

Pololetní zpráva

Penzijní společnosti

České pojišťovny, a. s.

za období od 1. 1. 2015 do 30. 6. 2015

Obsah

Penzijní společnost České pojišťovny, a. s.	3
Transformovaný fond Penzijní společnosti České pojišťovny, a. s.	4
Povinný konzervativní fond Penzijní společnosti České pojišťovny, a. s.	6
Spořicí účastnický fond Penzijní společnosti České pojišťovny, a. s.	8
Vyvážený účastnický fond Penzijní společnosti České pojišťovny, a. s.	10
Dynamický účastnický fond Penzijní společnosti České pojišťovny, a. s.	12
Důchodový fond státních dluhopisů Penzijní společnosti České pojišťovny, a. s.	14
Konzervativní důchodový fond Penzijní společnosti České pojišťovny, a. s.	16
Vyvážený důchodový fond Penzijní společnosti České pojišťovny, a. s.	18
Dynamický důchodový fond Penzijní společnosti České pojišťovny, a. s.	20

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, důchodového fondu a účastnického fondu (dále jen „Vyhláška“) předkládá následující pololetní zprávu za penzijní společnost a za každý obhospodařovaný důchodový, účastnický a transformovaný fond:

Penzijní společnost České pojišťovny, a. s.

a) Údaje o důchodových fondech, účastnických fondech a transformovaném fondu, které byly v rozhodném období obhospodařovány penzijní společností 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.
- 6) Důchodový fond státních dluhopisů Penzijní společnosti České pojišťovny, a. s.
- 7) Konzervativní důchodový fond Penzijní společnosti České pojišťovny, a. s.
- 8) Vyvážený důchodový fond Penzijní společnosti České pojišťovny, a. s.
- 9) Dynamický důchodový 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

Bc. Martin Pšaidl – místopředseda představenstva, den vzniku členství 15. ledna 2014

Ing. Josef Beneš – člen představenstva, den vzniku členství 1. března 2015

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

Dozorčí rada

Gianluca Colocci – člen dozorčí rady, den vzniku členství 1. července 2014

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

Vedoucí osoby

Všechny vedoucí osoby byly zároveň členy představenstva.

Portfolio manažer

Celý majetek účastnických a důchodových fondů a transformovaného fondu, které byly v rozhodném období obhospodařovány penzijní společností, byl svěřen do obhospodařování společnosti Generali Investments CEE, a. s., IČ: 256 29 123, se sídlem Na Pankráci 1658/121, 140 00 Praha 4-Nusle, zapsaná v obchodním rejstříku vedeném u Městského soudu v Praze, oddíl B, vložka 5073.

c) Údaje o všech obchodnících s cennými papíry, kteří vykonávali činnost obchodníka s cennými papíry ve vztahu k důchodovým fondům, účastnickým fondům a transformovanému fondu obhospodařovaným 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 důchodové a účastnické fondy a pro transformovaný fond obhospodařované penzijní společností po celé rozhodné období vykonávaly společnosti Generali Investments CEE, a. s., IČ: 256 29 123, se sídlem Na Pankráci 1658/121, 140 00 Praha 4-Nusle, zapsaná v obchodním rejstříku vedeném u Městského soudu v Praze, oddíl B, vložka 5073, 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 a 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.

