
Pololetní zpráva Penzijní společnosti České pojišťovny, a. s.

za období od 1. 1. 2018 do 30. 6. 2018



**PENZIJNÍ SPOLEČNOST
ČESKÉ POJIŠŤOVNY**

Obsah

Penzijní společnost České pojišťovny, a. s.	3
Transformovaný fond Penzijní společnosti České pojišťovny, a. s.	5
Povinný konzervativní fond Penzijní společnosti České pojišťovny, a. s.	7
Spořicí účastnický fond Penzijní společnosti České pojišťovny, a. s.	9
Vyvážený účastnický fond Penzijní společnosti České pojišťovny, a. s.	11
Dynamický účastnický fond Penzijní společnosti České pojišťovny, a. s.	13

Penzijní společnost České pojišťovny, a. s.,

IČ: 618 58 692, se sídlem Na Pankráci 1720/123, 140 21 Praha 4 – Nusle, zapsaná v obchodním rejstříku vedeném u Městského soudu v Praze oddíl B, vložka 2738, v souladu s ustanoveními vyhlášky č. 117/2012 Sb., o podrobnější úpravě činnosti penzijní společnosti a účastnického fondu (dále jen „Vyhláška“), předkládá následující pololetní zprávu za penzijní společnost a za každý obhospodařovaný účastnický a transformovaný fond:

Penzijní společnost České pojišťovny, a. s.

a) Údaje o fondech obhospodařovaných penzijní společností v rozhodném období k odst. 1 písm. a) Přílohy č. 2 k Vyhlášce:

Penzijní společnost spravovala po celé sledované období následující fondy:

- 1) Transformovaný fond Penzijní společnosti České pojišťovny, a. s.
- 2) Povinný konzervativní fond Penzijní společnosti České pojišťovny, a. s.
- 3) Spořicí účastnický fond Penzijní společnosti České pojišťovny, a. s.
- 4) Vyvážený účastnický fond Penzijní společnosti České pojišťovny, a. s.
- 5) Dynamický účastnický fond Penzijní společnosti České pojišťovny, a. s.

b) Údaje o členech představenstva, dozorčí rady, ostatních vedoucích osobách a portfolio manažerech k odst. 1 písm. b) Přílohy č. 2 k Vyhlášce:

Představenstvo

Ing. Marcel Homolka – předseda představenstva, den vzniku členství: 1. června 2015

Ing. Miroslav Chromčík – místopředseda představenstva, den vzniku členství: 1. července 2015

Mgr. Miroslav Žbel – člen představenstva, den vzniku členství: 1. března 2015

Dozorčí rada

Ing. Josef Beneš – předseda dozorčí rady, den vzniku členství: 1. ledna 2016

Mgr. Petr Bohumský – člen dozorčí rady, den vzniku členství: 1. února 2015

PhDr. Tomáš Vysoudil – člen dozorčí rady, den vzniku členství: 1. července 2015

Vedoucí osoby

Všechny vedoucí osoby byly zároveň členy představenstva.

Portfolio manažer

Celý majetek obhospodařovaných fondů, které byly v rozhodném období obhospodařovány penzijní společností, byl svěřen do obhospodařování společnosti Generali Investments CEE, investiční společnost, a. s., IČ: 438 73 766, se sídlem Na Pankráci 1720/123, 140 21 Praha 4 – Nusle, zapsaná v obchodním rejstříku vedeném u Městského soudu v Praze, oddíl B, vložka 1031.

c) Údaje o všech obchodnících s cennými papíry, kteří vykonávali činnost obchodníka s cennými papíry ve vztahu k fondům obhospodařovaných penzijní společností, byť jen po část rozhodného období, spolu s uvedením doby, po kterou tuto činnost vykonávali k odst. 1 písm. c) Přílohy č. 2 k Vyhlášce:

Činnost obchodníka s cennými papíry pro fondy obhospodařované penzijní společností po celé rozhodné období vykonávaly společnosti:

PPF banka a. s., IČ: 471 16 129, se sídlem Evropská 2690/17, 160 41 Praha 6 – Dejvice, zapsaná v obchodním rejstříku vedeném u Městského soudu v Praze, oddíl B, vložka 1834;

Česká spořitelna, a. s., IČ: 452 44 782, se sídlem Olbrachtova 1929/62, 140 00 Praha 4, zapsaná v obchodním rejstříku vedeném u Městského soudu v Praze, oddíl B, vložka 1171;

WOOD & Company Financial Services, a. s., IČ: 265 03 808, se sídlem Náměstí Republiky 1079/1a, 110 00 Praha 1, zapsaná v obchodním rejstříku vedeném u Městského soudu v Praze, oddíl B, vložka 7484;

