
Pololetní zpráva Penzijní společnosti České pojišťovny, a. s.

za období od 1. 1. 2016 do 30. 6. 2016



**PENZIJNÍ SPOLEČNOST
ČESKÉ POJIŠŤOVNY**

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

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 účastnických a důchodových fondů a transformovaného fondu, 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 00 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 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, 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 a Merrill Lynch International Bank Ltd. London, se sídlem 2 King Edward Street, EC1A1HQ London, Spojené království Velké Británie a Severního Irsku.

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 00 Praha 4-Nusle, zapsaná v obchodním rejstříku vedeném u Městského soudu v Praze, oddíl B, vložka 1031. Do 11. 5. 2016 vykonával činnost portfolio manažera Ing. Michal Toufar, CFA. Od 11. 5. 2016 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	2 500 000	2 500 013
CZ GB L+0 10/16	CZ0001002331	4 778 555	4 759 215
CZ GB 4.00 04/17	CZ0001001903	4 236 533	4 052 213
CZ GB L+85 07/17	CZ0001003438	1 687 937	1 657 597
CZ GB 5.00 04/19	CZ0001002471	7 619 535	7 160 278
CZ GB 1.5 10/19	CZ0001003834	1 342 125	1 430 719
CZ GB 3.75 09/20	CZ0001001317	7 120 533	7 361 567
CZ GB L-39 12/20	CZ0001004113	1 114 504	1 124 799
CZ GB 3.85 09/21	CZ0001002851	4 826 052	5 239 589
CZ GB 4.70 09/22	CZ0001001945	4 442 826	4 429 453
CZ GB L+65 04/23	CZ0001003123	5 109 736	5 241 512
CZ GB 5.70 05/24	CZ0001002547	6 499 723	6 042 533
CZ GB L-10 11/27	CZ0001004105	6 862 218	7 010 935
CZ GB 2.50 08/28	CZ0001003859	3 901 385	4 062 682
CZ GB 4.20 12/36	CZ0001001796	6 166 639	6 393 329
CZ GB 4.85 11/57	CZ0001002059	1 406 850	2 131 959
SK GB 4.375 05/22	XS0782720402	929 884	1 203 368
S&P 500 VANGUARD ETF	IE00B3XXRP09	1 068 215	1 056 995

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

Aktiva k 30. 6. 2016 (v tis. Kč)	
Pohledávky za bankami a družstevními záložnami	4 065 554
a) splatné na požádání	823 541
b) ostatní pohledávky	3 242 013
Dluhové cenné papíry	89 262 472
a) vydané vládními institucemi	78 404 594
b) vydané ostatními osobami	10 857 878
Akcie, podílové listy a ostatní podíly	2 691 171
Ostatní aktiva	46 100
CELKEM	96 065 297

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 00 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	Požizovací cena (v tis. Kč)	Reálná cena (v tis. Kč)
Běžné účty	BU	10 894	10 895
Termínované vklady	TV	8 000	8 001
Repo transakce	Reverzní repo	16 000	16 000
CZ GB L+0 10/16	CZ0001002331	18 482	18 436
CZ GB 4.00 04/17	CZ0001001903	6 695	6 399
CZ GB L+85 07/17	CZ0001003438	6 061	5 982
CZ GB 0.85 03/18	CZ0001004246	10 140	10 187
CZ GB 4.70 09/22	CZ0001001945	4 640	4 633
CZ GB L+65 04/23	CZ0001003123	19 613	19 772
CZ GB L-10 11/27	CZ0001004105	15 283	15 267
BNP PARIBAS L+65 01/18	XS0877209188	3 025	3 036
GE CAPITAL L+45 02/18	XS0884604728	1 984	2 020
LLOYDS BANK 5.375 09/19	XS0449361350	3 253	3 250

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

Aktiva k 30. 6. 2016 (v tis. Kč)	
Pohledávky za bankami a družstevními záložnami	34 896
a) splatné na požádání	10 895
b) ostatní pohledávky	24 001
Dluhové cenné papíry	90 160
a) vydané vládními institucemi	80 675
b) vydané ostatními osobami	9 485
Akcie, podílové listy a ostatní podíly	0
Ostatní aktiva	37
CELKEM	125 093

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 0,4 % 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. 2014	46 143	1,0301
30. 6. 2015	71 979	1,0339
30. 6. 2016	120 052	1,0360