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, a. s., IČ: 256 29 123, se sídlem Na Pankráci 1658/121, 140 00 Praha 4-Nusle, zapsaná v obchodním rejstříku vedeném u Městského soudu v Praze, oddíl B, vložka 5073.
- 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)
CZ GB L+0 10/16	CZ0001002331	4 778 555	4 775 534
CZ GB 4.00 04/17	CZ0001001903	4 236 533	4 205 147
CZ GB L+85 07/17	CZ0001003438	1 544 500	1 531 181
CZ GB 5.00 04/19	CZ0001002471	7 619 535	7 384 013
CZ GB 1.5 10/19	CZ0001003834	1 342 125	1 428 019
CZ GB 3.75 09/20	CZ0001001317	7 120 533	7 471 693
CZ GB L-39 12/20	CZ0001004113	1 114 504	1 121 739
CZ GB 3.85 09/21	CZ0001002851	4 826 052	5 265 585
CZ GB 4.70 09/22	CZ0001001945	4 193 776	4 467 196
CZ GB L+65 04/23	CZ0001003123	4 076 020	4 207 403
CZ GB 5.70 05/24	CZ0001002547	6 499 723	6 191 760
CZ GB L-10 11/27	CZ0001004105	5 064 504	5 080 441
CZ GB 2.50 08/28	CZ0001003859	4 147 157	3 967 456
CZ GB 4.20 12/36	CZ0001001796	4 217 053	4 345 306
CZ GB 4.85 11/57	CZ0001002059	1 406 777	1 792 486
SK GB 4.375 05/22	XS0782720402	929 884	1 150 409
RO GB 4.875 11/19 EUR	XS0852474336	770 759	931 524
PKO FIN 4.63 09/22	XS0783934085	751 999	905 631
US TMI VANGUARD ETF	US9229087690	719 046	1 057 880

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

Aktiva k 30. 6. 2015 (v tis. Kč)	
Pohledávky za bankami a družstevními záložnami	2 627 052
a) splatné na požádání	589 765
b) ostatní pohledávky	2 037 287
Dluhové cenné papíry	83 554 283
a) vydané vládními institucemi	72 753 733
b) vydané ostatními osobami	10 800 550
Akcie, podílové listy a ostatní podíly	2 883 187
Ostatní aktiva	553 938
CELKEM	89 618 460

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 0,6 % z průměrné roční hodnoty bilanční sumy transformovaného fondu a 15 % 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, a. s., IČ: 256 29 123, se sídlem Na Pankráci 1658/121, 140 00 Praha 4-Nusle, zapsaná v obchodním rejstříku vedeném u Městského soudu v Praze, oddíl B, vložka 5073.
- 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	6 221	6 221
CZ GB 6.95 01/16	CZ0001000749	1 886	1 872
CZ GB L+0 10/16	CZ0001002331	15 469	15 483
CZ GB 4.00 04/17	CZ0001001903	6 695	6 641
CZ GB L+85 07/17	CZ0001003438	2 987	2 970
CZ GB 0.85 03/18	CZ0001004246	10 140	10 197
CZ GB L+65 04/23	CZ0001003123	19 618	19 777
CZ GB L-10 11/27	CZ0001004105	3 994	3 989
BNP PARIBAS L+65 01/18	XS0877209188	3 025	3 017
GE CAPITAL L+45 02/18	XS0884604728	1 984	1 995
CITY OF PRAGUE 4.25 5/21	CZ0001500110	1 133	1 173

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

Aktiva k 30. 6. 2015 (v tis. Kč)	
Pohledávky za bankami a družstevními záložnami	6 221
a) splatné na požádání	6 221
b) ostatní pohledávky	0
Dluhové cenné papíry	67 114
a) vydané vládními institucemi	60 929
b) vydané ostatními osobami	6 185
Akcie, podílové listy a ostatní podíly	0
Ostatní aktiva	823
CELKEM	74 158

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. 2013	7 542	1,0146
30. 6. 2014	46 143	1,0301
30. 6. 2015	71 979	1,0339

