

2016 metų sausio – birželio mėnesių ataskaita

SEB aktyviai valdomas fondų portfelis 60

2016 m. birželio 30 d.

Turinys

I. Bendroji informacija	2
II. Grynųjų aktyvų, apskaitos vienetų skaičius ir vertė	2
III. Kolektyvinio investavimo subjekto išlaidų ir apyvartumo rodikliai	3
IV. Informacija apie kolektyvinio investavimo subjekto investicinių priemonių portfelį	3
V. Kolektyvinio investavimo subjekto investicijų grąža ir rizikos rodikliai	4
VI. Kolektyvinio investavimo subjekto finansinė būklė	5
VII. Informacija apie dividendų išmokėjimą	21
VIII. Informacija apie kolektyvinio investavimo subjekto reikmėms pasiskolintas lėšas	21
IX. Informacija apie garantijų rezervą	22
X. Informacija apie pensijų fondo reikmėms pasiskolintas lėšas	22

I. Bendroji informacija

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

Investicinis fondas *SEB aktyviai valdomas fondų portfelis 60* (2011 m. birželio 2 d. Vertybinių popierių komisija sprendimu Nr. 2K-111 leido pakeisti bendrovės valdomo investicinio *SEB pasaulio rinkų fondų fondo* pavadinimą į *SEB aktyviai valdomas fondų portfelis 60*). Vertybinių popierių komisijos pritarimo investicinio fondo sudarymo dokumentams data – 2006 m. vasario 9 d.

2. Ataskaitinis laikotarpis, už kurį pateikta ataskaita – 2016 metų I pusmetis.

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. Grynujų aktyvų, apskaitos vienetų skaičius ir vertė

5. Nurodyti grynujų 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. Kolektyvinio investavimo subjekto išlaidų ir apyvartumo rodikliai

7. Atskaitymų iš kolektyvinio investavimo subjekto turto rūšys, sumos, procentinė išraiška, bendrasis išlaidų koeficientas, portfelio apyvartumo rodiklis (jei per ataskaitinį laikotarpį keitėsi atskaitymų dydis, pateikti atskirai sumas pagal kiekvieną dydį).

Atskaitymai	Atskaitymo dydis		Per ataskaitinį laikotarpį priskaičiuotų atskaitymų suma, Eur	% nuo ataskaitinio laikotarpio vidutinės gryųjų aktyvų vertės
	maksimalus, nustatytas sudarymo dokumentuose, %	ataskaitiniu laikotarpiu taikytas, %		
Už valdymą				
<i>neįvertinamas dydis</i>	0,75	0,75	168 074	0,37
<i>sėkmės mokesčiai</i>	-	-	-	-
Depozitoriumui	ne daugiau kaip 0,10 proc. nuo vidutinės Fondo GA vertės	0,1	22 482	0,05
Už sandorių sudarymą	ne didesnis kaip 0,50 proc. nuo sudarytų sandorių vertės		468	0,00
Už auditą	pagal faktą, bet ne daugiau kaip 2 proc. nuo vidutinės metinės GA vertės		1 200	0,00
Kitos veiklos išlaidos (nurodyti išlaidų rūšis)	-	-	-	-
Išlaidų, įskaičiuojamų į BIK, suma				-
BIK % nuo GAV*				-
Visų išlaidų suma:			192 224	0,42
PAR (praėjusio analogiško ataskaitinio laikotarpio PAR)*				-

* rodikliai pateikiami tik metų ataskaitoje.

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 ataskaitoje). Pavyzdyje pateikti skaičiavimus, kiek būtų atskaityta (eurais) nuo pensijų fondo dalyvio įmokų esant dabartiniam atskaitymų dydžiui ir kokią sumą jis atgautų po 1, 3, 5, 10 metų, jei būtų investuota 3 000 Eur, o metinė investicijų grąža – 5 proc.