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 00 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	120 585	120 564
Repo transakce	Reverzní repo	130 000	130 001
CZ GB L+0 10/16	CZ0001002331	57 984	57 912
CZ GB 4.00 04/17	CZ0001001903	34 450	32 256
CZ GB L+85 07/17	CZ0001003438	48 135	47 143
CZ GB 0.85 03/18	CZ0001004246	25 358	25 467
CZ GB 5.00 04/19	CZ0001002471	57 667	55 306
CZ GB 3.75 09/20	CZ0001001317	40 635	41 573
CZ GB L-39 12/20	CZ0001004113	30 839	31 133
CZ GB 3.85 09/21	CZ0001002851	39 798	42 952
CZ GB L+65 04/23	CZ0001003123	217 975	218 729
CZ GB 2.4 03/25	CZ0001004253	32 216	34 869
CZ GB L-10 11/27	CZ0001004105	248 919	251 397
RO GB 4.875 11/19 EUR	XS0852474336	28 432	29 565
LT GB 7.375 02/20	XS0485991417	37 631	38 426
RO GB 4.625 09/20	XS0972758741	28 530	28 536
MX GB 2.375 04/21	XS1054418196	39 890	40 237
PL GB 5.125 04/21	US857524AA08	52 237	52 781
TR GB 4.35 11/21	XS0993155398	35 903	35 724
BG GB 2.0 03/22	XS1208855616	45 974	47 500
PGNIG FIN 4.0 02/17	XS0746259323	31 137	30 713

Pokračování na další straně.

Pokračování ze strany 8.

Název	ISIN	Požizovací cena (v tis. Kč)	Reálná cena (v tis. Kč)
CITIGROUP 4.75 02/19	XS0185490934	23 937	24 043
MBANK FIN 2.375 04/19	XS1050665386	25 201	24 957
BANK OF AM. L+146 05/19	XS0191752434	29 933	30 110
PGE 1.625 06/19	XS1075312626	40 837	41 543
PZU FIN 1.375 07/19	XS1082661551	53 328	53 989
PROVIDENT 8.0 10/19	XS0459028626	27 528	25 086
SPP 3.75 07/20	XS0953958641	23 746	25 245
NE Property 3.75 02/21	XS1325078308	29 613	31 404
Black Sea T&D Bank 4.875 05/21	XS1405888576	26 001	28 449
DEUTSCHE BANK L+145 06/21	XS1437011585	23 603	23 452
ORLEN CAP 2.5 06/21	XS1082660744	32 144	32 877
NET4GAS 2.5 07/21	XS1090450047	24 488	24 768
CEZ 4.25 04/22	XS0764313614	33 504	34 512
ERSTE BANK 7.125 10/22	XS0840062979	23 913	23 877
ATRIUM 3.625 10/22	XS1118586244	43 661	45 147
ALSTRIA REIT 2.125 04/23	XS1346695437	30 517	31 510

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

Aktiva k 30. 6. 2016 (v tis. Kč)	
Pohledávky za bankami a družstevními záložnami	250 565
a) splatné na požádání	120 564
b) ostatní pohledávky	130 001
Dluhové cenné papíry	2 026 592
a) vydané vládními institucemi	1 216 939
b) vydané ostatními osobami	809 653
Akcie, podílové listy a ostatní podíly	0
Ostatní aktiva	2 063
CELKEM	2 279 220

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. 2014	498 941	1,0428
30. 6. 2015	1 222 002	1,0514
30. 6. 2016	2 241 358	1,0697

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 00 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	38 774	38 850
Termínované vklady	TV	15 000	15 000
CZ GB 5.00 04/19	CZ0001002471	14 456	13 826
CZ GB L-39 12/20	CZ0001004113	4 974	5 021
CZ GB L+65 04/23	CZ0001003123	18 646	18 964
PL GB 3.75 04/18	PL0000107314	7 019	6 386
HU GB 6.25 01/20	US445545AD87	5 380	5 563
TR GB 4.35 11/21	XS0993155398	6 066	6 107
BG GB 2.0 03/22	XS1208855616	8 133	8 382
RO GB 3.625 04/24	XS1060842975	8 972	9 095
MOL 5.875 04/17	XS0503453275	8 850	8 596
LUKOIL 3.416 4/18	XS0919502434	3 856	4 994
MBANK FIN 2.375 04/19	XS1050665386	6 150	6 101
TURK TELEKOM. 3.75 06/19	XS1028952155	5 036	4 976
PZU FIN 1.375 07/19	XS1082661551	5 412	5 534
CESKE DRAHY 4.125 07/19	XS0807706006	4 865	4 936
PROVIDENT 8.0 10/19	XS0459028626	5 994	5 092
SB CAPITAL 3.3524 11/19	XS1082459568	5 334	5 838
ENERGA FIN 3.25 03/20	XS0906117980	6 229	6 371
EURAS.DEV.BANK 5.0 09/20	XS0972645112	4 811	5 153
NET4GAS 2.25 01/21	XS1090620730	6 516	6 577

Pokračování na další straně.