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, a. s., IČ: 256 29 123, se sídlem Na Pankráci 1658/121, 140 00 Praha 4 – Nusle, zapsaná v obchodním rejstříku vedeném u Městského soudu v Praze, oddíl B, vložka 5073.
- 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	60 362	60 363
CZ GB 0.5 07/16	CZ0001003842	19 760	20 099
CZ GB L+0 10/16	CZ0001002331	45 930	46 046
CZ GB 4.00 04/17	CZ0001001903	34 450	33 473
CZ GB L+85 07/17	CZ0001003438	48 135	47 625
CZ GB 0.85 03/18	CZ0001004246	25 358	25 492
CZ GB 5.00 04/19	CZ0001002471	57 681	57 022
CZ GB 3.75 09/20	CZ0001001317	40 635	41 899
CZ GB L-39 12/20	CZ0001004113	30 839	31 048
CZ GB 3.85 09/21	CZ0001002851	39 798	43 018
CZ GB L+65 04/23	CZ0001003123	130 965	131 488
CZ GB 2.4 03/25	CZ0001004253	32 620	33 160
CZ GB L-10 11/27	CZ0001004105	163 471	163 563
SI GB 4.375 01/21	SI0002103149	11 936	12 795
SI GB 4.375 02/19	SI0002102794	19 216	19 292
PGNIG FIN 4.0 02/17	XS0746259323	31 546	31 516
PROVIDENT L+450 03/18	XS0599391223	13 376	15 958
CITIGROUP 4.75 02/19	XS0185490934	17 674	17 649
BPCE L+53 02/19	FR0011734961	20 024	19 899
MBANK FIN 2.375 04/19	XS1050665386	25 220	24 964
VW FIN L+34 04/19	XS1054089609	18 799	18 843
LEASEPLAN L+50 05/19	XS1071708983	20 000	19 937

Pokračování na další straně.

Pokračování ze strany 8.

Název	ISIN	Požizovací cena (v tis. Kč)	Reálná cena (v tis. Kč)
PROVIDENT 8.0 10/19	XS0459028626	27 528	29 861
RO GB 4.875 11/19 EUR	XS0852474336	28 478	29 712
GS L+70 05/20	XS1240146891	21 799	21 684
SPP 3.75 07/20	XS0953958641	20 841	21 339
SPP DISTR. 2.625 06/21	XS1077088984	12 497	12 894
ORLEN CAP 2.5 06/21	XS1082660744	19 859	20 001
GS 4.75 10/21	XS0270347304	12 837	12 934
TR GB 4.35 11/21	XS0993155398	36 231	35 328
BG GB 2.0 03/22	XS1208855616	32 531	31 671
PKO FIN 4.63 09/22	XS0783934085	17 343	20 483

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

Aktiva k 30. 6. 2015 (v tis. Kč)	
Pohledávky za bankami a družstevními záložnami	60 363
a) splatné na požádání	60 363
b) ostatní pohledávky	0
Dluhové cenné papíry	1 177 895
a) vydané vládními institucemi	844 801
b) vydané ostatními osobami	333 094
Akcie, podílové listy a ostatní podíly	0
Ostatní aktiva	24 431
CELKEM	1 262 689

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 0,8 % 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. 2013	98 283	1,0066
30. 6. 2014	498 941	1,0428
30. 6. 2015	1 222 002	1,0514

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, a. s., IČ: 256 29 123, se sídlem Na Pankráci 1658/121, 140 00 Praha 4 – Nusle, zapsaná v obchodním rejstříku vedeném u Městského soudu v Praze, oddíl B, vložka 5073.
- 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	16 725	16 726
CZ GB 4.00 04/17	CZ0001001903	6 004	5 939
CZ GB 5.00 04/19	CZ0001002471	19 275	19 007
CZ GB L-39 12/20	CZ0001004113	4 974	5 008
CZ GB L+65 04/23	CZ0001003123	11 127	11 424
CZ GB 4.85 11/57	CZ0001002059	1 960	2 813
PL GB 3.75 04/18	PL0000107314	7 040	6 817
SI GB 4.375 02/19	SI0002102794	3 064	3 112
SI GB 3.00 04/21	SI0002103388	3 293	3 249
MOL 5.875 04/17	XS0503453275	8 908	8 859
PROVIDENT L+450 03/18	XS0599391223	3 323	3 989
LUKOIL 3.416 4/18	XS0919502434	3 856	4 715
IPF 5.25 11/18	XS0996458732	3 811	3 964
CITIGROUP 4.75 02/19	XS0185490934	3 448	3 394
MBANK FIN 2.375 04/19	XS1050665386	3 435	3 329
LEASEPLAN L+50 05/19	XS1071708983	4 000	3 987
CESKE DRAHY 4.125 07/19	XS0807706006	4 889	4 969
CETELEM L+46 10/19	CZ0003511529	3 000	2 988
PROVIDENT 8.0 10/19	XS0459028626	3 752	3 833
SPP 3.75 07/20	XS0953958641	3 155	3 325
EURAS.DEV.BANK 5.0 09/20	XS0972645112	4 874	4 867
IPF 5.75 04/21	XS1054714248	5 673	5 574