-

IV. Informacija apie kolektyvinio investavimo subjekto investicinių priemonių portfelį

11. Ataskaitinio laikotarpio pabaigos investicinių priemonių portfelio sudėtis.

(Žr. 22.3. punktas, 5 Pastaba)

12. Investicijų pasiskirstymas pagal investavimo strategiją atitinkančius kriterijus (pildyti pagal investavimo strategiją atitinkančius kriterijus, pavyzdžiui, pagal turto rūšis, pramonės šakas, geografinę zoną, valiutas, rinkas, emitentų tipus (vyriausybė, bendrovės), emitentų kredito reitingus, priemonių galiojimo trukmę bei kt.).

(Žr. 22.3. punktas, 6 Pastaba)

13. Per ataskaitinį laikotarpį įvykdyti išvestinių finansinių priemonių sandoriai, išskyrus tuos, kurie nurodyti šio priedo 11 punkte (pagal išvestinių finansinių priemonių rūšis nurodyti sandorių vertes, 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
EUROSTOXX 50 FUTURE	Ateities sandoris (angl. future)	9 744	EUR	Akcijų rinkų svyravimo rizikos valdymas	Reguliuojamų rinkų IP

14. 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 išvestinė finansinė priemonė gali apsaugoti investicinių priemonių sandorį (investicinių priemonių poziciją) nuo rizikos.

(Žr. 2.2.3. punktas, 8 Pastaba)

15. 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 išvestinės finansinės priemonės bazinio turto rinkos vertę (standartinis įsipareigojimų metodas (angl. standard commitment approach)). Ataskaitinio laikotarpio pabaigoje prisiimtos rizikos nebuvo.

16. Finansuojamojo kolektyvinio investavimo subjekto pagal sandorius dėl išvestinių finansinių priemonių prisiimtos rizikos apimtys atžvilgiu nurodyti:

- 16.1. finansuojančiojo kolektyvinio investavimo subjekto tiesioginės galimos rizikos apimtys ir faktinės finansuojamojo kolektyvinio investavimo subjekto išvestinių finansinių priemonių rizikos apimtys, proporcingos finansuojančiojo kolektyvinio investavimo subjekto investicijoms į finansuojamąjį subjektą, suma.
- 16.2. finansuojančiojo kolektyvinio investavimo subjekto tiesioginės galimos rizikos apimtys ir galimos didžiausios finansuojamojo kolektyvinio investavimo subjekto pagal sandorius dėl išvestinių finansinių priemonių prisiimtos rizikos apimtys, nustatytos finansuojamojo kolektyvinio investavimo subjekto steigimo dokumentuose ir proporcingos finansuojančiojo kolektyvinio investavimo subjekto investicijoms į finansuojamąjį subjektą, suma.

17. 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.