Pokračování ze strany 10.

Název	ISIN	Požizovací cena (v tis. Kč)	Reálná cena (v tis. Kč)
NE Property 3.75 02/21	XS1325078308	5 384	5 710
IPF 5.75 04/21	XS1054714248	5 646	4 904
Black Sea T&D Bank 4.875 05/21	XS1405888576	5 002	5 173
ORLEN CAP 2.5 06/21	XS1082660744	7 385	7 523
SYNTHOS FIN 4.00 09/21	XS1115183359	7 605	7 651
HUNG.DEV.BANK 2.375 12/21	XS1330975977	5 394	5 699
PKO FIN 4.63 09/22	XS0783934085	4 273	5 177
ERSTE BANK 7.125 10/22	XS0840062979	5 272	5 458
ATRIUM 3.625 10/22	XS1118586244	7 140	7 525
ALSTRIA REIT 2.125 04/23	XS1346695437	8 249	8 594
MOL 2.625 04/23	XS1401114811	5 363	5 452
EU STOXX50 ISHARES ETF	DE0005933956	31 310	27 364
EU STOXX50 DB-X ETF	LU0274211217	29 137	26 035
EU STOXX50 DEKA ETF	DE000ETFLO29	29 564	25 676
S&P 500 VANGUARD ETF	IE00B3XXRP09	11 257	13 055
EU STOXX50 AMUNDI ETF	FR0010654913	12 416	11 913
MSCI EM ISHARES ETF	US46434G1031	8 258	8 689
MSCI EM iShares ETF	IE00BKM4GZ66	6 531	6 225
S&P 500 SPDR ETF	IE00B5BMR087	4 021	4 773

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

Aktiva k 30. 6. 2016 (v tis. Kč)	
Pohledávky za bankami a družstevními záložnami	53 850
a) splatné na požádání	38 850
b) ostatní pohledávky	15 000
Dluhové cenné papíry	264 106
a) vydané vládními institucemi	99 208
b) vydané ostatními osobami	164 898
Akcie, podílové listy a ostatní podíly	139 168
Ostatní aktiva	424
CELKEM	457 548

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. 2014	83 594	1,0563
30. 6. 2015	233 979	1,0749
30. 6. 2016	436 212	1,0583

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 00 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	14 317	14 314
CZ GB L-10 11/27	CZ0001004105	2 674	2 646
TR GB 4.35 11/21	XS0993155398	3 035	3 053
ERSTE BANK L+40 07/17	XS0260783005	5 241	5 377
GAZ CAPITAL 8.146 04/18	XS0357281558	2 180	2 728
MBANK FIN 2.375 04/19	XS1050665386	2 142	2 080
PROVIDENT 8.0 10/19	XS0459028626	2 242	1 872
SB CAPITAL 3.3524 11/19	XS1082459568	2 667	2 919
NET4GAS 2.25 01/21	XS1090620730	3 176	3 288
NE Property 3.75 02/21	XS1325078308	2 692	2 855
IPF 5.75 04/21	XS1054714248	2 842	2 452
Black Sea T&D Bank 4.875 05/21	XS1405888576	5 002	5 173
ORLEN CAP 2.5 06/21	XS1082660744	2 744	2 786
SYNTHOS FIN 4.00 09/21	XS1115183359	2 709	2 733
ATRIUM 3.625 10/22	XS1118586244	2 907	3 010
ALSTRIA REIT 2.125 04/23	XS1346695437	2 734	2 865
MOL 2.625 04/23	XS1401114811	2 667	2 726
CESKE DRAHY 1.875 05/23	XS1415366720	2 705	2 736
EU STOXX50 DB-X ETF	LU0274211217	8 790	7 888
EU STOXX50 ISHARES ETF	DE0005933956	8 500	7 575
EU STOXX50 AMUNDI ETF	FR0010654913	5 992	5 721

Pokračování na další straně.