Pokračování na další straně.

Název	ISIN	Požizovací cena (v tis. Kč)	Reálná cena (v tis. Kč)
ORLEN CAP 2.5 06/21	XS1082660744	3 257	3 288
SYNTHOS FIN 4.00 09/21	XS1115183359	3 521	3 537
GS 4.75 10/21	XS0270347304	3 427	3 395
TR GB 4.35 11/21	XS0993155398	3 031	3 020
BG GB 2.0 03/22	XS1208855616	8 133	7 918
PKO FIN 4.63 09/22	XS0783934085	4 273	5 121
ERSTE BANK 7.125 10/22	XS0840062979	5 272	5 155
EU STOXX50 DB-X ETF	LU0274211217	18 928	19 509
EU STOXX50 DEKA ETF	DE000ETFLO29	19 488	18 970
EU STOXX50 ISHARES ETF	DE0005933956	10 604	10 601
S&P 500 VANGUARD ETF	IE00B3XXRP09	4 808	6 035
MSCI EM iShares ETF	IE00BKM4GZ66	4 393	4 678
S&P 500 SPDR ETF	IE00B5BMR087	4 021	4 629
MSCI EM ISHARES ETF	US46434G1031	2 545	2 924

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

Aktiva k 30. 6. 2015 (v tis. Kč)	
Pohledávky za bankami a družstevními záložnami	16 726
a) splatné na požádání	16 726
b) ostatní pohledávky	0
Dluhové cenné papíry	150 530
a) vydané vládními institucemi	75 134
b) vydané ostatními osobami	75 396
Akcie, podílové listy a ostatní podíly	71 519
Ostatní aktiva	7 039
CELKEM	245 814

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 0,8 % 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. 2013	11 298	1,0152
30. 6. 2014	83 594	1,0563
30. 6. 2015	233 979	1,0749

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, a. s., IČ: 256 29 123, se sídlem Na Pankráci 1658/121, 140 00 Praha 4 – Nusle, zapsaná v obchodním rejstříku vedeném u Městského soudu v Praze, oddíl B, vložka 5073.
- 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	6 117	6 118
CZ GB 5.00 04/19	CZ0001002471	6 985	6 890
CZ GB L-39 12/20	CZ0001004113	2 289	2 304
CZ GB L+65 04/23	CZ0001003123	989	1 024
SI GB 4.375 02/19	SI0002102794	2 187	2 178
ERSTE BANK L+40 07/17	XS0260783005	1 309	1 304
GAZ CAPITAL 8.146 04/18	XS0357281558	2 180	2 653
MBANK FIN 2.375 04/19	XS1050665386	2 142	2 080
RO GB 4.875 11/19 EUR	XS0852474336	2 401	2 409
NET4GAS 2.25 01/21	XS1090620730	3 176	3 280
IPF 5.75 04/21	XS1054714248	2 842	2 787
SYNTHOS FIN 4.00 09/21	XS1115183359	2 733	2 721
EU STOXX50 DB-X ETF	LU0274211217	2 870	6 397
EU STOXX50 ISHARES ETF	DE0005933956	4 344	4 393
MSCI EM iShares ETF	IE00BKM4GZ66	3 271	3 508
EU STOXX50 AMUNDI ETF	FR0010654913	2 891	3 091
SPDR S&P 500 ETF	IE00B6YX5C33	2 246	2 512
S&P 500 VANGUARD ETF	IE00B3XXRP09	1 891	2 395
S&P 500 SPDR ETF	IE00B5BMR087	1 719	2 083
FTSE EM VANGUARD ETF	US9220428588	1 748	1 991
CA IMMOBILIEN	AT0000641352	1 674	1 492
SIEMENS	DE0007236101	1 210	1 111