18. Nurodyti veiksnius, 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 palūkanų politika ir obligacijų supirkimo programa.** Perna ECB pradėjus vykdyti euro zonos vyriausybių obligacijų supirkimo programą padidėjo šių obligacijų paklausa ir toliau kilo jų kaina. Šių metų kovo mėnesį ECB paskelbė ir apie nebankinio sektoriaus aukšto kredito reitingo įmonių obligacijų įtraukimą į šią programą. Tai gerokai kilstelėjo ir šių obligacijų kainą. Visa tai turėjo teigiamą įtaką fondo vieneto vertei.
2. **Vienas sparčiausių regione Lietuvos ūkio augimas ir stabili politinė situacija mažino šalies kredito riziką.** Šie veiksniai lėmė padidėjusią šalies obligacijų paklausą ir aukštesnę kainą. Tai darė teigiamą įtaką fondo vieneto vertei.
3. **Didžiosios Britanijos gyventojų referendumas dėl išstojimo iš Europos Sąjungos.** Netikėti referendumo rezultatai sukėlė didžiulį akcijų kainų nuosmukį pasaulio akcijų rinkose. Tai neigiamai paveikė fondo vieneto vertę. Tačiau sumaištis akcijų rinkose padidino saugių investicijų paklausą. Tai kėlė Vakarų Europos šalių obligacijų kainas ir turėjo teigiamą įtaką fondo vieneto vertei.
4. **Didžiųjų centrinių bankų vykdyta pinigų politika.** Europos, Japonijos ir JAV centriniai bankai toliau vykdė ekonomikos augimą skatinančią pinigų politiką. Europos ir Japonijos centriniai bankai dar labiau sumažino palūkanas, o JAV Federalinis atsargų bankas (FED) atidėjo planus kelti bazinę palūkanų normą. Kritusios palūkanų normos kėlė obligacijų kainas, o pagerėję investuotojų lūkesčiai kėlė ir rizikingų investicijų, visų pirma, akcijų kainas. Tai darė teigiamą įtaką fondo vieneto vertei.
5. **Sumažėjusi tikimybė, kad FED šiemet didins palūkanų normą.** Didėjančių JAV dolerių palūkanų lūkesčiai praėjusiais metais smukdė besivystančių šalių akcijų ir obligacijų rinkas. Tačiau dėl rinkų korekcijos šių metų pradžioje, o vėliau – dėl Didžiosios Britanijos referendumo rezultatų – FED kuriam laikui atidėjo palūkanų kėlimą. Didelę skolos dalį būtent JAV doleriais turinčioms besivystančioms šalims tai buvo gera žinia, dėl kurios šiame regione kilo akcijų ir obligacijų kainos. Tai turėjo teigiamą įtaką fondo vieneto vertei.
6. **Žaliavų kainų atsigavimas.** Po kelis metus trukusio kainų nuosmukio žaliavų kainos šiemet atsigavo. WTI naftos kainai vasarį pasiekus žemiausią lygį nuo 2003 metų per kitus tris mėnesius šios žaliavos kaina beveik padvigubėjo. Be to, neramumai akcijų rinkose kėlė aukso kainą, o neišsipildžius drastiško Kinijos ekonomikos lėtėjimo scenarijui atsigavo ir pramoninių metalų kainos. Aukštesnės žaliavų kainos buvo naudingos nuo jų eksporto priklausančioms besivystančioms šalims. Visa tai turėjo teigiamą įtaką fondo vieneto vertei.

V. Kolektyvinio investavimo subjekto investicijų grąža ir rizikos rodikliai

VI. Kolektyvinio investavimo subjekto finansinė būklė

23. Pateikti šias kolektyvinio investavimo subjekto finansines ataskaitas, parengtas vadovaujantis Lietuvos Respublikos įstatymų ir teisės aktų reikalavimais:

23.1. grynujų aktyvų ataskaitą.

Grynujų aktyvų ataskaita (EUR)

2016 m. birželio 30 d.

Eil. nr.	Straipsniai	Pastabos Nr.	2016 06 30	2015 12 31
A.	TURTAS		46 407 608	46 660 513
I.	PINIGAI	5	6 833 185	7 225 653
II.	TERMINUOTIEJI INDĖLIAI		-	-
III.	PINIGŲ RINKOS PRIEMONĖS		-	-
III.1.	Valstybės išdo vekseliai		-	-
III.2.	Kitos pinigų rinkos priemonės		-	-
IV.	PERLEIDŽIAMIEJI VERTYBINIAI POPIERIAI	4, 5, 6	39 574 423	39 434 817
IV.1.	Ne nuosavybės vertybiniai popieriai		1 600 379	2 795 178
IV.1.1.	Vyriausybės ir centrinių bankų arba jų garantuoti ne nuosavybės vertybiniai popieriai		1 600 379	2 795 178
IV.1.2.	Kiti ne nuosavybės vertybiniai popieriai		-	-
IV.2.	Nuosavybės vertybiniai popieriai		-	-
IV.3.	Kitų kolektyvinio investavimo subjektų investiciniai vienetai ir akcijos		37 974 044	36 639 639
V.	SUMOKĖTI AVANSAI		-	-
VI.	GAUTINOS SUMOS	5	-	43
VI.1.	Investicijų pardavimo sandorių gautinos sumos		-	-
VI.2.	Kitos gautinos sumos		-	43
VII.	INVESTICINIS IR KITAS TURTAS		-	-
VII.1.	Investicinis turtas		-	-
VII.2.	Išvestinės finansinės priemonės		-	-
VII.3.	Kitas turtas		-	-
B.	ĮSIPAREIGOJIMAI	5	101 946	231 025
I.	Mokėtinos sumos		101 946	231 025
I.1.	Už finansinį ir investicinį turtą mokėtinos sumos		-	-
I.2.	Valdymo įmonei ir depozitoriumui mokėtinos sumos	13	43 087	37 780
I.3.	Kitos mokėtinos sumos		58 859	193 245
II.	Sukauptos sąnaudos		-	-
III.	Finansinės skolos kredito įstaigoms		-	-
IV.	Įsipareigojimai pagal išvestinių finansinių priemonių sutartis		-	-
V.	Kiti įsipareigojimai		-	-
C.	GRYNIEJI AKTYVAI	2	46 305 662	46 429 488

