

2015 metų sausio – gruodžio mėnesių ataskaita

SEB pensija 1 plus

2015 m. gruodžio 31 d.

Turinys

I. Bendroji informacija	2
II. Grynųjų aktyvų, apskaitos vienetų skaičius ir vertė	2
III. Atskaitymai iš pensijų turto	2
IV. Informacija apie pensijų fondo investicinių priemonių portfelį	3
V. Pensijų fondo lyginamasis indeksas, investicijų grąža ir rizikos rodikliai	3
VI. Pensijų fondo finansinė būklė	5
VII. Informacija apie pensijų fondo dalyvius	25
VIII. Išoriniai pinigų srautai	26
IX. Informacija apie garantijų rezervą	26
X. Informacija apie pensijų fondo reikmėms pasiskolintas lėšas	26
XI. Kita informacija	27
XII. Atsakingi asmenys	27

I. Bendroji informacija

1. Pensijų fondo pavadinimas, visas pensijų fondo taisyklių, pagal kurias jis veikia, pavadinimas, Komisijos pensijų fondo taisyklėms suteiktas numeris.

Papildomo savanoriško pensijų kaupimo pensijų fondas *SEB pensija 1 plus*, taisyklių Nr. PF-S01-K001-017(007).

2. Ataskaitinis laikotarpis, už kurį pateikta ataskaita – 2015 metų dvylika mėnesių

3. Duomenys apie valdymo įmonę:

3.1. pavadinimas ir įmonės kodas – UAB *SEB investicijų valdymas*, įmonės kodas 125277981;

3.2. buveinė (adresas) – J. Balčikonio g. 3, Vilnius, Lietuvos Respublika;

3.3. telefono, fakso numeriai, el. pašto adresas, interneto svetainės adresas

tel. (8 5) 268 1528

faks. (8 5) 268 1575

el. paštas info.invest@seb.lt

internetu adresas www.seb.lt;

3.4. veiklos licencijos numeris – VJK – 001;

3.5. pensijų fondo valdytojo vardas, pavardė, pareigos (asmuo ar asmenys, priimančys investicinius sprendimus) – Ignas Pliuškyš, Investicijų valdymo grupės vadovas.

4. Depozitoriumo pavadinimas, kodas, adresas, telefono ir fakso numeriai

AB SEB bankas

Gedimino pr. 12, LT-01103, Vilnius, Lietuva

faks. (8 5) 268 1255

įmonės kodas 112021238

II. Grynųjų aktyvų, apskaitos vienetų skaičius ir vertė

5. Nurodyti grynųjų aktyvų, apskaitos vienetų skaičių ir vertę.

(Žr. 22.3. punktas, 2 Pastaba)

6. Nurodyti per ataskaitinį laikotarpį konvertuotų apskaitos vienetų skaičių bei bendras konvertavimo sumas.

(Žr. 22.3. punktas, 3 Pastaba)

III. Atskaitymai iš pensijų turto

7. Atskaitymai iš papildomo savanoriško pensijų kaupimo fondo turto (jei per ataskaitinį laikotarpį keitėsi atskaitymų dydis, sumas pateikti atskirai pagal kiekvieną dydį):

(Žr. 22.3. punktas, 20 Pastaba)

8. Mokėjimai tarpininkams (nurodyti konkrečius tarpininkus ir jiems sumokėtas sumas, suteiktas paslaugas). Pažymėti, kurie tarpininkai susiję su fondo valdymo įmone.

(Žr. 22.3. punktas, 9 Pastaba)

9. Informacija apie visus susitarimus dėl mokėjimų pasidalijimo, taip pat apie paslėptuosius komisinius (jų teikėjas, vertė, suteiktų prekių ir (ar) paslaugų pobūdis ir kt.).

-

10. Pateikti konkretų pavyzdį, iliustruojantį atskaitymų įtaką galutinei dalyviui tenkančiai investicijų grąžai (pateikti tik metų atskaitoje). Pavyzdyje pateikti skaičiavimus, kiek būtų atskaityta (eurais) nuo pensijų fondo dalyvio įmokų esant dabartiniams atskaitymų dydžiu ir kokią sumą jis atgautų po 1, 3, 5, 10 metų, jei būtų investuota 3 000 Eur, o metinė investicijų grąža – 5 proc.

	Po 1 metų	Po 3 metų	Po 5 metų	Po 10 metų
Sumokėta atskaitymų, Eur	87,60	146,20	209,65	392,26
Sukauptą suma, jei nebūtų atskaitymų, Eur	3 150,00	3 472,88	3 828,84	4 886,68
Sukauptą suma, esant dabartiniams atskaitymų dydžiu, Eur	3 059,40	3 312,96	3 587,53	4 377,67

IV. Informacija apie pensijų fondo investicinių priemonių portfelį

11. Ataskaitinio laikotarpio pabaigos investicinių priemonių portfelio sudėtis:

(Žr. 22.3. punktas, 5 Pastaba)

12. Per ataskaitinį laikotarpį įvykdyti išvestinių finansinių priemonių sandoriai, išskyrus tuos, kurie nurodyti šio priedo 11 punkte (pagal išvestinių finansinių priemonių rūšis nurodyti sandorių vertės, išvestinių finansinių priemonių panaudojimo tikslus (valiutų keitimo, palūkanų normos, susiję su nuosavybe, ir kt.), taip pat sandorius reguliuojamose rinkose ir šalių tarpusavio sandorius bei kitą svarbią informaciją).

Priemonės pavadinimas	Priemonės rūšis	Pelnas/nuostolis valiuta	Valiutos kodas	Priemonės panaudojimo tikslas	Pastabos
CME USD/EUR CURRENCY FUTURE	Ateities sandoris (angl. future)	(18 759)	USD	Valiutų kursų svyravimo rizikos valdymas	Reguliuojamų rinkų IP
EURO BOBL FUTURE	Ateities sandoris (angl. future)	(716)	EUR	Palūkanų normų rizikos valdymas	Reguliuojamų rinkų IP
EURO SCHATZ FUTURE	Ateities sandoris (angl. future)	(372)	EUR	Palūkanų normų rizikos valdymas	Reguliuojamų rinkų IP

13. Aprašyti šio priedo 11 punkte nurodytų išvestinių finansinių priemonių rūšis, su jomis susijusią riziką, kiekybines ribas ir metodus, kuriais vertinama su išvestinių finansinių priemonių sandoriais susijusi pensijų fondo rizika, ir nurodyti, kaip investicinė finansinė priemonė gali apsaugoti investicinių priemonių sandorį (investicinių priemonių poziciją) nuo rizikos.

(Žr. 22.3. punktas, 8 Pastaba)

14. Pagal sandorius dėl išvestinių finansinių priemonių prisiimta rizikos apimtis ataskaitinio laikotarpio pabaigoje (atskirai nurodyti sumas pagal skirtingas įsigytų išvestinių finansinių priemonių kategorijas).

Prisiimtos rizikos apimtys skaičiavimui įmonė naudoja įsipareigojimų metodą (angl. commitment approach) ir perskaičiuoja (konvertuoja) kiekvieną išvestinių finansinių priemonių poziciją į tapačias pozicijas pagal šios investicinės finansinės priemonės bazinio turto rinkos vertę (standartinis įsipareigojimų metodas (angl. standard commitment approach)). Ataskaitinio laikotarpio pabaigoje prisiimtos rizikos nebuvo.

15. Pateikti analizę, kaip turimas investicinių priemonių portfelis atitinka (neatitinka) pensijų fondo investavimo strategiją (investicijų kryptis, investicijų specializaciją, geografinę zoną ir pan.).

Ataskaitiniu laikotarpiu fondo investicijų portfelis atitiko taisyklėse nustatytą investicijų strategiją.

16. Nurodyti veiksnus, per ataskaitinį laikotarpį turėjusius didžiausią įtaką investicinių priemonių portfelio struktūros ir jo vertės pokyčiams.

Ataskaitiniu laikotarpiu fondo investicijų portfelio vertės pokyčiams didžiausią įtaką turėjo:

- 1. Europos centrinio banko (ECB) vykdyta vyriausybės obligacijų supirkimo programa.** Kovo mėnesį ECB pradėta vykdyti programa sukūrė didelę paklausą vyriausybės obligacijoms, todėl jų kainos kilo, o pajamingumas toliau mažėjo. Tai turėjo teigiamą įtaką fondo vieneto vertei.
- 2. Stabili Lietuvos ekonominė ir politinė situacija toliau mažino šalies kredito riziką.** Dėl to mažėjo vyriausybės obligacijų pajamingumas ir kilo jų kaina. Tai turėjo teigiamą įtaką fondo vieneto vertei.
- 3. Skatinamoji didžiųjų centrinių bankų pinigų politika.** Europos, Japonijos ir Kinijos centrinių bankų skatinamoji pinigų politika kėlė investuotojų lūkesčius, tuo pačiu ir rizikingesnių investicijų, visų pirma, akcijų, kainas. Tai turėjo teigiamą įtaką fondo vieneto vertei.

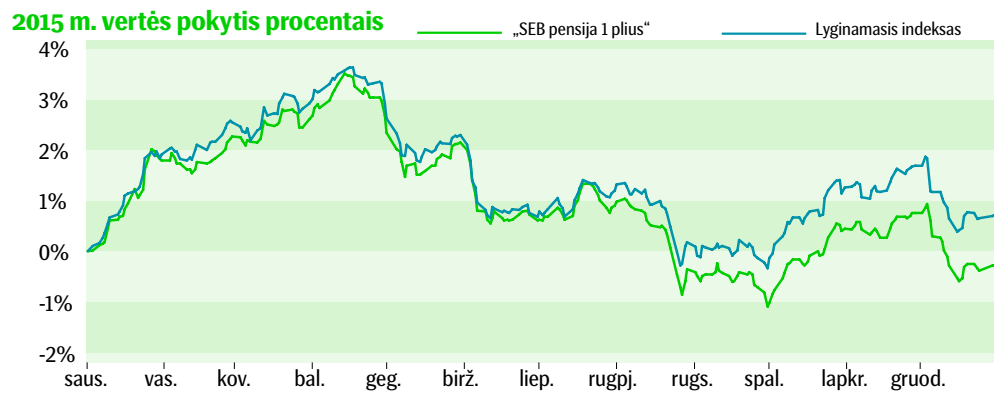
V. Pensijų fondo lyginamasis indeksas, investicijų grąža ir rizikos rodikliai

17. Pensijų fondo lyginamasis indeksas ir trumpas jo apibūdinimas (sudėtis, jei lyginamasis indeksas yra sudėtinis, kokias finansų rinkas, turto klases atspindi). Jeigu per ataskaitinį laikotarpį lyginamasis indeksas buvo pakeistas, turi būti pateikta informacija ir apie prieš tai galiojusį lyginamąjį indeksą, jo pakeitimo priežastis bei data, kada jis buvo pakeistas.

(Žr. 22.3. punktas, 19 Pastaba)

18. To paties laikotarpio pensijų fondo apskaitos vieneto vertės pokyčio, investicinių priemonių portfelio metinės investicijų grąžos ir lyginamojo indekso (jei jis pasirinktas) reikšmės pokyčio ir kiti rodikliai per paskutinius dešimt fondo veiklos metų išdėstyti palyginamojoje lentelėje. Jeigu fondas veikia trumpiau nei dešimt metų, pateikti to laikotarpio, kurį portfelis buvo valdomas, metinę investicijų grąžą. Prie palyginamosios lentelės pridėti joje pateiktų apskaitos vieneto vertės pokyčio ir lyginamojo indekso reikšmės pokyčio rodiklių diagramą ir rodiklių paaiškinimus.