Pokračování na další straně.

Pokračování ze strany 12.

Název	ISIN	Požizovací cena (v tis. Kč)	Reálná cena (v tis. Kč)
LVMH	FR0000121014	1 108	1 070
ALLIANZ	DE0008404005	1 039	954
ATRIUM EUROPEAN RE	JE00B3DCF752	965	915
NESTLE	CH0038863350	958	884

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

Aktiva k 30. 6. 2015 (v tis. Kč)	
Pohledávky za bankami a družstevními záložnami	6 118
a) splatné na požádání	6 118
b) ostatní pohledávky	0
Dluhové cenné papíry	30 353
a) vydané vládními institucemi	15 528
b) vydané ostatními osobami	14 825
Akcie, podílové listy a ostatní podíly	44 133
Ostatní aktiva	5 274
CELKEM	85 878

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 0,8 % 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. 2013	2 299	1,0131
30. 6. 2014	29 286	1,0611
30. 6. 2015	83 090	1,0617

Důchodový fond státních dluhopisů Penzijní společnosti České pojišťovny, a. s.

- a) **Název důchodového fondu** k odst. 2 písm. a) Přílohy č. 2 k Vyhlášce:
Důchodový fond státních dluhopisů Penzijní společnosti České pojišťovny, a. s.
- b) **Údaje o penzijní společnosti, která obhospodařuje důchodový fond a případně o všech dalších penzijních společnostech, které důchodový fond obhospodařovaly v rozhodném období, spolu s uvedením doby, po kterou každá penzijní společnost důchodový fond obhospodařovala** k odst. 2 písm. b) Přílohy č. 2 k Vyhlášce:
Důchodový 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 důchodového fondu v rozhodném období a době, po kterou činnost portfolia manažera vykonávali** k odst. 2 písm. c) Přílohy č. 2 k Vyhlášce:
Celý majetek důchodového fondu byl svěřen do obhospodařování společnosti Generali Investments CEE, a. s., IČ: 256 29 123, se sídlem Na Pankráci 1658/121, 140 00 Praha 4 – Nusle, zapsaná v obchodním rejstříku vedeném u Městského soudu v Praze, oddíl B, vložka 5073.
- d) **Údaje o všech depozitářích důchodového fondu v rozhodném období a době, po kterou činnost depozitáře vykonávali** k odst. 2 písm. d) Přílohy č. 2 k Vyhlášce:
Depozitářem důchodového 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 důchodového 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 důchodového 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	231	231
Termínované vklady	TV	500	500
CZ GB 6.95 01/16	CZ0001000749	808	802
CZ GB 0.5 07/16	CZ0001003842	403	402
CZ GB L+0 10/16	CZ0001002331	854	855
CZ GB 4.00 04/17	CZ0001001903	818	810
CZ GB L+85 07/17	CZ0001003438	1 788	1 782
CZ GB 0.85 03/18	CZ0001004246	1 330	1 326
CZ GB L+65 04/23	CZ0001003123	1 343	1 347

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

Aktiva k 30. 6. 2015 (v tis. Kč)	
Pohledávky za bankami a družstevními záložnami	731
a) splatné na požádání	231
b) ostatní pohledávky	500
Dluhové cenné papíry	7 324
a) vydané vládními institucemi	7 324
b) vydané ostatními osobami	0
Akcie, podílové listy a ostatní podíly	0
Ostatní aktiva	12
CELKEM	8 067

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

Úplata určená penzijní společností za obhospodařování majetku důchodového fondu činila na konci rozhodného období 0,0 % z průměrné roční hodnoty vlastního kapitálu důchodového fondu.