Raiffeisen Centrobank AG, se sídlem Tegetthoffstrasse 1, 1015 Wien, Rakouská republika;

Merrill Lynch International Bank Ltd. London, se sídlem 2 King Edward Street, EC1A1HQ London, Spojené království Velké Británie a Severního Irsku;

Patria Finance, a. s., IČ: 264 55 064 se sídlem Jungmannova 745/24, 110 00 Praha 1, zapsaná v obchodním rejstříku vedeném u Městského soudu v Praze, oddíl B, vložka 7215;

Swiss Capital S. A., se sídlem Bulevardul Dacia 20, 013714 Bukurešť, Rumunsko, zapsaná v obchodním rejstříku pod spisovou značkou J40/4107/1996;

Komerční banka, a. s., IČ: 453 17 054 se sídlem Na Příkopě 969/33, 114 07 Praha 1, zapsaná v obchodním rejstříku vedeném u Městského soudu v Praze, oddíl B, vložka 1360;

Concorde Securities Private Limited, se sídlem 1123 Budapešť, Alkotás u. 50, Maďarsko, zapsaná v obchodním rejstříku vedeném Metropolitním registračním soudem v Budapešti pod spisovou značkou 01-10-043521.

Od 23. května 2018 tuto činnost rovněž vykonávala společnost J&T banka, a. s., IČ: 471 15 378, se sídlem Pobřežní 297/14, 186 00 Praha 8, zapsaná v obchodním rejstříku vedeném u Městského soudu v Praze, oddíl B, vložka 1731.

Transformovaný fond Penzijní společnosti České pojišťovny, a. s.

- a) **Název transformovaného fondu** k odst. 2 písm. a) Přílohy č. 2 k Vyhlášce:
Transformovaný fond Penzijní společnosti České pojišťovny, a. s.
- b) **Údaje o penzijní společnosti, která obhospodařuje transformovaný fond a případně o všech dalších penzijních společnostech, které transformovaný fond obhospodařovaly v rozhodném období, spolu s uvedením doby, po kterou každá penzijní společnost transformovaný fond obhospodařovala** k odst. 2 písm. b) Přílohy č. 2 k Vyhlášce:
Transformovaný fond po celé rozhodné období obhospodařovala Penzijní společnost České pojišťovny, a. s., IČ: 618 58 692, se sídlem Na Pankráci 1720/123, 140 21 Praha 4 – Nusle, zapsaná v obchodním rejstříku vedeném u Městského soudu v Praze, oddíl B, vložka 2738.
- c) **Údaje o portfolio manažerech transformovaného fondu v rozhodném období a době, po kterou činnost portfolio manažera vykonávali** k odst. 2 písm. c) Přílohy č. 2 k Vyhlášce:
Celý majetek transformovaného fondu byl svěřen do obhospodařování společnosti Generali Investments CEE, investiční společnost, a. s., IČ: 438 73 766, se sídlem Na Pankráci 1720/123, 140 21 Praha 4 – Nusle, zapsaná v obchodním rejstříku vedeném u Městského soudu v Praze, oddíl B, vložka 1031. V rozhodném období vykonával činnost portfolio manažera Ing. Michal Kymlička, CFA.
- d) **Údaje o všech depozitářích transformovaného fondu v rozhodném období a době, po kterou činnost depozitáře vykonávali** k odst. 2 písm. d) Přílohy č. 2 k Vyhlášce:
Depozitářem transformovaného fondu po celé rozhodné období byla společnost UniCredit Bank Czech Republic and Slovakia, a. s., IČ: 649 48 242, se sídlem Želetavská 1525/1, 140 92 Praha 4 – Michle, zapsaná v obchodním rejstříku vedeném u Městského soudu v Praze, oddíl B, vložka 3608.
- e) **Údaje o osobě, která zajišťuje úschovu nebo kontrolu stavu majetku transformovaného fondu, pokud je u této osoby uloženo nebo je touto osobou kontrolován stav více než 1 % majetku fondu** k odst. 2 písm. e) Přílohy č. 2 k Vyhlášce:
V rozhodném období zajišťovala úschovu cenných papírů společnost UniCredit Bank Czech Republic and Slovakia, a. s., IČ: 649 48 242, se sídlem Želetavská 1525/1, 140 92 Praha 4 – Michle, zapsaná v obchodním rejstříku vedeném u Městského soudu v Praze, oddíl B, vložka 3608.
- f) **Identifikace majetku transformovaného fondu, jehož hodnota přesahuje 1 % hodnoty majetku fondu ke dni, kdy bylo provedeno ocenění pro účely této zprávy, s uvedením celkové pořizovací ceny a reálné hodnoty na konci rozhodného období** k odst. 2 písm. f) Přílohy č. 2 k Vyhlášce:

Název	ISIN	Požizovací cena (v tis. Kč)	Reálná cena (v tis. Kč)
Repo transakce	Reverzní repo	16 226 000	16 228 448
CZ GB 2.50 08/28	CZ0001003859	9 701 526	9 190 140
CZ GB 4.20 12/36	CZ0001001796	9 066 672	8 851 640
CZ GB L-10 11/27	CZ0001004105	8 440 729	8 471 658
CZ GB 3.75 09/20	CZ0001001317	7 120 533	6 978 686
CZ GB 5.00 04/19	CZ0001002471	7 619 535	6 599 027
CZ GB 0.95 05/30	CZ0001004477	6 308 010	5 907 198
CZ GB 5.70 05/24	CZ0001002547	6 499 723	5 735 279
CZ GB L+65 04/23	CZ0001003123	4 944 860	4 954 363
CZ GB 3.85 09/21	CZ0001002851	4 861 701	4 849 700
CZ GB 4.70 09/22	CZ0001001945	4 427 667	4 143 429
CZ GB 2.4 09/25	CZ0001004253	3 281 422	2 980 566
CZ GB 2.0 10/33	CZ0001005243	2 309 019	2 288 318
CZ GB 4.85 11/57	CZ0001002059	1 911 753	1 958 888
CZ GB 2.75 07/29	CZ0001005375	1 789 102	1 778 274
CZ GB 1.5 10/19	CZ0001003834	1 342 125	1 375 153

g) Údaje o skladbě a změnách majetku transformovaného fondu k odst. 2 písm. g) Přílohy č. 2 k Vyhlášce:

Aktiva k 30. 6. 2018 (v tis. Kč)	
Pohledávky za bankami a družstevními záložnami	17 695 559
a) splatné na požádání	481 977
b) ostatní pohledávky	17 213 582
Dluhové cenné papíry	95 316 687
a) vydané vládními institucemi	85 436 967
b) vydané ostatními osobami	9 879 720
Akcie, podílové listy a ostatní podíly	3 097 075
Ostatní aktiva	589 406
CELKEM	116 698 727

h) Údaje o úplatě určené penzijní společnosti za obhospodařování majetku v transformovaném fondu k odst. 2 písm. h) Přílohy č. 2 k Vyhlášce:

Úplata určená penzijní společnosti za obhospodařování majetku transformovaného fondu činila na konci rozhodného období 0,8 % z průměrné roční hodnoty bilanční sumy transformovaného fondu a 10 % ze zisku transformovaného fondu.

i) Údaje o fondovém vlastním kapitálu a fondovém vlastním kapitálu připadajícím na jednu jednotku k 30. červnu rozhodného období a za předchozí tři uplynulá období k odst. 2 písm. i) Přílohy č. 2 k Vyhlášce:

Pro transformovaný fond se údaje neuvádí.

Povinný konzervativní fond Penzijní společnosti České pojišťovny, a. s.

- a) **Název účastnického fondu** k odst. 2 písm. a) Přílohy č. 2 k Vyhlášce:
Povinný konzervativní fond Penzijní společnosti České pojišťovny, a. s.
- b) **Údaje o penzijní společnosti, která obhospodařuje účastnický fond a případně o všech dalších penzijních společnostech, které účastnický fond obhospodařovaly v rozhodném období, spolu s uvedením doby, po kterou každá penzijní společnost účastnický fond obhospodařovala** k odst. 2 písm. b) Přílohy č. 2 k Vyhlášce:
Účastnický fond po celé rozhodné období obhospodařovala Penzijní společnost České pojišťovny, a. s., IČ: 618 58 692, se sídlem Na Pankráci 1720/123, 140 21 Praha 4 – Nusle, zapsaná v obchodním rejstříku vedeném u Městského soudu v Praze, oddíl B, vložka 2738.
- c) **Údaje o portfoliu manažerech účastnického fondu v rozhodném období a době, po kterou činnost portfolia manažera vykonávali** k odst. 2 písm. c) Přílohy č. 2 k Vyhlášce:
Celý majetek účastnického fondu byl svěřen do obhospodařování společnosti Generali Investments CEE, investiční společnost, a. s., IČ: 438 73 766, se sídlem Na Pankráci 1720/123, 140 21 Praha 4 – Nusle, zapsaná v obchodním rejstříku vedeném u Městského soudu v Praze, oddíl B, vložka 1031. V rozhodném období vykonával činnost portfolia manažera Ing. Michal Kymlička, CFA.
- d) **Údaje o všech depozitářích účastnického fondu v rozhodném období a době, po kterou činnost depozitáře vykonávali** k odst. 2 písm. d) Přílohy č. 2 k Vyhlášce:
Depozitářem účastnického fondu po celé rozhodné období byla společnost UniCredit Bank Czech Republic and Slovakia, a. s., IČ: 649 48 242, se sídlem Želetavská 1525/1, 140 92 Praha 4 – Michle, zapsaná v obchodním rejstříku vedeném u Městského soudu v Praze, oddíl B, vložka 3608.
- e) **Údaje o osobě, která zajišťuje úschovu nebo kontrolu stavu majetku účastnického fondu, pokud je u této osoby uloženo nebo je touto osobou kontrolován stav více než 1 % majetku fondu** k odst. 2 písm. e) Přílohy č. 2 k Vyhlášce:
V rozhodném období zajišťovala úschovu cenných papírů společnost UniCredit Bank Czech Republic and Slovakia, a. s., IČ: 649 48 242, se sídlem Želetavská 1525/1, 140 92 Praha 4 – Michle, zapsaná v obchodním rejstříku vedeném u Městského soudu v Praze, oddíl B, vložka 3608.
- f) **Identifikace majetku účastnického fondu, jehož hodnota přesahuje 1 % hodnoty majetku fondu ke dni, kdy bylo provedeno ocenění pro účely této zprávy, s uvedením celkové pořizovací ceny a reálné hodnoty na konci rozhodného období** k odst. 2 písm. f) Přílohy č. 2 k Vyhlášce:

Název	ISIN	Pořizovací cena (v tis. Kč)	Reálná cena (v tis. Kč)
Běžné účty	BU	14 230	14 229
Repo transakce	Reverzní repo	185 600	185 620
CZ GB L-10 11/27	CZ0001004105	47 768	46 593
CZ GB L+65 04/23	CZ0001003123	19 613	19 324
CZ GB 0.45 10/23	CZ0001004600	10 200	10 026
CZ GB 2.4 09/25	CZ0001004253	6 438	6 306
CZ GB 4.70 09/22	CZ0001001945	4 571	4 096
CITY OF PRAGUE 4.25 5/21	CZ0001500110	3 433	3 233

- g) **Údaje o skladbě a změnách majetku účastnického fondu** k odst. 2 písm. g) Přílohy č. 2 k Vyhlášce:

Aktiva k 30. 6. 2018 (v tis. Kč)	
Pohledávky za bankami a družstevními záložnami	199 849
a) splatné na požádání	14 229
b) ostatní pohledávky	185 620
Dluhové cenné papíry	92 544
a) vydané vládními institucemi	89 311
b) vydané ostatními osobami	3 233
Akcie, podílové listy a ostatní podíly	0
Ostatní aktiva	0
CELKEM	292 393

h) Údaje o úplatě určené penzijní společností za obhospodařování majetku v účastnickém fondu k odst. 2 písm. h) Přílohy č. 2 k Vyhlášce:

Úplata určená penzijní společností za obhospodařování majetku účastnického fondu činila na konci rozhodného období 0,4 % z průměrné roční hodnoty vlastního kapitálu účastnického fondu a 10 % z kladného rozdílu průměrné hodnoty penzijní jednotky v příslušném období a nejvyšší průměrné roční hodnoty penzijní jednotky v letech předcházejících příslušnému období od vzniku účastnického fondu vynásobené průměrným počtem penzijních jednotek v příslušném období.

i) Údaje o fondovém vlastním kapitálu účastnického fondu a fondovém vlastním kapitálu připadajícím na jednu penzijní jednotku k 30. červnu rozhodného období a za předchozí tři uplynulá období k odst. 2 písm. i) Přílohy č. 2 k Vyhlášce:

Datum	Vlastní kapitál (v tis. Kč)	VK/jednotka (v Kč)
30. 6. 2016	120 052	1,0360
30. 6. 2017	198 063	1,0389
30. 6. 2018	279 789	1,0279

Spořicí účastnický fond Penzijní společnosti České pojišťovny, a. s.