(Žr. 22.3. punktas, 18 Pastaba)



19. Jei pensijų fondo reklamoje buvo naudojamos investicijų grąžos prognozės, nurodyti prognozuotą dydį, palyginti neatitikimus su faktine grąža ir pateikti galimas neatitikimų priežastis.

Reklamuojant šį pensijų fondą, nebuvo skelbiama tikėtina grąža.

20. Vidutinė investicijų grąža, vidutinis apskaitos vieneto vertės ir lyginamojo indekso reikšmės pokytis (jei jis pasirinktas) per paskutinius trejus, penkerius, dešimt metų (vidutinė grynoji investicijų grąža, vidutinis apskaitos vieneto vertės ir lyginamojo indekso reikšmės pokytis apskaičiuojami kaip geometrinis, atitinkamai, metinių grynosios investicijų grąžos, metinių apskaitos vieneto vertės pokyčių ir lyginamojo indekso reikšmės pokyčių vidurkis). Kiekvienam fondo tipui pildoma lentelė.

(Žr. 22.3. punktas, 18 Pastaba)

21. Kiti rodikliai, atskleidžiantys investicinių priemonių portfelio riziką. Atskleidžiant investicijų rizikos rodiklius, turi būti pateikiami jų paaiškinimai ir apskaičiavimo metodika.

-

VI. Pensijų fondo finansinė būklė

22. Pateikti šias pensijų fondo finansines ataskaitas, parengtas vadovaujantis Lietuvos Respublikos įstatymų ir teisės aktų reikalavimais:

22.1. grynujų aktyvų ataskaitą;

Grynujų aktyvų ataskaita (EUR)

2015 m. gruodžio 31 d.

Eil. nr.	Straipsniai	Pastabos Nr.	2015 12 31	2014 12 31
A.	TURTAS		5 754 707	5 188 831
I.	PINIGAI	5	502 920	36 688
II.	TERMINUOTIEJI INDĖLIAI		-	79 646
III.	PINIGŲ RINKOS PRIEMONĖS		-	-
III.1.	Valstybės išdo vekseliai		-	-
III.2.	Kitos pinigų rinkos priemonės		-	-
IV.	PERLEIDŽIAMIEJI VERTYBINIAI POPIERIAI	4, 5, 6	5 249 315	5 072 497
IV.1.	Ne nuosavybės vertybiniai popieriai		2 849 845	2 634 643
IV.1.1.	Vyriausybės ir centrinių bankų arba jų garantuoti ne nuosavybės vertybiniai popieriai		2 849 845	2 634 643
IV.1.2.	Kiti ne nuosavybės vertybiniai popieriai		-	-
IV.2.	Nuosavybės vertybiniai popieriai		-	-
IV.3.	Kitų kolektyvinio investavimo subjektų investiciniai vienetai ir akcijos		2 399 470	2 437 854
V.	SUMOKĖTI AVANSAI		-	-
VI.	GAUTINOS SUMOS	5, 8	2 302	-
VI.1.	Investicijų pardavimo sandorių gautinos sumos		-	-
VI.2.	Kitos gautinos sumos		2 302	-
VII.	INVESTICINIS IR KITAS TURTAS	5, 8	170	-
VII.1.	Investicinis turtas		-	-
VII.2.	Išvestinės finansinės priemonės		170	-
VII.3.	Kitas turtas		-	-
B.	ĮSIPAREIGOJIMAI	5, 8	19 798	13 992
I.	Mokėtinos sumos		19 501	11 726
I.1.	Už finansinį ir investicinį turtą mokėtinos sumos		-	-
I.2.	Valdymo įmonei ir depozitoriumui mokėtinos sumos	13	10 033	9 098
I.3.	Kitos mokėtinos sumos		9 468	2 628
II.	Sukauptos sąnaudos		-	-
III.	Finansinės skolos kredito įstaigoms		-	-
IV.	Įsipareigojimai pagal išvestinių finansinių priemonių sutartis	8	297	2 266
V.	Kiti įsipareigojimai		-	-
C.	GRYNIEJI AKTYVAI	2	5 734 909	5 174 839

7 – 25 puslapiuose pateiktas aiškinamasis raštas yra neatskiriama šių finansinių ataskaitų dalis.

22.2. grynųjų aktyvų pokyčių ataskaitą;

Grynųjų aktyvų pokyčių ataskaita (EUR)

2015 m. gruodžio 31 d.

Eil. nr.	Straipsniai	Pastabos Nr.	2015 01 01 - 2015 12 31	2014 01 01 - 2014 12 31
I.	GRYNŲJŲ AKTYVŲ VERTĖ ATASKAITINIO LAIKOTARPIO PRADŽIOJE		5 174 839	4 895 534
II.	GRYNŲJŲ AKTYVŲ VERTĖS PADIDĖJIMAS		1 052 590	981 505
II.1.	Dalyvių įmokos į fondą	3, 21	669 558	488 906
II.2.	Iš kitų fondų gautos sumos	3, 21	289 357	246 149
II.3.	Garantinės įmokos		-	-
II.4.	Investicinės pajamos		4	139
II.4.1.	Palūkanų pajamos		4	139
II.4.2.	Dividendai		-	-
II.4.3.	Nuomos pajamos		-	-
II.5.	Pelnas dėl investicijų vertės pasikeitimo ir pardavimo	4	78 074	242 409
II.6.	Pelnas dėl užsienio valiutos kursų pokyčio		8 551	2 811
II.7.	Išvestinių finansinių priemonių pelnas		2 139	-
II.8.	Kitas grynųjų aktyvų vertės padidėjimas		4 907	1 091
	PADIDĖJO IŠ VISO:		1 052 590	981 505
III.	GRYNŲJŲ AKTYVŲ VERTĖS SUMAŽĖJIMAS		492 520	702 200
III.1.	Išmokos fondo dalyviams	3, 21	269 255	510 043
III.2.	Išmokos kitiems fondams	3, 21	95 495	79 108
III.3.	Nuostoliai dėl investicijų vertės pasikeitimo ir pardavimo		59 948	38 074
III.4.	Nuostoliai dėl užsienio valiutos kursų pokyčio		6 700	6 306
III.5.	Išvestinių finansinių priemonių sandorių nuostoliai		-	2 555
III.6.	Valdymo sąnaudos:		61 122	66 114
III.6.1.	Atlyginimas valdymo įmonei	13, 20	52 831	58 380
III.6.2.	Atlyginimas depozitoriumui	13, 20	5 367	4 882
III.6.3.	Atlyginimas tarpininkams	9, 20	48	106
III.6.4.	Audito sąnaudos	20	2 745	2 628
III.6.5.	Palūkanų sąnaudos		-	-
III.6.6.	Kitos sąnaudos		131	118
III.7.	Kitas grynųjų aktyvų vertės sumažėjimas		-	-
III.8.	Sąnaudų kompensavimas (-)		-	-
	SUMAŽĖJO IŠ VISO:		492 520	702 200
IV.	Grynųjų aktyvų vertės pokytis		560 070	279 305
V.	Pelno paskirstymas		-	-
VI.	GRYNŲJŲ AKTYVŲ VERTĖ ATASKAITINIO LAIKOTARPIO PABAIGOJE	2	5 734 909	5 174 839

7– 25 puslapiuose pateiktas aiškinamasis raštas yra neatskiriama šių finansinių ataskaitų dalis.

Aiškinamasis raštas

Bendroji informacija

Papildomo savanoriško pensijų kaupimo fondo *SEB pensija 1 plus* taisyklės Nr. PF-S01-K001-017(001) patvirtino Lietuvos Respublikos vertybinių popierių komisija 2004 m. spalio 21 d. (paskutiniai pakeitimai įsigaliojo – 2013 m. gegužės 17 d.). 2006 m. vasario 9 d. pensijų fondo pavadinimas pakeistas į *SEB pensija 1 plus*.

Pensijų fondą *SEB pensija 1 plus* (toliau - Fondas) valdo UAB *SEB investicijų valdymas* (toliau - Bendrovė), įsteigta ir įregistruota 2000 m. gegužės mėn. 3 d., įmonės kodas 125277981. 2003 m. rugpjūčio mėn. 28 d. Lietuvos Respublikos vertybinių popierių komisijos sprendimu Bendrovei išduota valdymo įmonės, veikiančios pagal LR Kolektyvinio investavimo subjektų įstatymą, veiklos licencija Nr. VJK – 001. Duomenys apie Bendrovę kaupiami juridinių asmenų registre.

Pensijų fondo *SEB pensija 1 plus* depozitoriumas yra AB SEB bankas, įmonės kodas 112021238, esantis adresu Gedimino pr. 12, Vilnius, veikiantis pagal Lietuvos banko išduotą licenciją Nr. 2.

Fondo auditą atlieka UAB *PricewaterhouseCoopers*, įmonės kodas 111473315, buveinės adresas J.Jasinskio g. 16B, LT-03163 Vilnius, veikianti pagal 2005 m. gruodžio 20 d. Lietuvos auditorių rūmų pažymėjimą Nr.001273.

Apskaitos principai

Finansinės ataskaitos parengtos vadovaujantis Verslo apskaitos standartais, bei kitais Lietuvos Respublikoje finansinę apskaitą reglamentuojančiais teisės aktais.

Fondas pirmąsias įmokas ir pajamas gavo 2004 m. birželio 15 d.

Finansinės ataskaitos parengtos remiantis veiklos tęstinumo principu ir prielaida, kad Fondas artimiausioje ateityje galės tęsti savo veiklą.

Fondo apskaita tvarkoma atskirai nuo Bendrovės ir kitų jos valdomų pensijų fondų apskaitos pagal patvirtintą sąskaitų planą.

Finansiniai Fondo metai sutampa su kalendoriniais metais.

Sumos šiose finansinėse ataskaitose pateiktos Lietuvos Respublikos nacionaline valiuta – Eurais (Eur). 2015 m. sausio 1 d. Lietuva prisijungė prie euro zonos ir jos valiuta tapo euras. Litai buvo pakeisti į eurus santykiu 3,4528 lito už 1 eurą. Bendrovė perskaičiavo palyginamuosius skaičius iš litų į eurus taikydama oficialų lito ir euro kursą: 1 euras = 3,4528 Lt. Joks pelnas (nuostolis) dėl valiutų perskaičiavimo pripažintas nebuvo.

