e)	ostatné záväzky	6	1
2.	Vlastné imanie	7	1 782
a)	dôchodkové jednotky na osobných dôchodkových účtoch sporiteľov	8	1 782
b)	dôchodkové jednotky na garančnom účte	9	
3.	Pasíva v dôchodkovom fonde celkom	10	1 783

Výkaz výnosov a nákladov dôchodkového fondu

Názov dôchodkového fondu

GLOBAL indexový d.f., Allianz - Slovenská d.s.s., a.s.

Identifikačný kód

204120054

Stav ku dňu

31.12.2012

Ozna- čenie	Položka	č. r.	Hodnota v tis. eur
a	b	c	1
1.	Výnosy z úrokov a obdobné výnosy	1	0
a)	z peňažných prostriedkov na bežnom účte	2	0
b)	z peňažných prostriedkov na vkladovom účte	3	0
c)	z dlhopisov a obdobných dlhových cenných papierov	4	0
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	0
4.	Výnosy z operácií s cennými papiermi	8	441
a)	z kapitálových cenných papierov a obdobných cenných papierov	9	0
b)	z dlhopisov a iných dlhových cenných papierov	10	0
c)	z nástrojov peňažného trhu	11	0
d)	z podielových listov a obdobných cenných papierov	12	441
5.	Náklady na operácie s cennými papiermi	13	409
a)	kapitálové cenné papiere a obdobné cenné papiere	14	0
b)	dlhopisy a iné dlhové cenné papiere	15	0
c)	nástroje peňažného trhu	16	0
d)	podielové listy a obdobné cenné papiere	17	409
6.	Zisk/strata z operácií s cennými papiermi	18	32
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	4
12.	Náklady na dane vzťahujúce sa na majetok v dôchodkovom fonde	30	0
13.	Zisk/strata za účtovné obdobie	31	28

Skrátená verzia ročnej správy o hospodárení s majetkom v dôchodkovom fonde

Názov dôchodkového fondu

GLOBAL indexový d.f., Allianz - Slovenská d.s.s., a.s.

Stav ku dňu

31.12.2012

Výkaz aktív a pasív dôchodkového fondu

Označenie	Položka	Č. r.	Hodnota v tis. eur k 31.12.2012	Hodnota v tis. eur k 31.12.2011	Hodnota v tis. eur k 31.12.2010
a	b	c	1	1	1
I.	Investičný majetok	1	1 747		
1.	Dlhopisy	2	0		
a)	<i>bez kupónov</i>	3	0		
b)	<i>s kupónmi</i>	4	0		
2.	Akcie	5	0		
3.	Podielové listy	6	1 703		
a)	<i>otvorených podielových fondov</i>	7	0		
b)	<i>ostatné</i>	8	1 703		
4.	Krátkodobé pohľadávky	9	44		
5.	Dlhodobé pohľadávky	10	0		
6.	Deriváty	11	0		
II.	Neinvestičný majetok	12	36		
7.	Peňažné prostriedky a ekvivalenty peňažných prostriedkov	13	16		
8.	Ostatný majetok	14	20		
	Aktíva v dôchodkovom fonde spolu	15	1 783		
I.	Závazky	16	1		
1.	záväzky voči bankám	17	0		
2.	záväzky z ukončenia dôchodkového sporenia	18	0		
3.	záväzky voči dôchodkovej správcovskej spoločnosti	19	0		
4.	záväzky z derivátových operácií	20	0		
5.	ostatné záväzky	21	1		
II.	Vlastné imanie	22	1 782		
1.	dôchodkové jednotky na osobných dôchodkových účtoch sporiťel'ov	23	1 782		
2.	dôchodkové jednotky na garančnom účte	24	0		
	Pasíva v dôchodkovom fonde celkom	25	1 783		

Výkaz výnosov a nákladov dôchodkového fondu

Označenie	Položka	Č. r.	Hodnota v tis. eur k 31.12.2012	Hodnota v tis. eur k 31.12.2011	Hodnota v tis. eur k 31.12.2010
a	b	c	1	1	1
1.	Výnosy z úrokov	1	0		
2.	Výnosy z podielových listov	2	0		
3.	Výnosy z dividend	3	0		
4.a.	Čistý zisk/(strata) z operácií s cennými papiermi	4	0		
5.b.	Čistý zisk/(strata) z devízových operácií	5	0		
6.c.	Čistý zisk/(strata) z derivátových operácií	6	0		
7.d.	Čistý zisk/(strata) z operácií s iným majetkom	7	0		
8.e.	Čistý zisk/(strata) z precenenia cenných papierov	8	32		
II.	Čistý výnos z majetku vo fonde	9	32		
f	Náklady na financovanie fondu	10	-4		
III.	Čistý zisk/(strata) z zo správy majetku vo fonde	11	28		
g	Dane	12	0		
IV.	Zisk/(strata) dôchodkového fondu	13	28		

Účtovná závierka dôchodkového fondu

Súčasťou polročnej správy dôchodkovej správcovskej spoločnosti Allianz - Slovenská d.s.s., a. s. o hospodárení s majetkom v dôchodkovom fonde GLOBAL indexový d. f. K 31.12.2012 je účtovná závierka dôchodkového fondu k 31.12.2012, ktorá tvorí osobitnú prílohu tejto správy.