- a) **Název účastnického fondu** k odst. 2 písm. a) Přílohy č. 2 k Vyhlášce:
Spořicí účastnický fond Penzijní společnosti České pojišťovny, a. s.
- b) **Údaje o penzijní společnosti, která obhospodařuje účastnický fond a případně o všech dalších penzijních společnostech, které účastnický fond obhospodařovaly v rozhodném období, spolu s uvedením doby, po kterou každá penzijní společnost účastnický fond obhospodařovala** k odst. 2 písm. b) Přílohy č. 2 k Vyhlášce:
Účastnický fond po celé rozhodné období obhospodařovala Penzijní společnost České pojišťovny, a. s., IČ: 618 58 692, se sídlem Na Pankráci 1720/123, 140 21 Praha 4 – Nusle, zapsaná v obchodním rejstříku vedeném u Městského soudu v Praze, oddíl B, vložka 2738.
- c) **Údaje o portfoliu manažerech účastnického fondu v rozhodném období a době, po kterou činnost portfolia manažera vykonávali** k odst. 2 písm. c) Přílohy č. 2 k Vyhlášce:
Celý majetek účastnického fondu byl svěřen do obhospodařování společnosti Generali Investments CEE, investiční společnost, a. s., IČ: 438 73 766, se sídlem Na Pankráci 1720/123, 140 21 Praha 4 – Nusle, zapsaná v obchodním rejstříku vedeném u Městského soudu v Praze, oddíl B, vložka 1031. V rozhodném období vykonával činnost portfolia manažera Ing. Michal Kymlička, CFA.
- d) **Údaje o všech depozitářích účastnického fondu v rozhodném období a době, po kterou činnost depozitáře vykonávali** k odst. 2 písm. d) Přílohy č. 2 k Vyhlášce:
Depozitářem účastnického fondu po celé rozhodné období byla společnost UniCredit Bank Czech Republic and Slovakia, a. s., IČ: 649 48 242, se sídlem Želetavská 1525/1, 140 92 Praha 4 – Michle, zapsaná v obchodním rejstříku vedeném u Městského soudu v Praze, oddíl B, vložka 3608.
- e) **Údaje o osobě, která zajišťuje úschovu nebo kontrolu stavu majetku účastnického fondu, pokud je u této osoby uloženo nebo je touto osobou kontrolován stav více než 1 % majetku fondu** k odst. 2 písm. e) Přílohy č. 2 k Vyhlášce:
V rozhodném období zajišťovala úschovu cenných papírů společnost UniCredit Bank Czech Republic and Slovakia, a. s., IČ: 649 48 242, se sídlem Želetavská 1525/1, 140 92 Praha 4 – Michle, zapsaná v obchodním rejstříku vedeném u Městského soudu v Praze, oddíl B, vložka 3608.
- f) **Identifikace majetku účastnického fondu, jehož hodnota přesahuje 1 % hodnoty majetku fondu ke dni, kdy bylo provedeno ocenění pro účely této zprávy, s uvedením celkové pořizovací ceny a reálné hodnoty na konci rozhodného období** k odst. 2 písm. f) Přílohy č. 2 k Vyhlášce:

Název	ISIN	Pořizovací cena (v tis. Kč)	Reálná cena (v tis. Kč)
Běžné účty	BU	127 342	127 348
Repo transakce	Reverzní repo	2 813 000	2 813 337
CZ GB 2.50 08/28	CZ0001003859	356 321	350 259
CZ GB 0.95 05/30	CZ0001004477	351 265	340 783
CZ GB L-10 11/27	CZ0001004105	265 471	264 667
CZ GB L+65 04/23	CZ0001003123	217 975	213 777
CZ GB 2.4 09/25	CZ0001004253	191 680	188 130
CZ GB 1.0 06/26	CZ0001004469	149 810	147 866
CZ GB 0.45 10/23	CZ0001004600	143 725	141 880
MOL 2.625 04/23	XS1401114811	105 927	105 127
CZ GB 2.75 07/29	CZ0001005375	104 864	104 937
PKO FIN 4.63 09/22	XS0783934085	87 209	87 612
CETIN FIN 1.25 12/23	XS1529936335	84 180	82 114
BNP PARIBAS L+110 03/25	XS1799097073	80 250	80 264
NE Property 3.75 02/21	XS1325078308	72 259	72 386
Black Sea T&D Bank 4.875 05/21	XS1405888576	70 092	68 742
RB ZERO 08/22	AT000B014055	69 908	67 352

g) Údaje o skladbě a změnách majetku účastnického fondu k odst. 2 písm. g) Přílohy č. 2 k Vyhlášce:

Aktiva k 30. 6. 2018 (v tis. Kč)	
Pohledávky za bankami a družstevními záložnami	2 951 093
a) splatné na požádání	127 348
b) ostatní pohledávky	2 823 745
Dluhové cenné papíry	3 695 289
a) vydané vládními institucemi	2 218 160
b) vydané ostatními osobami	1 477 129
Akcie, podílové listy a ostatní podíly	0
Ostatní aktiva	7 143
CELKEM	6 653 525

h) Údaje o úplatě určené penzijní společnosti za obhospodařování majetku v účastnickém fondu k odst. 2 písm. h) Přílohy č. 2 k Vyhlášce:

Úplata určená penzijní společnosti za obhospodařování majetku účastnického fondu činila na konci rozhodného období 1,0 % z průměrné roční hodnoty vlastního kapitálu účastnického fondu a 15 % z kladného rozdílu průměrné hodnoty penzijní jednotky v příslušném období a nejvyšší průměrné roční hodnoty penzijní jednotky v letech předcházejících příslušnému období od vzniku účastnického fondu vynásobené průměrným počtem penzijních jednotek v příslušném období.

i) Údaje o fondovém vlastním kapitálu účastnického fondu a fondovém vlastním kapitálu připadajícím na jednu penzijní jednotku k 30. červnu rozhodného období a za předchozí tři uplynulá období k odst. 2 písm. i) Přílohy č. 2 k Vyhlášce:

Datum	Vlastní kapitál (v tis. Kč)	VK/jednotka (v Kč)
30. 6. 2016	2 241 358	1,0697
30. 6. 2017	3 594 933	1,0753
30. 6. 2018	5 294 327	1,0609

Vyvážený účastnický fond Penzijní společnosti České pojišťovny, a. s.

- a) **Název účastnického fondu** k odst. 2 písm. a) Přílohy č. 2 k Vyhlášce:
Vyvážený účastnický fond Penzijní společnosti České pojišťovny, a. s.
- b) **Údaje o penzijní společnosti, která obhospodařuje účastnický fond a případně o všech dalších penzijních společnostech, které účastnický fond obhospodařovaly v rozhodném období, spolu s uvedením doby, po kterou každá penzijní společnost účastnický fond obhospodařovala** k odst. 2 písm. b) Přílohy č. 2 k Vyhlášce:
Účastnický fond po celé rozhodné období obhospodařovala Penzijní společnost České pojišťovny, a. s., IČ: 618 58 692, se sídlem Na Pankráci 1720/123, 140 21 Praha 4 – Nusle, zapsaná v obchodním rejstříku vedeném u Městského soudu v Praze, oddíl B, vložka 2738.
- c) **Údaje o portfoliu manažerech účastnického fondu v rozhodném období a době, po kterou činnost portfolia manažera vykonávali** k odst. 2 písm. c) Přílohy č. 2 k Vyhlášce:
Celý majetek účastnického fondu byl svěřen do obhospodařování společnosti Generali Investments CEE, investiční společnost, a. s., IČ: 438 73 766, se sídlem Na Pankráci 1720/123, 140 21 Praha 4 – Nusle, zapsaná v obchodním rejstříku vedeném u Městského soudu v Praze, oddíl B, vložka 1031. V rozhodném období vykonával činnost portfolia manažera Ing. Tomáš Derner.
- d) **Údaje o všech depozitářích účastnického fondu v rozhodném období a době, po kterou činnost depozitáře vykonávali** k odst. 2 písm. d) Přílohy č. 2 k Vyhlášce:
Depozitářem účastnického fondu po celé rozhodné období byla společnost UniCredit Bank Czech Republic and Slovakia, a. s., IČ: 649 48 242, se sídlem Želetavská 1525/1, 140 92 Praha 4 – Michle, zapsaná v obchodním rejstříku vedeném u Městského soudu v Praze, oddíl B, vložka 3608.
- e) **Údaje o osobě, která zajišťuje úschovu nebo kontrolu stavu majetku účastnického fondu, pokud je u této osoby uloženo nebo je touto osobou kontrolován stav více než 1 % majetku fondu** k odst. 2 písm. e) Přílohy č. 2 k Vyhlášce:
V rozhodném období zajišťovala úschovu cenných papírů společnost UniCredit Bank Czech Republic and Slovakia, a. s., IČ: 649 48 242, se sídlem Želetavská 1525/1, 140 92 Praha 4 – Michle, zapsaná v obchodním rejstříku vedeném u Městského soudu v Praze, oddíl B, vložka 3608.
- f) **Identifikace majetku účastnického fondu, jehož hodnota přesahuje 1 % hodnoty majetku fondu ke dni, kdy bylo provedeno ocenění pro účely této zprávy, s uvedením celkové pořizovací ceny a reálné hodnoty na konci rozhodného období** k odst. 2 písm. f) Přílohy č. 2 k Vyhlášce:

Název	ISIN	Pořizovací cena (v tis. Kč)	Reálná cena (v tis. Kč)
Běžné účty	BU	58 884	58 860
Repo transakce	Reverzní repo	512 600	512 677
EU STOXX50 ISHARES ETF	DE0005933956	79 295	80 039
DAX ISHARES ETF	DE0005933931	53 020	53 204
CZ GB 2.75 07/29	CZ0001005375	52 432	52 468
S&P 500 VANGUARD ETF	IE00B3XXRP09	40 447	47 385
MSCI EM iShares ETF	IE00BKM4GZ66	42 676	45 011
EU STOXX600 ISHARES ETF	DE0002635307	45 099	44 739
CZ GB 0.95 05/30	CZ0001004477	43 535	42 598
EU STOXX50 DB-X ETF	LU0274211217	31 001	31 526
EU STOXX50 DEKA ETF	DE000ETFL029	29 564	29 073
FTSE EM VANGUARD ETF	US9220428588	21 206	21 473
HOME CREDIT 3.75 03/20	CZ0000000831	18 000	18 629
CZ GB L+65 04/23	CZ0001003123	18 646	18 534
J&T GLOBAL FIN 3.0 11/19	CZ0003515199	18 005	18 134
MOL 2.625 04/23	XS1401114811	16 604	16 599
MSCI EM ISHARES ETF	US46434G1031	15 014	16 465

g) Údaje o skladbě a změnách majetku účastnického fondu k odst. 2 písm. g) Přílohy č. 2 k Vyhlášce:

Aktiva k 30. 6. 2018 (v tis. Kč)	
Pohledávky za bankami a družstevními záložnami	568 967
a) splatné na požádání	51 086
b) ostatní pohledávky	517 881
Dluhové cenné papíry	536 788
a) vydané vládními institucemi	200 780
b) vydané ostatními osobami	336 008
Akcie, podílové listy a ostatní podíly	469 342
Ostatní aktiva	933
CELKEM	1 576 030

h) Údaje o úplatě určené penzijní společnosti za obhospodařování majetku v účastnickém fondu k odst. 2 písm. h) Přílohy č. 2 k Vyhlášce:

Úplata určená penzijní společnosti za obhospodařování majetku účastnického fondu činila na konci rozhodného období 1,0 % z průměrné roční hodnoty vlastního kapitálu účastnického fondu a 15 % z kladného rozdílu průměrné hodnoty penzijní jednotky v příslušném období a nejvyšší průměrné roční hodnoty penzijní jednotky v letech předcházejících příslušnému období od vzniku účastnického fondu vynásobené průměrným počtem penzijních jednotek v příslušném období.

i) Údaje o fondovém vlastním kapitálu účastnického fondu a fondovém vlastním kapitálu připadajícím na jednu penzijní jednotku k 30. červnu rozhodného období a za předchozí tři uplynulá období k odst. 2 písm. i) Přílohy č. 2 k Vyhlášce:

Datum	Vlastní kapitál (v tis. Kč)	VK/jednotka (v Kč)
30. 6. 2016	436 212	1,0583
30. 6. 2017	802 418	1,1304
30. 6. 2018	1 321 202	1,1328

Dynamický účastnický fond Penzijní společnosti České pojišťovny, a. s.

- a) **Název účastnického fondu** k odst. 2 písm. a) Přílohy č. 2 k Vyhlášce:
Dynamický účastnický fond Penzijní společnosti České pojišťovny, a. s.
- b) **Údaje o penzijní společnosti, která obhospodařuje účastnický fond a případně o všech dalších penzijních společnostech, které účastnický fond obhospodařovaly v rozhodném období, spolu s uvedením doby, po kterou každá penzijní společnost účastnický fond obhospodařovala** k odst. 2 písm. b) Přílohy č. 2 k Vyhlášce:
Účastnický fond po celé rozhodné období obhospodařovala Penzijní společnost České pojišťovny, a. s., IČ: 618 58 692, se sídlem Na Pankráci 1720/123, 140 21 Praha 4 – Nusle, zapsaná v obchodním rejstříku vedeném u Městského soudu v Praze, oddíl B, vložka 2738.
- c) **Údaje o portfoliu manažerech účastnického fondu v rozhodném období a době, po kterou činnost portfolia manažera vykonávali** k odst. 2 písm. c) Přílohy č. 2 k Vyhlášce:
Celý majetek účastnického fondu byl svěřen do obhospodařování společnosti Generali Investments CEE, investiční společnost, a. s., IČ: 438 73 766, se sídlem Na Pankráci 1720/123, 140 21 Praha 4 – Nusle, zapsaná v obchodním rejstříku vedeném u Městského soudu v Praze, oddíl B, vložka 1031. V rozhodném období vykonával činnost portfolia manažera Ing. Tomáš Derner.
- d) **Údaje o všech depozitářích účastnického fondu v rozhodném období a době, po kterou činnost depozitáře vykonávali** k odst. 2 písm. d) Přílohy č. 2 k Vyhlášce:
Depozitářem účastnického fondu po celé rozhodné období byla společnost UniCredit Bank Czech Republic and Slovakia, a. s., IČ: 649 48 242, se sídlem Želetavská 1525/1, 140 92 Praha 4 – Michle, zapsaná v obchodním rejstříku vedeném u Městského soudu v Praze, oddíl B, vložka 3608.
- e) **Údaje o osobě, která zajišťuje úschovu nebo kontrolu stavu majetku účastnického fondu, pokud je u této osoby uloženo nebo je touto osobou kontrolován stav více než 1 % majetku fondu** k odst. 2 písm. e) Přílohy č. 2 k Vyhlášce:
V rozhodném období zajišťovala úschovu cenných papírů společnost UniCredit Bank Czech Republic and Slovakia, a. s., IČ: 649 48 242, se sídlem Želetavská 1525/1, 140 92 Praha 4 – Michle, zapsaná v obchodním rejstříku vedeném u Městského soudu v Praze, oddíl B, vložka 3608.
- f) **Identifikace majetku účastnického fondu, jehož hodnota přesahuje 1 % hodnoty majetku fondu ke dni, kdy bylo provedeno ocenění pro účely této zprávy, s uvedením celkové pořizovací ceny a reálné hodnoty na konci rozhodného období** k odst. 2 písm. f) Přílohy č. 2 k Vyhlášce:

Název	ISIN	Pořizovací cena (v tis. Kč)	Reálná cena (v tis. Kč)
Běžné účty	BU	35 621	35 661
Repo transakce	Reverzní repo	105 800	105 818
MSCI EM iShares ETF	IE00BKM4GZ66	42 847	44 447
EU STOXX50 ISHARES ETF	DE0005933956	37 026	37 731
DAX ISHARES ETF	DE0005933931	25 494	25 510
EU STOXX600 ISHARES ETF	DE0002635307	23 994	24 054
FTSE EM VANGUARD ETF	US9220428588	22 489	22 387
S&P 500 VANGUARD ETF	IE00B3XXRP09	14 686	16 851
EU STOXX50 DB-X ETF	LU0274211217	16 117	16 067
MSCI EM ISHARES ETF	US46434G1031	15 856	15 903
EU STOXX50 DEKA ETF	DE000ETFL029	13 668	13 687
NASDAQ BIOTECH ISHARES ETF	US4642875565	11 063	12 243
MOL 2.625 04/23	XS1401114811	11 070	11 066
HOME CREDIT 3.75 03/20	CZ0000000831	9 000	9 315
J&T GLOBAL FIN 3.0 11/19	CZ0003515199	9 003	9 067
EU STOXX50 AMUNDI ETF	LU1681047236	6 904	7 821

g) Údaje o skladbě a změnách majetku účastnického fondu k odst. 2 písm. g) Přílohy č. 2 k Vyhlášce:

Aktiva k 30. 6. 2018 (v tis. Kč)	
Pohledávky za bankami a družstevními záložnami	145 382
a) splatné na požádání	35 661
b) ostatní pohledávky	109 721
Dluhové cenné papíry	120 352
a) vydané vládními institucemi	22 585
b) vydané ostatními osobami	97 767
Akcie, podílové listy a ostatní podíly	501 856
Ostatní aktiva	540
CELKEM	768 130

h) Údaje o úplatě určené penzijní společnosti za obhospodařování majetku v účastnickém fondu k odst. 2 písm. h) Přílohy č. 2 k Vyhlášce:

Úplata určená penzijní společnosti za obhospodařování majetku účastnického fondu činila na konci rozhodného období 1,0 % z průměrné roční hodnoty vlastního kapitálu účastnického fondu a 15 % z kladného rozdílu průměrné hodnoty penzijní jednotky v příslušném období a nejvyšší průměrné roční hodnoty penzijní jednotky v letech předcházejících příslušnému období od vzniku účastnického fondu vynásobené průměrným počtem penzijních jednotek v příslušném období.

i) Údaje o fondovém vlastním kapitálu účastnického fondu a fondovém vlastním kapitálu připadajícím na jednu penzijní jednotku k 30. červnu rozhodného období a za předchozí tři uplynulá období k odst. 2 písm. i) Přílohy č. 2 k Vyhlášce:

Datum	Vlastní kapitál (v tis. Kč)	VK/jednotka (v Kč)
30. 6. 2016	157 914	1,0416
30. 6. 2017	337 595	1,1705
30. 6. 2018	657 329	1,1876

Penzijní společnost České pojišťovny, a. s.

Na Pankráci 1720/123, Nusle, 140 21 Praha 4, zapsaná v obchodním rejstříku u Městského soudu v Praze, odd. B, vložka 2738
IČ: 61858692, DIČ: CZ699001273, telefon: +420 261 149 111, e-mail: pfcp@pfcp.cz, internet: www.pfcp.cz