Toliau – yra išdėstyti svarbiausi apskaitos principai, kuriais buvo vadovautasi rengiant šias finansines ataskaitas:

(a) Finansinės rizikos valdymo politika

Su Fondo investicijomis yra susijusi ši rizika:

1. palūkanų normų rizika. Investavimo objektai, kaip ir daugelis skolos VP, susiję su rizika, kad VP vertė gali sumažėti ar padidėti dėl pasikeitusių palūkanų normų, t. y. investicijų vertė mažėja didėjant palūkanų normoms, ir atvirkščiai, investicijų vertė didėja, kai palūkanų normos mažėja. Valdydama šią riziką, bendrovė gali naudoti išvestines finansines priemones ir keisti vidutinę fondo obligacijų finansinę trukmę;
2. rinkų ir kredito rizika. Nors konkretūs VP gali suteikti galimybę gauti didesnę investicijų grąžą negu visa rinka ar susijęs rinkos segmentas, visos rinkos vertė gali sumažėti ar padidėti dėl besikeičiančių palūkanų normų, naujo priežiūros institucijų nustatyto reglamentavimo, pasikeitusių ekonomikos sąlygų. VP kreditingumo kokybė priklauso nuo emitento sugebėjimo laiku mokėti palūkanas ir suėjus terminui išpirkti emisiją. Kuo mažesnis emitentui suteiktas kredito reitingas, tuo didesnė rizika, kad emitentas neįvykdys savo įsipareigojimų fondo dalyviams. VP kreditingumo rizika taip pat priklauso ir nuo banko, laiduojančio už konkrečią skolą VP, finansinio pajėgumo. Valdydama šią riziką, bendrovė gali naudoti išvestines finansines priemones, kurių vertė kinta kartu su emitento kreditingumo kokybe;
3. VP pasirinkimo rizika. Nuo fondo turtas investuojamas į fiksuoto pajamingumo VP, kurių vertė paprastai kinta nedaug, išlieka rizika, kad įsigytų VP kaina gali skirtis nuo prognozuotos kainos. Bendrovė valdo VP pasirinkimo riziką laikydamasi nustatytų fondo investicijų portfelio diversifikavimo reikalavimų;
4. valiutų kursų svyravimų rizika. Jei investuojama į VP užsienio valiuta, tai, keičiantis valiutos, kuria investuota, kursui euro atžvilgiu, kinta ir investicijų vertė. Bendrovė, valdydama valiutų kursų svyravimo riziką, turi teisę naudoti išvestines finansines priemones;
5. infliacijos / perkamosios galios rizika. Infliacijos tempams spartėjant, skolos VP atkarpų ir pagrindinės sumos perkamoji vertė ir kaina paprastai mažėja. Bendrovė gali valdyti šią riziką naudodama išvestines finansines priemones, kurių vertė kinta kartu su infliacijos augimo pokyčiu, gali investuoti į obligacijas, kurių vertė yra susijusi su infliacijos tempais ir keisti vidutinę fondo obligacijų finansinę trukmę.

Fondo investicijos nėra garantuojamos Indėlių draudimo fondo ar kitos valstybinės garantijų ar draudimo agentūros. Nors bendrovė, taikydama rizikos valdymo priemones, sieks išvengti didelio fondo grynųjų aktyvų ir apskaitos vieneto vertės svyravimo, dalyviams išlieka laikino sąskaitose kaupiamo turto dalinio sumažėjimo rizika.

(b) Turto padidėjimo ir sumažėjimo traukimo į apskaitą principai

Į pinigų ir pinigų ekvivalentų sąskaitą traukiama banko sąskaitoje padidėjusi pinigų suma ar įsigyjamų pinigų ekvivalentų vertė. Atitinkamai traukiama į apskaitą šios sąskaitos sumažėjusi vertė.

Vertybinių popierių padidėjusi vertės dalis traukiama į apskaitą, kai įsigyjami vertybiniai popieriai, jei sumokėta iš anksto, į apskaitą traukiama avansu sumokėta padidėjusi vertės dalis. Vėliau vertės padidėjusi dalis traukiama į apskaitą, kai padidėja vertybinių popierių vertė. Atitinkamai vertybinių popierių sumažėjusi vertės dalis traukiama į apskaitą juos pardavus, emitentui išpirkus vertybinius popierius, sumažėjus vertybinių popierių vertei. Vertybinių popierių įtraukimo į apskaitą (arba apskaitos nutraukimo) diena yra perkamo turto gavimo (arba parduodamo turto perleidimo) diena.

Išvestinės finansinės priemonės grynųjų aktyvų ataskaitoje parodomos kaip turtas, jeigu tikroji vertė yra teigiama, arba kaip įsipareigojimas, jeigu tikroji vertė neigiama. Išvestinių finansinių priemonių vertės padidėjusi dalis yra traukiama į išvestinių finansinių priemonių pelną, o vertės sumažėjusi dalis į išvestinių finansinių priemonių sandorių nuostolius.

(c) Grynųjų aktyvų vertės ir vienetų vertės apskaičiavimo principai

Apskaičiuojant fondo grynųjų aktyvų (toliau – GA) vertę, atskirai apskaičiuojama fondo turto vertė ir įsipareigojimų vertė.

Apskaičiuoto turto ir apskaičiuotos įsipareigojimų vertės skirtumas lygus grynųjų aktyvų vertei.

Turto ir įsipareigojimų tikroji vertė lygi grynųjų aktyvų vertei, už kurią labiausiai tikėtina šiuos aktyvus parduoti.

Apskaičiuojant grynųjų aktyvų užsienio valiuta vertę, turto ir įsipareigojimų vertė nustatoma pagal Lietuvos banko nustatytą oficialų tos valiutos ir euro kursą, galiojantį vertinimo dieną.

Turto ar įsipareigojimų tikroji vertė nustatoma kiekvieną darbo dieną laikantis šių patikimumo lygių:

1. Tikroji vertė turi būti nustatoma pagal aktyviojoje rinkoje skelbiamas to turto ar įsipareigojimo kainas.
2. Jeigu aktyviojoje rinkoje to turto ar įsipareigojimo kainos neskelbiamos, tikroji vertė nustatoma pagal šioje ar kitoje rinkoje skelbiamas panašaus turto kainas ar kitus aktyviosios rinkos rodiklius arba apskaičiuojama remiantis šiais rodikliais.
3. Jeigu tikrosios vertės neįmanoma patikimai nustatyti pagal aukščiau išvardintus punktus, rinkose neprekiuojamo turto ar įsipareigojimo tikroji vertė nustatoma pagal kitokius ekonominius rodiklius ar informaciją.

Fondo turto ir įsipareigojimų vertės pasikeitimas pripažįstamas grynųjų aktyvų padidėjimu ar sumažėjimu ir parodomas grynųjų aktyvų pokyčio ataskaitoje.

Fondo apskaitos vienetai išreiškia dalyviui priklausančią turto dalį fonde.

Apskaitos vienetai skaidomi į dalis iki keturių skaičių po kablelio tikslumu, kuris apvalinamas pagal matematinės apvalinimo taisykles.

Apskaitos vieneto (jo dalių) vertė nustatoma keturių skaičių po kablelio tikslumu ir apvalinama pagal matematinės apvalinimo taisykles.

Apskaitos vieneto (jo dalių) vertė išreiškiama Lietuvos Respublikos valiuta. Jeigu Lietuvos Respublika įsiveda kitą oficialią valiutą, fondo apskaitos vienetai konvertuojami į naują valiutą be papildomų mokesčių pagal oficialų (Lietuvos banko) keitimo kursą.

Bendra visų fondo apskaitos vienetų vertė visada yra lygi fondo GA vertei.

Pradinė fondo vieneto vertė - 0,29 Eur (dvidešimt devyni euro centai).

Fondo vieneto vertė nustatoma padalijus fondo GA vertę, nustatytą apskaičiavimo dieną, iš bendro fondo vienetų skaičiaus.

Nustačius klaidą, apskaičiuojama esamiems ir buvusiems dalyviams permokėta ar išmokėta per mažą suma. Buvusiems dalyviams kompensuojamų nuostolių, susidariusių dėl klaidos, suma registruojama subjekto įsipareigojimuose.

(d) Pinigų ekvivalentai

Pinigų ekvivalentams priskiriamos trumpalaikės (iki trijų mėnesių) likvidžios investicijos, kurios gali būti greitai iškeičiamos į pinigų sumas ir kurių vertės pasikeitimo rizika yra nereikšminga.

(e) Finansinis turtas

Finansinis turtas apima pinigus ir pinigų ekvivalentus, gautinas sumas bei vertybinius popierius.

Finansinis turtas apskaitoje registruojamas tada, kai Bendrovė gauna arba pagal sutartį įgyja teisę gauti pinigus ar kitą finansinį turtą.

Gautinos sumos vertinamos įsigijimo savikaina, atėmus nuostolį dėl nuvertėjimo. Pinigai ir pinigų ekvivalentai vertinami įsigijimo savikaina. Vertybiniai popieriai į apskaitą traukiami įsigijimo savikaina, vėliau - tikrąja verte.

(f) Finansiniai įsipareigojimai

Finansiniai įsipareigojimai apima mokėtinas sumas už gautas paslaugas bei įsipareigojimus kredito įstaigoms.

Finansiniai įsipareigojimai apskaitoje registruojami tada, kai Fondas prisiima įsipareigojimą sumokėti pinigus ar atsiskaityti kitu finansiniu turtu.

Mokėtinos sumos už paslaugas vertinamos įsigijimo savikaina. Įsipareigojimai kredito įstaigoms pradinio pripažinimo metu vertinami įsigijimo savikaina, o vėliau - amortizuota savikaina.

(g) Išvestinės finansinės priemonės

Iš išvestinės finansinės priemonės atsirandantis finansinis turtas ir finansiniai įsipareigojimai registruojami apskaitoje, kai pagal sutartį įgyjama teisė gauti turtą arba prievolę vykdyti įsipareigojimą.

Iš išvestinės finansinės priemonės atsirandantis finansinis turtas ir finansinis įsipareigojimas pirmą kartą apskaitoje registruojamas įsigijimo savikaina, vėliau - tikrąja verte.

Kita informacija

Informacija apie investavimo, finansinės rizikos valdymo politiką, investicijų portfelio struktūrą ir atskaitymų valdymo įmonei ir depozitoriumui taisyklės pateikiamos www.seb.lt.

1 Pastaba. Reikšmingos finansinių ataskaitų sumos ir jų pasikeitimo priežastys.

Reikšmingų pokyčių finansinių ataskaitų sumose nebuvo.

2 Pastaba. Gryųjų aktyvų vertė, vienetų skaičius ir vertė ataskaitinio laikotarpio pradžioje ir pabaigoje, prieš metus, prieš dvejus metus. Kai vienetai yra skirtingų klasių, duomenys pateikiami pagal klases.

	Ataskaitinio laikotarpio pradžioje (2015 01 02)	Ataskaitinio laikotarpio pabaigoje (2015 12 31)	Prieš metus (2014 12 31)	Prieš dvejus metus (2013 12 31)
Gryųjų aktyvų vertė, Eur	5 175 938	5 734 909	5 174 839	4 895 534
Apskaitos vieneto vertė, Eur	0,3959	0,3945	0,3958	0,3843
Apskaitos vienetų skaičius	13 075 015	14 536 573	13 074 836	12 737 685

3 Pastaba. Per ataskaitinį laikotarpį išplatintų (konvertuojant pinigus į vienetus) ir išpirktų (konvertuojant vienetus į pinigus) vienetų skaičius ir vertė.

2015 m. gruodžio 31 d.

	Apskaitos vienetų skaičius	Vertė, Eur
Apskaitos vienetų skaičius (konvertuojant pinigines lėšas į apskaitos vienetus)*	2 377 016	958 915
Apskaitos vienetų skaičius (konvertuojant apskaitos vienetus į pinigines lėšas)	915 279	364 750
Skirtumas	1 461 737	594 165

2014 m. gruodžio 31 d.

	Apskaitos vienetų skaičius	Vertė, Eur
Apskaitos vienetų skaičius (konvertuojant pinigines lėšas į apskaitos vienetus)*	1 842 863	735 054
Apskaitos vienetų skaičius (konvertuojant apskaitos vienetus į pinigines lėšas)	1 505 712	589 152
Skirtumas	337 152	145 903

*Apskaitos vienetų skaičiaus (konvertuojant pinigines lėšas į apskaitos vienetus) vertė pateikta kartu su įmokes mokesčiu.

4 Pastaba. Investicijų vertės pokytis per ataskaitinį laikotarpį dėl jų įsigijimo, pardavimo ar išpirkimo ir tikrosios vertės pasikeitimo.

2015 m. gruodžio 31 d.