- i) **Údaje o fondovém vlastním kapitálu důchodového fondu a fondovém vlastním kapitálu připadajícím na jednu důchodovou 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. 2013	17	1,0000
30. 6. 2014	3 830	1,0045
30. 6. 2015	8 004	1,0054

Konzervativní důchodový fond Penzijní společnosti České pojišťovny, a. s.

- a) **Název důchodového fondu** k odst. 2 písm. a) Přílohy č. 2 k Vyhlášce:
Konzervativní důchodový fond Penzijní společnosti České pojišťovny, a. s.
- b) **Údaje o penzijní společnosti, která obhospodařuje důchodový fond a případně o všech dalších penzijních společnostech, které důchodový fond obhospodařovaly v rozhodném období, spolu s uvedením doby, po kterou každá penzijní společnost důchodový fond obhospodařovala** k odst. 2 písm. b) Přílohy č. 2 k Vyhlášce:
Důchodový 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 důchodového fondu v rozhodném období a době, po kterou činnost portfolia manažera vykonávali** k odst. 2 písm. c) Přílohy č. 2 k Vyhlášce:
Celý majetek důchodového fondu byl svěřen do obhospodařování společnosti Generali Investments CEE, a. s., IČ: 256 29 123, se sídlem Na Pankráci 1658/121, 140 00 Praha 4 – Nusle, zapsaná v obchodním rejstříku vedeném u Městského soudu v Praze, oddíl B, vložka 5073.
- d) **Údaje o všech depozitářích důchodového fondu v rozhodném období a době, po kterou činnost depozitáře vykonávali** k odst. 2 písm. d) Přílohy č. 2 k Vyhlášce:
Depozitářem důchodového 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 důchodového 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 důchodového 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)
Běžné účty	BU	6 835	6 835
MF 707 04/16	CZ0001004493	13 999	13 998
CZ GB 0.5 07/16	CZ0001003842	31 199	31 154
CZ GB L+0 10/16	CZ0001002331	48 918	48 962
CZ GB 4.00 04/17	CZ0001001903	16 541	16 197
CZ GB L+85 07/17	CZ0001003438	45 212	45 065
CZ GB 0.85 03/18	CZ0001004246	28 962	29 061
CZ GB L+65 04/23	CZ0001003123	33 480	34 219
BNP PARIBAS L+65 01/18	XS0877209188	5 977	6 033
GE CAPITAL L+45 02/18	XS0884604728	5 955	5 984

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

Aktiva k 30. 6. 2015 (v tis. Kč)	
Pohledávky za bankami a družstevními záložnami	6 835
a) splatné na požádání	6 835
b) ostatní pohledávky	0
Dluhové cenné papíry	230 673
a) vydané vládními institucemi	218 656
b) vydané ostatními osobami	12 017
Akcie, podílové listy a ostatní podíly	0
Ostatní aktiva	457
CELKEM	237 965

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

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

i) Údaje o fondovém vlastním kapitálu důchodového fondu a fondovém vlastním kapitálu připadajícím na jednu důchodovou 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. 2013	2 645	1,0036
30. 6. 2014	101 008	1,0201
30. 6. 2015	235 947	1,0252