Název	ISIN	Požizovací cena (v tis. Kč)	Reálná cena (v tis. Kč)
MSCI EM iShares ETF	IE00BKM4GZ66	4 716	4 565
SPDR S&P 500 ETF	IE00B6YX5C33	3 529	3 924
NASDAQ BIOTECH ISHARES ETF	US4642875565	4 522	3 229
FTSE EM VANGUARD ETF	US9220428588	3 128	3 185
EU STOXX50 DEKA ETF	DE000ETFLO29	2 956	2 923
S&P 500 VANGUARD ETF	IE00B3XXRP09	1 891	2 418
MSCI EM ISHARES ETF	US46434G1031	2 047	2 198
S&P 500 SPDR ETF	IE00B5BMR087	1 719	2 148
ADIDAS	DE000A1EWWW0	1 140	2 096
ATRIUM EUROPEAN RE	JE00B3DCF752	2 125	2 093

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

Aktiva k 30. 6. 2016 (v tis. Kč)	
Pohledávky za bankami a družstevními záložnami	14 314
a) splatné na požádání	14 314
b) ostatní pohledávky	0
Dluhové cenné papíry	52 160
a) vydané vládními institucemi	11 733
b) vydané ostatními osobami	40 427
Akcie, podílové listy a ostatní podíly	97 964
Ostatní aktiva	312
CELKEM	164 750

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. 2014	29 286	1,0611
30. 6. 2015	83 090	1,0617
30. 6. 2016	157 914	1,0416

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 manažerů 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 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 00 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 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	1 156	1 156
Termínované vklady	TV	9 500	9 504

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

Aktiva k 30. 6. 2016 (v tis. Kč)	
Pohledávky za bankami a družstevními záložnami	10 660
a) splatné na požádání	1 156
b) ostatní pohledávky	9 504
Dluhové cenné papíry	0
a) vydané vládními institucemi	0
b) vydané ostatními osobami	0
Akcie, podílové listy a ostatní podíly	0
Ostatní aktiva	0
CELKEM	10 660

- 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. 2014	3 830	1,0045
30. 6. 2015	8 004	1,0054
30. 6. 2016	10 597	1,0111

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 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 00 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 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	36 394	36 394
Termínované vklady	TV	305 000	305 173

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

Aktiva k 30. 6. 2016 (v tis. Kč)	
Pohledávky za bankami a družstevními záložnami	341 567
a) splatné na požádání	36 394
b) ostatní pohledávky	305 173
Dluhové cenné papíry	0
a) vydané vládními institucemi	0
b) vydané ostatními osobami	0
Akcie, podílové listy a ostatní podíly	0
Ostatní aktiva	0
CELKEM	341 567

- 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. 2014	101 008	1,0201
30. 6. 2015	235 947	1,0252
30. 6. 2016	340 196	1,0278

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 manažerů 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 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 00 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 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	50 051	50 057
Termínované vklady	TV	419 000	419 219

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

Aktiva k 30. 6. 2016 (v tis. Kč)	
Pohledávky za bankami a družstevními záložnami	469 276
a) splatné na požádání	50 057
b) ostatní pohledávky	419 219
Dluhové cenné papíry	0
a) vydané vládními institucemi	0
b) vydané ostatními osobami	0
Akcie, podílové listy a ostatní podíly	0
Ostatní aktiva	114
CELKEM	469 390

- 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. 2014	119 365	1,0431
30. 6. 2015	317 449	1,0578
30. 6. 2016	466 676	1,0593

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 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 00 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 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	41 381	41 364
Termínované vklady	TV	451 000	451 230

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

Aktiva k 30. 6. 2016 (v tis. Kč)	
Pohledávky za bankami a družstevními záložnami	492 594
a) splatné na požádání	41 364
b) ostatní pohledávky	451 230
Dluhové cenné papíry	0
a) vydané vládními institucemi	0
b) vydané ostatními osobami	0
Akcie, podílové listy a ostatní podíly	0
Ostatní aktiva	187
CELKEM	492 781

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

Úplata určená penzijní společnosti 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. 2014	177 736	1,0583
30. 6. 2015	372 794	1,0787
30. 6. 2016	491 900	1,0775

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: pfcv@pfcv.cz, internet: www.pfcv.cz