Investicijos	Pokytis					
	praėjusio ataskaitinio laikotarpio pabaigoje	įsigyta	parduota (išpirkta)	teigiamas vertės pokytis	neigiamas vertės pokytis	ataskaitinio laikotarpio pabaigoje
Vyriausybių ir centrinių bankų arba jų garantuoti ne nuosavybės vertybiniai popieriai	2 634 643	848 529	(686 285)	54 504	(1 546)	2 849 845
Kitų kolektyvinio investavimo subjektų investiciniai vienetai ir akcijos	2 437 854	248 136	(251 688)	23 570	(58 402)	2 399 470
Iš viso:	5 072 497	1 096 665	(937 973)	78 074	(59 948)	5 249 315

2014 m. gruodžio 31 d.

Investicijos	Pokytis					
	praėjusio ataskaitinio laikotarpio pabaigoje	įsigyta	parduota (išpirkta)	teigiamas vertės pokytis	neigiamas vertės pokytis	ataskaitinio laikotarpio pabaigoje
Vyriausybių ir centrinių bankų arba jų garantuoti ne nuosavybės vertybiniai popieriai	4 163 074	440 146	(2 141 147)	175 474	(2 904)	2 634 643
Kitų kolektyvinio investavimo subjektų investiciniai vienetai ir akcijos	457 501	1 959 376	(10 788)	66 935	(35 170)	2 437 854
Iš viso:	4 620 575	2 399 522	(2 151 935)	242 409	(38 074)	5 072 497

5 Pastaba. Investicijų portfelio struktūra. Parodomas investicijų pasiskirstymas pagal investavimo strategiją atitinkančius kriterijus nurodant, kokią subjekto grynųjų aktyvų vertės dalį (procentais) sudaro investicijos. Atskleidžiami įvykiai, turėję reikšmingos įtakos investicijų portfeliui.

2015 m. gruodžio 31 d.

Ko- das	Emitento (KIS, kredito įstaigos, banko pavadi- nimas)	Šalis	ISIN kodas / Priemonės pavadinimas	Valiuta	Kiekis, vnt.	Valdytojas	Bendra nominali vertė, Eur	Investicinis sandoris (pozicija)	Sandorio (pozi- cijos) vertė	Kita sandorio šalis	Bendra įsigijimo vertė, Eur	Bendra rinkos vertė, Eur	Palūkanų norma, %	Rinka (šaltinis), pa- gal kurios duome- nis nustatyta rinkos vertė (tinklalapio adresas)	KIS ti- pas	Išpirkimo / konverta- vimo data / terminas	Dalis GA / dalis port- felyje, %
1	Akcijos																
1.1	Nuosavybės vertybiniai popieriai, įtraukti į Oficialųjį ar į atitinkantį prekybos sąrašą																
	Iš viso:																
1.2	Nuosavybės vertybiniai popieriai, įtraukti į Papildomąjį ar į atitinkantį prekybos sąrašą																
	Iš viso:																
1.3	Nuosavybės vertybiniai popieriai, kuriais prekiaujama kitose reguliuojamose rinkose																
	Iš viso:																
1.4	Išleidžiami nauji nuosavybės vertybiniai popieriai																
	Iš viso:																
	Iš viso Akcijos:																
2	Obligacijos																
2.1	Ne nuosavybės vertybiniai popieriai, įtraukti į Oficialųjį ar į atitinkantį prekybos sąrašą																
	Iš viso:																
2.2	Ne nuosavybės vertybiniai popieriai, įtraukti į Papildomąjį ar į atitinkantį prekybos sąrašą																
	Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT1000607010	EUR	510		51 000				53 090	54 756	0,89			2021.08.28	0,95
	Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT0000611014	EUR	19 471 154		194 712				197 677	201 933	0,00			2016.02.10	3,52
	Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT0000605115	EUR	2 896 200		28 962				31 844	30 315	0,09			2016.10.20	0,53
	Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT0000607053	EUR	11 819 393		118 194				127 054	136 008	0,20			2018.03.28	2,37
	Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT0000603250	EUR	17 107 854		171 079				170 830	174 292	0,01			2016.02.01	3,04
	Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT0000610057	EUR	1 940 454		19 405				24 412	25 461	0,98			2022.05.17	0,44

Ko- das	Emiteuto (KIS, kredito jstajigos, banko pavadi- nimas)	Šalis	ISIN kodas / Priemonės pavadinimas	Valiuta	Kiekis, vnt.	Valdytojas	Bendra nominali vertė, Eur	Investicinis sandoris (pozicija)	San- dorio (pozi- cijos) vertė	Kita sandorio šalis	Bendra įsigijimo vertė, Eur	Bendra rinkos vertė, Eur	Palūkanų norma, %	Rinka (šaltinis), pa- gal kurios duome- nis nustatyta rinkos vertė (tinklalapio adresas)	KIS ti- pas	Išpirkimo / konverta- vimo data / terminas	Dalis GA / dalis port- felyje, %
	Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT0000607061	EUR	18 795 783		187 958				213 711	212 017	0,48			2019.10.25	3,70
	Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT0000605123	EUR	13 756 951		137 570				149 928	150 171	0,13			2017.06.07	2,62
	Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT0000605149	EUR	27 149 235		271 492				286 254	290 205	0,30			2018.10.31	5,06
	Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT0000603276	EUR	1 401 761		14 018				13 993	14 420	0,10			2017.02.27	0,25
	Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT0000605131	EUR	15 205 051		152 051				159 413	159 537	0,15			2017.08.31	2,78
	Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT0000650012	EUR	1 300		130 000				130 080	130 759	0,66			2020.05.27	2,28
	Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT0000630022	EUR	500		50 000				50 517	50 447	0,37			2019.03.30	0,88
	Iš viso:				129 546 146		1 526 438				1 608 803	1 630 321					28,43
2.3	Ne nuosavybės vertybiniai popieriai, kuriais prekiaujama kitose reguliuojamose rinkose																
	Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	XS0327304001	EUR	30		30 000				32 385	34 386	(0,06)			2018.02.07	0,60
	Prancūzijos Respublika	FR	FR0000187361	EUR	100		100 000				113 177	105 278	(0,39)			2016.10.25	1,84
	Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	XS0485991417	USD	20		18 305				14 264	22 232	2,56			2020.02.11	0,39
	Belgijos Karalystė	BE	BE0000315243	EUR	110		110 000				114 201	128 374	(0,21)			2019.03.28	2,24
	Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	XS0541528682	USD	152		139 118				117 706	150 437	1,16			2017.09.14	2,62
	Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	XS0739988086	USD	40		36 610				30 107	44 819	3,05			2022.02.01	0,78
	Vokietijos Federacine Respublika	DE	DE0001135358	EUR	55		55 000				66 140	62 462	(0,32)			2018.07.04	1,09
	Nyderlandų Karalystė	NL	NL0010060257	EUR	50		50 000				52 337	56 948	0,26			2022.07.15	0,99
	Prancūzijos Respublika	FR	FR0010604983	EUR	75		75 000				87 512	84 467	(0,27)			2018.04.25	1,47
	Vokietijos Federacine Respublika	DE	DE0001135499	EUR	10		10 000				10 770	10 934	0,16			2022.09.04	0,19
	Vokietijos Federacine Respublika	DE	DE0001135457	EUR	30		30 000				31 769	33 967	0,04			2021.09.04	0,59
	Austrijos Respublika	AT	AT0000A0N9A0	EUR	90		90 000				101 461	111 472	(0,20)			2022.04.20	1,94
	Nyderlandų Karalystė	NL	NL0006227316	EUR	25		25 000				28 533	28 179	(0,28)			2018.07.15	0,49
	Latvijos Respublika	LV	LV0000570125	EUR	190		190 000				204 353	200 526	0,48			2019.11.21	3,50
	Prancūzijos Respublika	FR	FR0012517027	EUR	150		150 000				142 929	145 043	0,90			2025.05.25	2,53
	Iš viso:				1 127		1 109 033				1 147 644	1 219 524					21,26

Ko- das	Emیتento (KIS, kredito įstaigos, banko pavadi- nimais)	Šalis	ISIN kodas / Priemonės pavadinimas	Valiuta	Kiekis, vnt.	Valdytojas	Bendra nominali vertė, Eur	Investicinis sandoris (pozicija)	San- dorio (pozi- cijos) vertė	Kita sandorio šalis	Bendra įsigijimo vertė, Eur	Bendra rinkos vertė, Eur	Palūkanų norma, %	Rinka (šaltinis), pa- gal kurios duome- nis nustatyta rinkos vertė (tinklalapio adresas)	KIS ti- pas	Išpirkimo / konverta- vimo data / terminas	Dalis GA / dalis port- felyje, %
2.4	Išleidžiami nauji ne nuosavybės vertybiniai popieriai																
Iš viso:																	
Iš viso Obligacijos:					129 547 273		2 635 471				2 756 447	2 849 845					49,69
3 KIS																	
3.1	Kolektyvinių investa- vimo subjektų, atitinkančių Kolektyvinių investavimo subjektų 61 str. 1d. reikalavi- mus, vienetai (akcijos)																
	SEB Eastern Europe Bond Fund	EE	EE3600087532	EUR	20 758	AS SEB Varahaldus					268 000	251 406		IS Bloomberg	KIS 1		4,38
	M&G Global Dividend EUR C	GB	GB00B39R2T55	EUR	5 015	M&G Securities					102 435	106 168		IS Bloomberg	KIS 3		1,85
	JOHCM Global Select B EUR	IE	IE00B3DBRM10	EUR	39 411	J O Hambro Capital Ma- nagement Limited					82 505	86 822		IS Bloomberg	KIS 3		1,51
	PIMCO GIS Global High Yield Bond Fund EUR (Hdg) A	IE	IE00B2R34Y72	EUR	13 409	PIMCO Glo- bal Advisors (Ireland) Limited					266 936	260 268		IS Bloomberg	KIS 1		4,54
	PIMCO GIS Global Investment Grade Credit Fund Inst	IE	IE0032876397	EUR	40 658	PIMCO Glo- bal Advisors (Ireland) Limited					669 342	697 684		IS Bloomberg	KIS 1		12,17
	GS Global Credit Portfolio (Hedged) I	LU	LU0234688595	EUR	47 394	Goldman Sachs Asset Manage- ment					634 246	653 086		IS Bloomberg	KIS 1		11,39
	SEB Fund 1 - SEB Global Fund EUR	LU	LU0957649758	EUR	754	SEB Asset Manage- ment SA					91 000	102 634		IS Bloomberg	KIS 3		1,79
	JPMorgan Funds - Emerging Markets Local Currency D	LU	LU0332400828	USD	21 322	JPMorgan Asset Ma- nagement Europe SAR					256 096	241 402		IS Bloomberg	KIS 1		4,21
Iš viso:					188 721						2 370 560	2 399 470					41,84
3.2	Kitų kolektyvinių investavimo subjektų vienetai																
Iš viso:																	
Iš viso KIS:					188 721						2 370 560	2 399 470					41,84
4 Pinigų rinkos priemonės																	