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

- a) **Název důchodového fondu** k odst. 2 písm. a) Přílohy č. 2 k Vyhlášce:
Vyvážený důchodový fond Penzijní společnosti České pojišťovny, a. s.
- b) **Údaje o penzijní společnosti, která obhospodařuje důchodový fond a případně o všech dalších penzijních společnostech, které důchodový fond obhospodařovaly v rozhodném období, spolu s uvedením doby, po kterou každá penzijní společnost důchodový fond obhospodařovala** k odst. 2 písm. b) Přílohy č. 2 k Vyhlášce:
Důchodový 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 důchodového fondu v rozhodném období a době, po kterou činnost portfolia manažera vykonávali** k odst. 2 písm. c) Přílohy č. 2 k Vyhlášce:
Celý majetek důchodového fondu byl svěřen do obhospodařování společnosti Generali Investments CEE, a. s., IČ: 256 29 123, se sídlem Na Pankráci 1658/121, 140 00 Praha 4 – Nusle, zapsaná v obchodním rejstříku vedeném u Městského soudu v Praze, oddíl B, vložka 5073.
- d) **Údaje o všech depozitářích důchodového fondu v rozhodném období a době, po kterou činnost depozitáře vykonávali** k odst. 2 písm. d) Přílohy č. 2 k Vyhlášce:
Depozitářem důchodového 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 důchodového 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 důchodového 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)
Běžné účty	BU	10 727	10 727
Termínované vklady	TV	25 000	25 008
CZ GB 0.5 07/16	CZ0001003842	50 255	50 249
CZ GB L+0 10/16	CZ0001002331	64 411	64 445
CZ GB L+85 07/17	CZ0001003438	75 901	75 688
CZ GB 5.00 04/19	CZ0001002471	14 449	14 256
CZ GB 1.5 10/19	CZ0001003834	24 714	25 070
CZ GB L-10 11/27	CZ0001004105	19 684	19 947
CZ GB 4.85 11/57	CZ0001002059	4 424	6 350
CITY OF PRAGUE 4.25 5/21	CZ0001500110	5 665	5 866
MSCI EM iShares ETF	IE00BKM4GZ66	6 225	6 956
EU STOXX50 DB-X ETF	LU0274211217	5 932	6 536

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

Aktiva k 30. 6. 2015 (v tis. Kč)	
Pohledávky za bankami a družstevními záložnami	35 735
a) splatné na požádání	10 727
b) ostatní pohledávky	25 008
Dluhové cenné papíry	269 638
a) vydané vládními institucemi	259 021
b) vydané ostatními osobami	10 617
Akcie, podílové listy a ostatní podíly	15 398
Ostatní aktiva	967
CELKEM	321 738

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

Úplata určená penzijní společností za obhospodařování majetku důchodového fondu činila na konci rozhodného období 0,5 % z průměrné roční hodnoty vlastního kapitálu důchodového fondu a 10 % z kladného rozdílu průměrné hodnoty důchodové jednotky v příslušném období a nejvyšší průměrné roční hodnoty důchodové jednotky v letech předcházejících příslušnému období od vzniku důchodového fondu vynásobené průměrným počtem důchodových jednotek v příslušném období.

i) Údaje o fondovém vlastním kapitálu důchodového fondu a fondovém vlastním kapitálu připadajícím na jednu důchodovou 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. 2013	2 038	1,0035
30. 6. 2014	119 365	1,0431
30. 6. 2015	317 449	1,0578