Ko- das	Emیتento (KIS, kredito įstaigos, banko pavadi- nimas)	Šalis	ISIN kodas / Priemonės pavadinimas	Valiuta	Kiekis, vnt.	Valdytojas	Bendra nominali vertė, Eur	Investicinis sandoris (pozicija)	San- dorio (pozi- cijos) vertė	Kita sandorio šalis	Bendra įsigijimo vertė, Eur	Bendra rinkos vertė, Eur	Palūkanų norma, %	Rinka (šaltinis), pa- gal kurios duome- nis nustatyta rinkos vertė (tinklalapio adresas)	KIS ti- pas	Išpirkimo / konverta- vimo data / terminas	Dalis GA / dalis port- felyje, %
4.1	Pinigų rinkos priemonės, kuriomis prekiaujama reguliu- ojamose rinkose																
Iš viso:																	
4.2	Kitos pinigų rinkos priemonės																
Iš viso:																	
Iš viso Pinigų rinkos priemonės:																	
5 Indėliai kredito įstaigose																	
Iš viso:																	
Iš viso Indėliai kredito įstaigose:																	
6 Išvestinės investicinės priemonės																	
6.1	Išvestinės investicinės priemonės, kuriomis prekiau- jama reguliuojamose rinkose																
	EURO SCHATZ FUTURE	CH	DUH6	EUR			FR0000187361, FR0010604983, DE0001135358, AT0000A0N9A0, NL0006227316	(223 020)		EUREX		(80)		SEB Futures atas- kaita, IS Bloomberg		2016.03.08	(0,00)
	CME USD/EUR CURRENCY FUTURE	US	ECH6	USD			XS0541528682, XS0485991417, XS0739988086	125 229		Chicago Mercantile Exchange		(217)		IS Bloomberg (t-1) dienes 15 val.		2016.03.14	(0,00)
	EURO BOBL FUTURE	CH	OEH6	EUR			DE0001135499, DE0001135457, BE0000315243, NL0010060257	(130 670)		EUREX		170		SEB Futures atas- kaita, IS Bloomberg		2016.03.08	0,00
Iš viso:												(127)			(0,00)		
6.2	Kitos išvestinės investicinės priemonės																
Iš viso:																	
Iš viso Išvestinės investicinės priemonės:												(127)			(0,00)		
7 Pinigai																	
	AB SEB bankas	LT		EUR								487 858					8,51
	SEB LONDON	GB		EUR								3 721					0,06
	AB SEB bankas	LT		USD								3 259	0,0927				0,06
	SEB LONDON	GB		USD								8 082					0,14
Iš viso:												502 920			8,77		
Iš viso Pinigai:												502 920			8,77		

Ko- das	Emitento (KIS, kredito įstaigos, banko pavadi- nimas)	Šalis	ISIN kodas / Priemonės pavadinimas	Valiuta	Kiekis, vnt.	Valdytojas	Bendra nominali vertė, Eur	Investicinis sandoris (pozicija)	San- dorio (pozi- cijos) vertė	Kita sandorio šalis	Bendra įsigijimo vertė, Eur	Bendra rinkos vertė, Eur	Palūkanų norma, %	Rinka (šaltinis), pa- gal kurios duome- nis nustatyta rinkos vertė (tinklalapio adresas)	KIS ti- pas	Išpirkimo / konverta- vimo data / terminas	Dalis GA / dalis port- felyje, %		
8	Kitos priemonės, nenumatytos Kolektyvinio investavimo subjektų įstatymo 57 str. 1 d.																		
	Gautinos sumos											2 302						0,04	
	Mokėtinos sumos											(19 501)							(0,34)
	Iš viso:											(17 199)							(0,30)
	Iš viso Kitos priemonės, nenumatytos Kolektyvinio investavimo subjektų įstatymo 57 str. 1 d.:																		
9	IŠ VISO:											5 734 909							100,00

2014 m. gruodžio 31 d.

Ko- das	Emitento (KIS, kredito įstaigos, banko pavadi- nimas)	Šalis	ISIN kodas / Priemonės pavadinimas	Valiuta	Kiekis, vnt.	Valdytojas	Bendra nominali vertė, Eur	Investicinis sandoris (pozicija)	San- dorio (pozi- cijos) vertė	Kita sandorio šalis	Bendra įsigijimo vertė, Eur	Bendra rinkos vertė, Eur	Palūkanų norma, %	Rinka (šaltinis), pa- gal kurios duome- nis nustatyta rinkos vertė (tinklalapio adresas)	KIS ti- pas	Išpirkimo / konverta- vimo data / terminas	Dalis GA / dalis port- felyje, %
1	Akcijos																
1.1	Nuosavybės vertybiniai popieriai, įtraukti į Oficialųjį ar jį atitinkantį prekybos sąrašą																
	Iš viso:																
1.2	Nuosavybės vertybiniai popieriai, įtraukti į Papildomąjį ar jį atitinkantį prekybos sąrašą																
	Iš viso:																
1.3	Nuosavybės vertybiniai popieriai, kuriais prekiaujama kitose reguliuojamose rinkose																
	Iš viso:																
1.4	Išleidžiami nauji nuosavybės vertybiniai popieriai																
	Iš viso:																
	Iš viso Akcijos:																
2	Obligacijos																
2.1	Ne nuosavybės vertybiniai popieriai, įtraukti į Oficialųjį ar jį atitinkantį prekybos sąrašą																
	Iš viso:																
2.2	Ne nuosavybės vertybiniai popieriai, įtraukti į Papildomąjį ar jį atitinkantį prekybos sąrašą																

Ko- das	Emīto (KIS, kredito įstaigos, banko pavadi- nimas)	Šalis	ISIN kodas / Priemonės pavadinimas	Valiuta	Kiekis, vnt.	Valdytojas	Bendra nominali vertė, Eur	Investicinis sandoris (pozicija)	San- dorio (pozi- cijos) vertė	Kita sandorio šalis	Bendra įsigijimo vertė, Eur	Bendra rinkos vertė, Eur	Palūkanų norma, %	Rinka (šaltinis), pa- gal kurios duome- nis nustatyta rinkos vertė (tinklalapio adresas)	KIS ti- pas	Išpirkimo / konverta- vimo data / terminas	Dalis GA / dalis port- felyje, %
	Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT0000603250	LTL	5 907		171 079				170 830	177 060	0,28			2016.01.31	3,42
	Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT0000603276	LTL	484		14 018				13 993	14 472	0,58			2017.02.27	0,28
	Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT0000605107	LTL	10 201		295 441				311 534	309 766	0,15			2015.04.29	5,99
	Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT0000605115	LTL	1 000		28 962				31 844	31 465	0,50			2016.10.20	0,61
	Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT0000605123	LTL	4 750		137 570				149 928	154 637	0,65			2017.06.07	2,99
	Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT0000605131	LTL	5 250		152 051				159 413	161 076	0,68			2017.08.31	3,11
	Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT0000605149	LTL	4 333		125 492				128 398	134 160	0,88			2018.10.31	2,59
	Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT0000607053	LTL	4 081		118 194				127 054	139 430	0,80			2018.03.28	2,69
	Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT0000607061	LTL	1 794		51 958				57 251	58 613	1,10			2019.10.25	1,13
	Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT0000610057	LTL	670		19 405				24 412	25 179	1,68			2022.05.17	0,49
	Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT0000611014	LTL	6 723		194 712				197 677	208 640	0,30			2016.02.10	4,03
	Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT1000607010	EUR	510		51 000				53 090	53 372	1,48			2021.08.28	1,03
	Iš viso:				45 703		1 359 880				1 425 424	1 467 870					28,36
2.3	Ne nuosavybės vertybiniai popieriai, kuriais prekiaujama kitose reguliuojamose rinkose																
	Austrijos Respublika	AT	AT0000A0N9A0	EUR	90		90 000				101 461	113 494	0,03			2022.04.20	2,19
	Belgijos Karalyste	BE	BE0000315243	EUR	110		110 000				114 201	131 510	0,08			2019.03.28	2,54
	Vokietijos Federacine Respublika	DE	DE0001135358	EUR	55		55 000				66 140	64 510	(0,09)			2018.07.04	1,25
	Vokietijos Federacine Respublika	DE	DE0001135457	EUR	30		30 000				31 769	34 399	0,15			2021.09.04	0,66
	Vokietijos Federacine Respublika	DE	DE0001135499	EUR	10		10 000				10 770	10 980	0,27			2022.09.04	0,21
	Vokietijos Federacine Respublika	DE	DE0001141588	EUR	15		15 000				15 727	15 272	(0,10)			2015.10.09	0,30
	Prancūzijos Respublika	FR	FR0000187361	EUR	100		100 000				113 177	110 036	(0,04)			2016.10.25	2,13
	Prancūzijos Respublika	FR	FR0010604983	EUR	75		75 000				87 512	86 973	(0,01)			2018.04.25	1,68
	Prancūzijos Respublika	FR	FR0010776161	EUR	35		35 000				40 434	41 269	0,15			2019.10.25	0,80
	Nyderlandų Karalystė	NL	NL0000102283	EUR	30		30 000				30 970	32 411	(0,05)			2016.07.15	0,63
	Nyderlandų Karalystė	NL	NL0006227316	EUR	25		25 000				28 533	28 996	(0,01)			2018.07.15	0,56

Ko- das	Emiteito (KIS, kredito įstaigos, banko pavadi- nimas)	Šalis	ISIN kodas / Priemonės pavadinimas	Valiuta	Kiekis, vnt.	Valdytojas	Bendra nominali vertė, Eur	Investicinis sandoris (pozicija)	San- dorio (pozi- cijos) vertė	Kita sandorio šalis	Bendra įsigijimo vertė, Eur	Bendra rinkos vertė, Eur	Palūkanų norma, %	Rinka (šaltinis), pa- gal kurios duome- nis nustatyta rinkos vertė (tinklalapio adresas)	KIS ti- pas	Išpirkimo / konverta- vimo data / terminas	Dalis GA / dalis port- felyje, %
	Nyderlandų Karalystė	NL	NL0010060257	EUR	50		50 000				52 337	57 350	0,41			2022.07.15	1,11
	Slovėnijos Respublika	SI	SI0002103065	EUR	200		200 000				201 741	205 495	0,16			2015.03.17	3,97
	Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	XS0327304001	EUR	30		30 000				32 385	35 288	0,51			2018.02.07	0,68
	Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	XS0485991417	USD	20		16 443				14 264	20 324	2,96			2020.02.11	0,39
	Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	XS0541528682	USD	152		124 966				117 706	137 776	1,78			2017.09.14	2,66
	Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	XS0739988086	USD	40		32 886				30 107	40 690	3,29			2022.02.01	0,79
	Iš viso:				1 067		1 029 295				1 089 234	1 166 773					22,55
2.4	Išleidžiami nauji ne nuosavybės vertybiniai popieriai																
	Iš viso:																
	Iš viso Obligacijos:				46 770		2 389 174				2 514 658	2 634 643					50,91
3	KIS																
3.1	Kolektyvinių investa- vimo subjektų, atitinkančių Kolektyvinių investavimo subjektų 61 str. 1d. reikalavi- mus, vienetai (akcijos)																
	SEB Eastern Europe Bond Fund	EE	EE3600087532	EUR	18 529	AS SEB Varahaldus					240 000	229 299		IS Bloomberg	KIS 1		4,43
	M&G Global Dividend EUR C	GB	GB00B39R2T55	EUR	5 875	M&G Securities					120 000	126 004		IS Bloomberg	KIS 3		2,43
	PIMCO GIS Global Investment Grade Credit Fund Inst	IE	IE0032876397	EUR	41 058	PIMCO Glo- bal Advisors (Ireland) Limited					673 271	704 138		IS Bloomberg	KIS 1		13,61
	PIMCO GIS Global High Yield Bond Fund EUR (Hdg) A	IE	IE00B2R34Y72	EUR	13 609	PIMCO Glo- bal Advisors (Ireland) Limited					268 845	266 736		IS Bloomberg	KIS 1		5,15
	JOHCM Global Select B EUR	IE	IE00B3DBRM10	EUR	39 158	J O Hambro Capital Ma- nagement Limited					80 000	83 133		IS Bloomberg	KIS 3		1,61
	GS Global Credit Portfolio (Hedged) I	LU	LU0234688595	EUR	48 604	Goldman Sachs Asset Manage- ment					648 933	676 564		IS Bloomberg	KIS 1		13,07
	JPMorgan Funds - Emerging Markets Local Currency	LU	LU0332400661	USD	20 500	JPMorgan Asset Ma- nagement Europe SAR					256 096	258 540		IS Bloomberg	KIS 1		5,00

Ko- das	Emiŋto (KIS, kredito jŋtaigos, banko pavadi- nimas)	Ŗalis	ISIN kodas / Priemonės pavadinimas	Valiuta	Kiekis, vnt.	Valdytojas	Bendra nominali vertė, Eur	Investicinis sandoris (pozicija)	San- dorio (pozi- cijos vertė	Kita sandorio Ŗalis	Bendra jŋsigijimo vertė, Eur	Bendra rinkos vertė, Eur	Palūkanų norma, %	Rinka (Ŗaltinis), pa- gal kurios duome- nis nustatyta rinkos vertė (tinklalapio adresas)	KIS ti- pas	IŖpirkimo / konverta- vimo data / terminas	Dalis GA / dalis port- felyje, %
	SEB Fund 1 - SEB Global Fund EUR	LU	LU0957649758	EUR	754	SEB Asset Manage- ment SA					91 000	93 440		IS Bloomberg	KIS 3		1,81
	IŖ viso:				188 087						2 378 145	2 437 854					47,11
3.2	Kitų kolektyvinių investavimo subjektų vienetai																
	IŖ viso:																
	IŖ viso KIS:				188 087						2 378 145	2 437 854					47,11
4	Pinigų rinkos priemonės																
4.1	Pinigų rinkos priemonės, kuriomis prekiaujama reguliu- ojamose rinkose																
	IŖ viso:																
4.2	Kitos pinigų rinkos priemonės																
	IŖ viso:																
	IŖ viso Pinigų rinkos priemonės:																
5	Indėliai kredito jŋtaigose																
	AB SEB bankas	LT		EUR								23 170	0,02			2015.01.06	0,45
	AB SEB bankas	LT		EUR								56 476	0,02			2015.01.06	1,09
	IŖ viso:											79 646					1,54
	IŖ viso Indėliai kredito jŋtaigose:											79 646					1,54
6	IŖvestinės investicinės priemonės																
6.1	IŖvestinės investicinės priemonės, kuriomis prekiau- jama reguliuojamose rinkose																
	Chicago Mercantile Exchange	US	ECH5	USD			XS0541528682, XS0485991417, XS0739988086	125 089	Chicago Mercantile Exchange			(2 266)		IS Bloomberg (t-1) dienos 10 val.		2015.03.16	(0,04)
	IŖ viso:											(2 266)					(0,04)
6.2	Kitos iŖvestinės investicinės priemonės																
	IŖ viso:																
	IŖ viso IŖvestinės investicinės priemonės:											(2 266)					(0,04)
7	Pinigai																
	AB SEB bankas	LT		LTL								31 999	0,0468				0,62
	SEB LONDON	GB		EUR								9					0,00
	AB SEB bankas	LT		USD								0	0,0656				0,00
	SEB LONDON	GB		USD								4 679					0,09

Ko- das	Emi- tento (KIS, kredito įstaigos, banko pavadi- nimas)	Šalis	ISIN kodas / Priemonės pavadinimas	Valiuta	Kiekis, vnt.	Valdytojas	Bendra nominali vertė, Eur	Investicinis sandoris (pozicija)	San- dorio (pozi- cijos vertė	Kita sandorio šalis	Bendra įsigijimo vertė, Eur	Bendra rinkos vertė, Eur	Palūkanų norma, %	Rinka (šaltinis), pa- gal kurios duome- nis nustatyta rinkos vertė (tinklalapio adresas)	KIS ti- pas	Išpirkimo / konverta- vimo data / terminas	Dalis GA / dalis port- felyje, %
	AB SEB bankas	LT		NOK								2					0,00
	Iš viso:											36 688					0,71
	Iš viso Pinigai:											36 688					0,71
8	Kitos priemonės, nenumatytos Kolektyvinio investavimo subjektų įstatymo 57 str. 1 d.																
	Gautinos sumos											0,00					0,00
	Mokėtinos sumos											(11 726)					(0,23)
	Iš viso:											(11 726)					(0,23)
	Iš viso Kitos priemonės, nenumatytos Kolektyvinio investavimo subjektų įstatymo 57 str. 1 d.:																
9	IŠ VISO:											5 174 839					100,00

* – nurodyti KIS tipą:

KIS 1 – KIS, kurių investavimo strategijoje numatyta iki 100 proc. grynųjų aktyvų investuoti į ne nuosavybės vertybinių popierius;

KIS 2 – KIS, kurių investavimo strategijoje numatytas mišrus (subalansuotas) investavimas;

KIS 3 – KIS, kurių investavimo strategijoje numatyta iki 100 proc. grynųjų aktyvų investuoti į nuosavybės vertybinius popierius;

KIS 4 – KIS, kurių investavimo strategijoje numatyta iki 100 proc. grynųjų aktyvų investuoti į pinigų rinkos priemones;

KIS 5 – visų kitų rūšių KIS (alternatyvus investavimo, privataus kapitalo, nekilnojamojo turto, žaliavų ir kt.)

Pastaba. Investuojant į fondų fondus, juos priskirti tam tikrai KIS grupei pagal fondų investavimo strategiją

6 Pastaba. Investicijų paskirstymas pagal investavimo strategiją atitinkančius kriterijus.

Investicijų pasiskirstymas	Ataskaitinio laikotarpio pabaigoje 2015 12 31		Ataskaitinio laikotarpio pradžioje 2014 12 31	
	Rinkos vertė, Eur	Dalis aktyvuose, %	Rinkos vertė, Eur	Dalis aktyvuose, %
Pagal turto rūšis				
Išsivysčiusių šalių akcijos	295 624	5,15	302 576	5,85
Besivystančių šalių akcijos	-	-	-	-
Rytų ir Vidurio Europos akcijos	-	-	-	-
Išsivysčiusių šalių įmonių obligacijos	1 611 039	28,09	1 647 439	31,84
Išsivysčiusių šalių vyriausybės obligacijos	767 124	13,38	932 695	18,02
Besivystančių šalių vyriausybės obligacijos	693 333	12,09	487 839	9,43
Lietuvos obligacijos	1 882 195	32,82	1 701 948	32,89
Žaliavos	-	-	-	-
Kitos alternatyvios investicijos	-	-	-	-
Išvestinės priemonės	(127)	(0,00)	(2 266)	(0,04)
Pinigų rinkos priemonės	485 721	8,47	104 608	2,02
Iš viso:	5 734 909	100,00	5 174 839	100,00

7 Pastaba. Investicijų, kurios apskaitoje nebuvo įvertintos tikrąja verte, pardavimo rezultatai (pelnas ir nuostoliai).

Investicijų, kurios apskaitoje nebuvo įvertintos tikrąja verte nebuvo.

8 Pastaba. Išvestinės finansinės priemonės ar jų grupės pagal 26-ąjį verslo apskaitos standartą „Išvestinės finansinės priemonės“.

Ataskaitiniu ir praėjusiu laikotarpiais fondas sudarė valiutos ateities (currency futures) ir obligacijų ateities (schatz ir bobl futures) sandorius.

Valiutos ateities sandoriai sudaryti norint apsidrausti nuo valiutos kurso rizikos. Sudarytų valiutos ateities sandorių rizika priklauso nuo euro ir JAV dolerio valiutos kurso pokyčių. Taikant tokius sandorius draudimo tikslais, portfeliui ar jo daliai nedaro įtakos valiutos kurso pokyčiai ir fondo vieneto vertės svyravimai, atsirandantys dėl valiutos kitimo – jie yra sumažinami arba jų visiškai nelieka.

Obligacijų ateities sandorių rizika priklauso nuo 2, 5 ir 10 metų Vokietijos vyriausybės obligacijų eurais palūkanų kitimo rinkoje. Vokietijos 2, 5 ir 10 metų obligacijų ateities sandorių rizika yra apskaičiuojama taikant vidutinės finansinės trukmės rodiklį. Bendra portfelio vidutinė finansinė trukmė yra apskaičiuojama atsižvelgiant į portfelio obligacijų finansinę trukmę ir minėtų ateities sandorių finansinę trukmę.

Pageidaujamą fondo finansinę trukmę nustato fondo valdytojas. Šis sprendimas yra priimamas atsižvelgiant į rinkų analizę ir prognozes. Sudarant obligacijų ateities sandorius, fondo valdytojo sprendimai įgyvendinami greitai ir pigiai. Sudarius Vokietijos 2, 5 arba 10 metų trukmės obligacijų ateities sandorius, galima suvienodinti dabartinę ir nustatytą (pageidaujamą) fondo finansinę trukmę. Sudaryti išvestinių investicinių priemonių sandoriai buvo taikomi norint valdyti valiutos ir bendros fondo palūkanų normos riziką.

Sudaryti išvestinių investicinių priemonių sandoriai buvo taikomi norint valdyti valiutos ir bendros fondo palūkanų normos riziką.

2015 m. gruodžio 31 d. galioję ateities sandoriai:

Priemonės pavadinimas	Valiutos kodas	Išpirkimo data	Priemonės panaudojimo tikslas
EURO SCHATZ FUTURE	EUR	2016.03.08	Palūkanų normų rizikos valdymas
CME USD/EUR CURRENCY FUTURE	USD	2016.03.14	Valiutų kursų svyravimo rizikos valdymas
EURO BOBL FUTURE	EUR	2016.03.08	Palūkanų normų rizikos valdymas

2014 m. gruodžio 31 d. galioję ateities sandoriai:

Priemonės pavadinimas	Valiutos kodas	Išpirkimo data	Priemonės panaudojimo tikslas
CME USD/EUR CURRENCY FUTURE	USD	2015.03.16	Valiutų kursų svyravimo rizikos valdymas

9 Pastaba. Atlyginimo tarpininkams sąnaudos.

2015 m. gruodžio 31 d.

Tarpininko pavadinimas	Sumokėti mokesčiai, Eur	Ar susijęs su valdymo įmone
AB SEB bankas	4	Taip
Skandinaviska Enskilda Banken AB	44	Taip
Iš viso:	48	-

2014 m. gruodžio 31 d.

Tarpininko pavadinimas	Sumokėti mokesčiai, Eur	Ar susijęs su valdymo įmone
AB SEB bankas	30	Taip
Skandinaviska Enskilda Banken AB	76	Taip
Iš viso:	106	-

10 Pastaba. Dalyviams apskaičiuoti ir (ar) išmokėti dividendai ar kitos išmokos, kurias išmokėjus vienetų skaičius nesikeičia.

Pensijų fondas dividendų nemoka.

11 Pastaba. Pasiskolintos ir paskolintos lėšos.

2015 m. gruodžio 31 d. ir 2014 m. gruodžio 31 d. fondas skolintų lėšų neturėjo.

12 Pastaba. Trečiosios šalies įsipareigojimai garantuoti subjekto pajamingumo dydį.

Įsipareigojimų nebuvo.

13 Pastaba. Sandorių su susijusiais asmenimis (valdymo įmone, tos pačios valdymo įmonės subjektais ir pan.) ataskaitinio ir praėjusio ataskaitinio laikotarpių sumos, suskirstytos į grupes, kita reikšminga informacija pagal 30-ąjį verslo apskaitos standartą „Susiję asmenys“.