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

- a) **Název důchodového fondu** k odst. 2 písm. a) Přílohy č. 2 k Vyhlášce:
Dynamický důchodový fond Penzijní společnosti České pojišťovny, a. s.
- b) **Údaje o penzijní společnosti, která obhospodařuje důchodový fond a případně o všech dalších penzijních společnostech, které důchodový fond obhospodařovaly v rozhodném období, spolu s uvedením doby, po kterou každá penzijní společnost důchodový fond obhospodařovala** k odst. 2 písm. b) Přílohy č. 2 k Vyhlášce:
Důchodový 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 důchodového fondu v rozhodném období a době, po kterou činnost portfolia manažera vykonávali** k odst. 2 písm. c) Přílohy č. 2 k Vyhlášce:
Celý majetek důchodového fondu byl svěřen do obhospodařování společnosti Generali Investments CEE, a. s., IČ: 256 29 123, se sídlem Na Pankráci 1658/121, 140 00 Praha 4 – Nusle, zapsaná v obchodním rejstříku vedeném u Městského soudu v Praze, oddíl B, vložka 5073.
- d) **Údaje o všech depozitářích důchodového fondu v rozhodném období a době, po kterou činnost depozitáře vykonávali** k odst. 2 písm. d) Přílohy č. 2 k Vyhlášce:
Depozitářem důchodového 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 důchodového 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 důchodového 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	10 820	10 821
MF 707 04/16	CZ0001004493	14 998	14 998
CZ GB 0.5 07/16	CZ0001003842	20 640	20 602
CZ GB L+0 10/16	CZ0001002331	56 113	56 150
CZ GB L+85 07/17	CZ0001003438	71 884	71 694
CZ GB 0.85 03/18	CZ0001004246	24 343	24 473
CZ GB 5.00 04/19	CZ0001002471	19 275	19 007
CZ GB L-39 12/20	CZ0001004113	4 974	5 008
CZ GB L+65 04/23	CZ0001003123	3 956	4 096
CZ GB L-10 11/27	CZ0001004105	14 722	14 960
CZ GB 4.20 12/36	CZ0001001796	5 992	6 974
CZ GB 4.85 11/57	CZ0001002059	4 424	6 350
SI GB 4.375 02/19	SI0002102794	6 143	6 223
PROVIDENT L+450 03/18	XS0599391223	3 323	3 989
EESTI ENERGIA 4.25 10/18	XS0763379343	7 321	7 435
PKO FIN 2.324 01/19	XS1019818787	9 759	9 667
CITIGROUP 4.75 02/19	XS0185490934	6 452	6 353
LEASEPLAN L+50 05/19	XS1071708983	4 000	3 987
PROVIDENT 8.0 10/19	XS0459028626	9 914	11 142
EURAS.DEV.BANK 5.0 09/20	XS0972645112	4 389	5 111
NET4GAS 2.25 01/21	XS1090620730	6 352	6 561
SPP DISTR. 2.625 06/21	XS1077088984	6 145	6 447

Pokračování na další straně.

Pokračování ze strany 20.

Název	ISIN	Požizovací cena (v tis. Kč)	Reálná cena (v tis. Kč)
EU STOXX50 DB-X ETF	LU0274211217	12 862	13 851
MSCI EM iShares ETF	IE00BKM4GZ66	7 526	8 160
EU STOXX50 ISHARES ETF	DE0005933956	6 605	6 303
S&P 500 VANGUARD ETF	IE00B3XXRP09	6 039	7 663

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

Aktiva k 30. 6. 2015 (v tis. Kč)	
Pohledávky za bankami a družstevními záložnami	10 821
a) splatné na požádání	10 821
b) ostatní pohledávky	0
Dluhové cenné papíry	324 328
a) vydané vládními institucemi	255 646
b) vydané ostatními osobami	68 682
Akcie, podílové listy a ostatní podíly	39 535
Ostatní aktiva	1 390
CELKEM	376 074

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

Úplata určená penzijní společností za obhospodařování majetku důchodového fondu činila na konci rozhodného období 0,6 % z průměrné roční hodnoty vlastního kapitálu důchodového fondu a 10 % z kladného rozdílu průměrné hodnoty důchodové jednotky v příslušném období a nejvyšší průměrné roční hodnoty důchodové jednotky v letech předcházejících příslušnému období od vzniku důchodového fondu vynásobené průměrným počtem důchodových jednotek v příslušném období.

i) Údaje o fondovém vlastním kapitálu důchodového fondu a fondovém vlastním kapitálu připadajícím na jednu důchodovou 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. 2013	3 299	1,0035
30. 6. 2014	177 736	1,0583
30. 6. 2015	372 794	1,0787

Penzijní společnost České pojišťovny, a. s.

Na Pankráci 1720/123, 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: pfc@pfc.cz, internet: www.pfc.cz