Rodikliai	Per laikotarpį		Likutis datai	
	2015 01 01 - 2015 12 31	2014 01 01 - 2014 12 31	2015 12 31	2014 12 31
AB SEB bankas				
P pinigai laikomi banke	Žr. 5 pastaba	Žr. 5 pastaba	Žr. 5 pastaba	Žr. 5 pastaba
Komisinis mokestis už sandorius	Žr. 9 pastaba	Žr. 9 pastaba	-	-
Depozitoriumo mokesčiai	Žr. 20 pastaba	Žr. 20 pastaba	1 391	1 248
UAB SEB investicijų valdymas				
Atskaitymai nuo įmokų	Žr. 20 pastaba	Žr. 20 pastaba	5 355	3 669
Atskaitymai nuo turto vertės	Žr. 20 pastaba	Žr. 20 pastaba	3 287	4 180
Už pensijų kaupimo bendrovės keitimą	Žr. 20 pastaba	Žr. 20 pastaba	-	-
Skandinaviska Enskilda Banken AB				
Komisinis mokestis už sandorius	Žr. 9 pastaba	Žr. 9 pastaba	-	-
Valdymo mokesčio į investuojamus fondus nuolaida	1 269	92	-	-
Investicijos į SEB grupės valdomus fondus	Žr. 5 pastaba	Žr. 5 pastaba	Žr. 5 pastaba	Žr. 5 pastaba
P pinigai laikomi banke	Žr. 5 pastaba	Žr. 5 pastaba	Žr. 5 pastaba	Žr. 5 pastaba
SEB Europe Eastern Bond Fund				
Valdymo mokesčio į investuojamus fondus nuolaida	-	668	-	-

14 Pastaba. Reikšmingas apskaitinių įvertinimų, jeigu tokių buvo, pakeitimo poveikis ar pateiktos lyginamosios informacijos koregavimas dėl apskaitos politikos keitimo ar dėl klaidų taisymo pagal 7-ąjį verslo apskaitos standartą „Apskaitos politikos, apskaitinių įvertinimų keitimas ir klaidų taisymas“.

Siekiant teisingiau pateikti ne nuosavybės vertybinių popierių palūkanas, 2014 m. vyriausybės vertybinių popierių sukauptos palūkanos iškeltos iš grynųjų aktyvų pokyčių ataskaitos II.4.1 eilutės (111 578 Eur suma) į II.5 (80 511 Eur suma) bei III.3 (31 068 Eur suma) eilutes. Patikslintas klasifikavimas atitinka 2015 m. pateikimą bei VAS 39 nuostatas.

15 Pastaba. Trumpas reikšmingų pobalansinių įvykių, kurių neatskleidimas gali turėti reikšmingos įtakos įmonės finansinių ataskaitų vartotojų galimybei priimti sprendimus, apibūdinimas pagal 19-ąjį verslo apskaitos standartą „Atidėjiniai“, neapibrėžtieji įsipareigojimai ir turtas bei pobalansiniai įvykiai“.

Pobalansinių įvykių nebuvo.

16 Pastaba. Po grynujų aktyvų skaičiavimo datos įvykę reikšmingi turto ir įsipareigojimų pokyčiai, neįtraukti į grynujų aktyvų vertę.

Turto ir įsipareigojimų pokyčių neįtrauktų į grynujų aktyvų vertę nebuvo.

17 Pastaba. Kita reikšminga informacija apie kolektyvinio investavimo subjekto ar pensijų fondo finansinę būklę, veiksniai ir aplinkybės, turėję įtakos subjekto turtui ar įsipareigojimams pagal 18-ąjį verslo apskaitos standartą „Finansinis turtas ir finansiniai įsipareigojimai“ ir kitus verslo apskaitos standartus.

Nebuvo.

18 Pastaba. Investicijų grąža ir investicijų grąžos lyginamoji informacija.

Investicinio vieneto vertės pokyčio, investicinių priemonių portfelio metinės investicijų bendrosios ir grynosios grąžos ir lyginamojo indekso reikšmės pokyčio rodikliai

	Per ataskaitinį laikotarpį	Prieš metus	Prieš 2 metus	Prieš 10 metų
Apskaitos vieneto vertės pokytis, %*	(0,33)	2,98	(0,41)	3,50
Lyginamojo indekso reikšmės pokytis, %	0,63	4,22	0,10	-
Metinė bendroji investicijų grąža, %**	0,59	4,17	0,75	4,87
Metinė grynoji investicijų grąža, %**	(0,17)	3,14	(0,25)	3,84
Apskaitos vieneto (akcijos) vertės pokyčio standartinis nuokrypis, %**	2,10	1,45	1,52	1,12
Lyginamojo indekso reikšmės pokyčio standartinis nuokrypis, %**	2,16	1,56	1,68	-
Apskaitos vieneto vertės ir lyginamojo indekso reikšmės koreliacijos koeficientas**	0,99	0,95	0,98	-
Indekso sekimo paklaida, %**	0,48	0,45	0,45	-
Alfa rodiklis, %**	(0,95)	(0,80)	(0,50)	-
Beta rodiklis**	1,00	0,90	0,96	-

* Apskaičiuojant apskaitos vieneto vertės pokytį, neatsižvelgiama į atskaitymus nuo įmokų.

** Rodiklių paaiškinimai:

Metinė grynoji investicijų grąža – valstybinio socialinio draudimo įmokos dalies kaupimo pensijų fondo investicijų grąža, kurią apskaičiuojant atsižvelgiama į prekybos ir valdymo išlaidas.

Metinė bendroji investicijų grąža – papildomo savanoriško kaupimo pensijų fondo investicijų grąža, kurią apskaičiuojant atsižvelgiama tik į prekybos išlaidas. Apskaitos vieneto vertės pokyčio standartinis nuokrypis (angl. standard deviation) – statistinis rizikos rodiklis, rodantis, kaip kinta visi vieneto vertės pokyčiai, palyginus su jų vidutiniu pokyčiu.

Lyginamojo indekso reikšmės pokyčio standartinis nuokrypis (angl. standard deviation) – statistinis rizikos rodiklis, rodantis, kaip kinta visi lyginamojo indekso reikšmės pokyčiai, palyginus su jų vidutiniu pokyčiu.

Apskaitos vieneto vertės ir lyginamojo indekso reikšmės koreliacijos koeficientas – rodiklis, rodantis visų apskaitos vienetų vertės ir visų lyginamųjų indeksų vertės pokyčių statistinę priklausomybę.

Indekso sekimo paklaida (angl. tracking error) – statistinis rizikos rodiklis, rodantis apskaitos vieneto vertės pokyčių ir lyginamojo indekso vertės pokyčių skirtumų standartinį nuokrypį.

Alfa – rodiklis, rodantis skirtumą tarp pensijų fondo vieneto vertės pokyčio ir lyginamojo indekso vertės pokyčio, esant palyginamam rizikos lygiui.

Beta – rodiklis, rodantis, kiek pasikeičia pensijų fondo vieneto vertė pasikeitus lyginamojo indekso vertei.

Investicinio fondo vidutinė investicijų grąža, vidutinis investicinio vieneto vertės pokytis ir vidutinis lyginamojo indekso reikšmės pokytis

	Per paskutinius 3 metus	Per paskutinius 5 metus	Per paskutinius 10 metų	Nuo veiklos pradžios
Vidutinis apskaitos vieneto vertės pokytis, %*	0,74	2,05	2,74	2,80
Vidutinis pensijų fondo lyginamojo indekso reikšmės pokytis, %*	1,64	-	-	1,64
Vidutinė grynoji investicijų grąža, %*	0,89	2,21	2,97	3,03
Vidutinė bendroji investicijų grąža, %*	1,82	3,19	3,97	4,04
Vidutinis apskaitos vieneto vertės pokyčio standartinis nuokrypis, %*	1,72	1,73	3,16	2,91

*Rodiklių paaiškinimai:

Vidutinis apskaitos vieneto vertės pokytis – metinių apskaitos vieneto vertės pokyčių geometrinis vidurkis.

Vidutinis pensijų fondo lyginamojo indekso reikšmės pokytis – metinių lyginamojo indekso reikšmės pokyčių geometrinis vidurkis.

Vidutinė grynoji investicijų grąža – metinių grynujų investicijų grąžų geometrinis vidurkis.

Vidutinė bendroji investicijų grąža – metinių bendrųjų investicijų grąžų geometrinis vidurkis.

Vidutinis apskaitos vieneto vertės pokyčio standartinis nuokrypis – metinis apskaitos vieneto vertės pokyčio standartinis nuokrypis už nurodytą laikotarpį

Vidutinis apskaitos vieneto vertės pokyčio standartinis nuokrypis – metinis apskaitos vieneto vertės pokyčio standartinis nuokrypis už nurodytą laikotarpį.

19 Pastaba. Fondo lyginamasis indeksas ir trumpas jo apibūdinimas

Turto klasė	Lyginamojo indekso pavadinimas	Dalis sudėtiniame lyginamajame indekse, %
Lietuvos Respublikos Vyriausybės obligacijos	Lietuvos Respublikos Vyriausybės vertybinių popierių indeksas	30
Vakarų Europos vyriausybių obligacijos	Merrill Lynch EMU Direct Governments, AAA-A Rated, 1-10 Year	25
Išsivysčiusių šalių investicinio reitingo įmonių obligacijos	Barclays Capital Global Aggregate Corporate TR	25
Rytų ir Vidurio Europos akcijos	Merrill Lynch Eastern Europe Government Bond	5
Besivystančių šalių vyriausybių obligacijos vietine valiuta	J. P. Morgan GBI-EM Global Diversified Composite Unhedged EUR	5
Išsivysčiusių šalių didelio pajamingumo įmonių obligacijos	BofA Merrill Lynch Global High Yield, BB-B Rated, Constrained (Euro Hedged)	5
Pasaulio akcijos	MSCI AC World Index TR Net	5

Sudėtinis lyginamasis indeksas ataskaitiniu laikotarpiu nebuvo keičiamas.

20 Pastaba. Atskaitymai (atskaitymų rūšys ir apskaičiuotos sumos) iš valstybinio socialinio draudimo įmokos dalies kaupimo fondo ar iš papildomo savanoriško pensijų kaupimo fondo turto, portfelio apyvartumo rodiklis. Papildomo savanoriško pensijų kaupimo fondo atskaitymų dalis procentais palyginti su ataskaitinio laikotarpio vidutine grynųjų aktyvų verte. Jei per ataskaitinį laikotarpį keitėsi atskaitymų dydžiai, atskirai pateikiamos kiekvieno nustatyto dydžio sumos. Valstybinio socialinio draudimo įmokos dalies kaupimo fondo bendras atskaitymų rodiklis. Papildomo savanoriško pensijų kaupimo fondo bendras išlaidų koeficientas. Jei yra skaičiuojamas valstybinio socialinio draudimo įmokos dalies kaupimo fondo ar papildomo savanoriško pensijų kaupimo fondo sąlyginis tikėtinas bendrasis išlaidų koeficientas, pateikiama išsamesnė informacija apie jį.

2015 m. gruodžio 31 d.

Atskaitymai	Atskaitymo dydis		Per ataskaitinį laikotarpį priskaičiuotų atskaitymų suma, Eur	% nuo ataskaitinio laikotarpio vidutinės grynųjų aktyvų vertės
	maksimalus, nustatytas sudarymo dokumentuose, %	ataskaitiniu laikotarpiu taikytas, %		
Už valdymą				
nekintamas dydis (iki 2015 04 30)	1	1	17 093	0,32
nekintamas dydis (nuo 2015 05 01)	0,65	0,65	23 660	0,44
sėkmės mokestis	-	-	-	-
Depozitoriumui	0,3	0,1	5 367	0,10
Už sandorių sudarymą			48	0,00
Už auditą			2 745	0,05
Kitos veiklos išlaidos (nurodyti išlaidų rūšis)	-	-	-	-
Išlaidų, įskaičiuojamų į BIK, suma				
BIK % nuo GAV*				1,15
Visų išlaidų suma:			48 913	0,91
PAR (praėjusio analogiško ataskaitinio laikotarpio PAR)*				12,30

2014 m. gruodžio 31 d.

Atskaitymai	Atskaitymo dydis		Per ataskaitinį laikotarpį priskaičiuotų atskaitymų suma, Eur	% nuo ataskaitinio laikotarpio vidutinės grynujų aktyvų vertės
	maksimalus, nustatytas sudarymo dokumentuose, %	ataskaitiniu laikotarpiu taikytas, %		
Už valdymą				
nekintamas dydis	1	1	48 602	0,99
sėkmės mokestis	-	-	-	-
Depozitoriumui	0,3	0,1	4 882	0,10
Už sandorių sudarymą			106	0,00
Už auditą			2 628	0,05
Kitos veiklos išlaidos (nurodyti išlaidų rūšis)	-	-	-	-
Išlaidų, įskaičiuojamų į BIK, suma				
BIK % nuo GAV*				1,48
Visų išlaidų suma:			56 218	1,14
PAR (praėjusio analogiško ataskaitinio laikotarpio PAR)*				70,29

* Rodiklių paaiškinimai:

Bendrasis išlaidų koeficientas (BIK) – procentinis dydis, kuris parodo, kokia vidutinė fondo grynujų aktyvų dalis skiriama jo valdymo išlaidoms padengti. Šios išlaidos tiesiogiai sumažina investuotojo investicijų grąžą. Pažymėtina, kad skaičiuojant BIK į sandorių sudarymo išlaidas neatsižvelgiama.

Portfelio apyvartumo rodiklis (PAR) – rodiklis, apibūdinantis prekybos pensijų fondo portfelį sudarančiomis priemonėmis aktyvumą. Fondai, kurių PAR aukštas, patiria didesnes sandorių sudarymo išlaidas.

21 Pastaba. Gautos ir išmokėtos lėšos.
2015 m. gruodžio 31 d.

Bendra gautų lėšų suma, Eur		958 915
Periodinės įmokos į pensijų fondą	iš Valstybinio socialinio draudimo fondo	-
	pačio dalyvio įmokėtos lėšos (pildoma tik papildomo savanoriško pensijų kaupimo pensijų fondo atveju)	485 041
	darbdavių ir kitų trečiųjų asmenų įmokėtos lėšos (pildoma tik papildomo savanoriško pensijų kaupimo pensijų fondo atveju)	184 517
Valstybinio socialinio draudimo fondo sumokėti delspinigiai		-
Iš garantijų rezervo sumokėtos lėšos		-
Iš kitų pensijų fondų pervestos lėšos	iš tos pačios pensijų kaupimo bendrovės	283 638
	iš kitos pensijų kaupimo bendrovės	5 719
Kitos gautos lėšos		-
Bendra išmokėtų lėšų suma, Eur		364 750
Pensijų išmokos	vienkartinės išmokos dalyviams	207 190
	periodinės išmokos dalyviams	-
	išmokos anuiteto įsigijimui	-
Į kitus pensijų fondus pervestos lėšos	valdomus tos pačios pensijų kaupimo bendrovės	95 319
	valdomus kitos pensijų kaupimo bendrovės	176
Išstojusiems dalyviams išmokėtos lėšos (pildoma tik papildomo savanoriško kaupimo pensijų fondų atveju)		52 557
Paveldėtojams išmokėtos lėšos		9 508
Kitais pagrindais išmokėtos lėšos		-

2014 m. gruodžio 31 d.

Bendra gautų lėšų suma, Eur		735 054
Periodinės įmokos į pensijų fondą	iš Valstybinio socialinio draudimo fondo	-
	pačio dalyvio įmokėtos lėšos (pildoma tik papildomo savanoriško pensijų kaupimo pensijų fondo atveju)	367 112
	darbdavių ir kitų trečiųjų asmenų įmokėtos lėšos (pildoma tik papildomo savanoriško pensijų kaupimo pensijų fondo atveju)	121 794
Valstybinio socialinio draudimo fondo sumokėti delspinigiai		-
Iš garantijų rezervo sumokėtos lėšos		-
Iš kitų pensijų fondų pervestos lėšos	iš tos pačios pensijų kaupimo bendrovės	240 838
	iš kitos pensijų kaupimo bendrovės	5 310
Kitos gautos lėšos		-

Bendra išmokėtų lėšų suma, Eur		589 152
Pensijų išmokos	vienkartinės išmokos dalyviams	442 770
	periodinės išmokos dalyviams	-
	išmokos anuiteto įsigijimui	-
Į kitus pensijų fondus pervestos lėšos	valdomus tos pačios pensijų kaupimo bendrovės	64 856
	valdomus kitos pensijų kaupimo bendrovės	14 252
Išstojuosiemis dalyviams išmokėtos lėšos (pildoma tik papildomo savanoriško kaupimo pensijų fondų atveju)		51 893
Paveldėtojams išmokėtos lėšos		15 381
Kitais pagrindais išmokėtos lėšos	pervedimas į ES fondus	-

22 Pastaba. Grynujų aktyvų vertės padidėjimo detalizavimas.

Kitą grynujų aktyvų vertės padidėjimą 2015.12.31 sudarė gauta retrocesija (3915 Eur) ir kitos pajamos (992 Eur). Kitą grynujų aktyvų vertės padidėjimą 2014.12.31 sudarė gauta retrocesija (1091 Eur).

VII. Informacija apie pensijų fondo dalyvius

23. Bendri duomenys apie pensijų fondo dalyvius (dalyviais laikomi ir asmenys, pasinaudoję teise nukelti pensijų išmokos mokėjamą, taip pat asmenys, gaunantys periodines pensijų išmokas):

Dalyvių skaičius ataskaitinio laikotarpio pradžioje		1 441
Dalyvių skaičius ataskaitinio laikotarpio pabaigoje	dalyviai, pasinaudoję teise nukelti pensijų išmokos mokėjamą	983
	dalyviai, gaunantys periodines pensijų išmokas	-
	kiti dalyviai	731
Iš viso:		1 714
Dalyvių skaičiaus pokytis		273

24. Per ataskaitinį laikotarpį prisijungusių dalyvių skaičius:

Bendras prisijungusių dalyvių skaičius		360
Dalyviai, pensijų kaupimo sutartis sudarę pirmą kartą		309
Iš kitų pensijų fondų atėję dalyviai	iš tos pačios pensijų kaupimo bendrovės	39
	iš kitos pensijų kaupimo bendrovės	12

25. Per ataskaitinį laikotarpį pasitraukusių dalyvių skaičius:

Bendras pasitraukusių dalyvių skaičius		87
Į kitus pensijų fondus išėjusių dalyvių skaičius	valdomus tos pačios pensijų kaupimo bendrovės	14
	valdomus kitos pensijų kaupimo bendrovės	1
Baigusią dalyvavimą dalyvių skaičius	išstojusių (pildoma tik papildomo savanoriško pensijų kaupimo pensijų fondo atveju)	17
	sulaukusių nustatyto pensijos amžiaus ir pasinaudojusių teise į pensijų išmoką (vienkartinę išmoką, anuitetą ir jų derinį)	50
	dalyvių, pasinaudojusių Pensijų kaupimo įstatymo suteikta galimybe vienašališkai nutraukti pirmą kartą sudarytą sutartį	-
	mirusių dalyvių	5

26. Pensijų fondo dalyvių struktūra pagal amžių ir lytį ataskaitinio laikotarpio pabaigoje:

		Dalyviai pagal amžių				
		iki 30	nuo 30 iki 45	nuo 45 iki 60	nuo 60	iš viso:
Dalyvių skaičius	iš viso:	29	271	668	746	1 714
	vyrų	20	156	300	339	815
	moterys	9	115	368	407	899
Dalyvių dalis, %	iš viso:	100	100	100	100	100
	vyrų	69	58	45	45	48
	moterys	31	42	55	55	52

VIII. Išoriniai pinigų srautai

27. Per ataskaitinį laikotarpį faktiškai gautos lėšos.

(Žr. 22.3. punktas, 21 Pastaba)

28. Išmokėtos lėšos.

(Žr. 22.3. punktas, 21 Pastaba)

IX. Informacija apie garantijų rezervą

29. Jei pensijų fondo taisyklėse yra įsipareigojimas garantuoti tam tikrą pajamingumą, nurodyti garantuojamo pajamingumo dydį, per ataskaitinį laikotarpį į garantinį rezervą įmokėtų įmokų sumą, pateikti jo investicinių priemonių portfelį, jei buvo panaudotas, nurodyti panaudojimo priežastis, panaudotą sumą, rezervo dydį ataskaitinio laikotarpio pabaigoje ir kitą svarbią informaciją.

-

X. Informacija apie pensijų fondo reikmėms pasiskolintas lėšas

30. Pensijų fondo reikmėms pasiskolintos lėšos ataskaitinio laikotarpio pabaigoje:

(Žr. 22.3. punktas, 11 Pastaba)

XI. Kita informacija

31. Paaiškinimai, komentarai, iliustruojamoji grafinė medžiaga ir kita svarbi informacija apie pensijų fondo veiklą, kad būtų galima tinkamai įvertinti fondo veiklos pokyčius ir rezultatus.

Viso laikotarpio vieneto vertė eurais



XII. Atsakingi asmenys

32. Konsultantų, kurių paslaugomis buvo naudotasi rengiant ataskaitą (finansų maklerio įmonės, auditoriai, kt.), vardai, pavardės (juridinių asmenų pavadinimai), adresai, leidimo verstis atitinkama veikla pavadinimas ir numeris.

-

33. Ataskaitą parengusių asmenų vardai, pavardės, pareigos, darbovietė (jeigu ataskaitą rengė asmenys nėra bendrovės darbuotojai).

-

34. Valdymo įmonės administracijos vadovo, vyriausiojo finansininko, ataskaitą rengusių asmenų ir konsultantų patvirtinimas, kad joje pateikta informacija teisinga ir nėra nutylėtų faktų, galinčių daryti esminę įtaką pensijų fondo veiklos rezultatų vertinimui.

-

35. Asmenys, atsakingi už ataskaitoje pateiktą informaciją:

35.1. už ataskaitą atsakingi įmonės valdymo organų nariai, darbuotojai ir administracijos vadovas (nurodyti vardus, pavardes, telefonų ir faksų numerius, el. pašto adresus)

Tvirtinu _____

Tvirtinu _____

Virgilijus Mirkės,
generalinis direktorius,
tel. (8 5) 268 1528, faks. (8 5) 268 1575,
el. paštas info.invest@seb.lt

Airidas Kuzminskas,
vyriausiasis buhalteris,
tel. (8 5) 268 1528, faks. (8 5) 268 1575,
el. paštas info.invest@seb.lt;

35.2. jeigu ataskaitą rengia konsultantai arba ji rengiama padedant konsultantams, nurodyti konsultantų vardus, pavardes, telefonų ir faksų numerius, el. pašto adresus (jeigu konsultantas yra juridinis asmuo, nurodyti jo pavadinimą, telefonų ir faksų numerius, el. pašto adresą bei konsultanto atstovo(-ų) vardą, pavardę); pažymėti, kokias konkrečias dalis rengė konsultantai arba kokios dalys parengtos jiems padedant, ir nurodyti konsultantų atsakomybės ribas

-