7 – 20 puslapiuose pateiktas aiškinamasis raštas yra neatskiriama šių finansinių ataskaitų dalis.

23.2. grynųjų aktyvų pokyčių ataskaitą.

Grynųjų aktyvų pokyčių ataskaita (EUR)

2016 m. birželio 30 d.

Eil. nr.	Straipsniai	Pastabos Nr.	2016 01 01- 2016 06 30	2015 01 01- 2015 06 30
I.	GRYNŲJŲ AKTYVŲ VERTĖ ATASKAITINIO LAIKOTARPIO PRADŽIOJE		46 429 488	45 205 646
II.	GRYNŲJŲ AKTYVŲ VERTĖS PADIDĖJIMAS		2 477 295	4 769 539
II.1.	Dalyvių įmokos į fondą	3	1 195 035	1 285 340
II.2.	Iš kitų fondų gautos sumos	3	12 425	13 155
II.3.	Garantinės įmokos		-	-
II.4.	Investicinės pajamos		12 671	33 954
II.4.1.	Palūkanų pajamos		253	2
II.4.2.	Dividendai		12 418	33 952
II.4.3.	Nuomos pajamos		-	-
II.5.	Pelnas dėl investicijų vertės pasikeitimo ir pardavimo	4	1 149 280	3 345 432
II.6.	Pelnas dėl užsienio valiutos kursų pokyčio		46 740	8 362
II.7.	Išvestinių finansinių priemonių pelnas		10 000	23 225
II.8.	Kitas grynųjų aktyvų vertės padidėjimas	23	51 144	60 072
	PADIDĖJO IŠ VISO:		2 477 295	4 769 539
III.	GRYNŲJŲ AKTYVŲ VERTĖS SUMAŽĖJIMAS		2 601 121	2 007 341
III.1.	Išmokos fondo dalyviams	3	1 607 289	1 642 582
III.2.	Išmokos kitiems fondams	3	6 967	2 502
III.3.	Nuostoliai dėl investicijų vertės pasikeitimo ir pardavimo	4	742 537	155 214
III.4.	Nuostoliai dėl užsienio valiutos kursų pokyčio		51 682	12 165
III.5.	Išvestinių finansinių priemonių sandorių nuostoliai		-	-
III.6.	Valdymo sąnaudos:		192 646	194 879
III.6.1.	Atlyginimas valdymo įmonei	13	168 496	179 884
III.6.2.	Atlyginimas depozitoriumui	13	22 482	11 939
III.6.3.	Atlyginimas tarpininkams	9	468	1 773
III.6.4.	Audito sąnaudos		1 200	1 283
III.6.5.	Palūkanų sąnaudos		-	-
III.6.6.	Kitos sąnaudos		-	-
III.7.	Kitas grynųjų aktyvų vertės sumažėjimas		-	-
III.8.	Sąnaudų kompensavimas (-)		-	-
	SUMAŽĖJO IŠ VISO:		2 601 121	1 642 582
IV.	Grynųjų aktyvų vertės pokytis		(123 826)	(357 242)
V.	Pelno paskirstymas		-	-
VI.	GRYNŲJŲ AKTYVŲ VERTĖ ATASKAITINIO LAIKOTARPIO PABAIGOJE	2	46 305 662	47 967 844

7 – 20 puslapiuose pateiktas aiškinamasis raštas yra neatskiriama šių finansinių ataskaitų dalis.

Aiškinamasis raštas

Bendroji informacija

Investicinis fondas *SEB aktyviai valdomas fondų portfelis 60* (toliau – Fondas) buvo įsteigtas 2005 m. gegužės 12 d., Lietuvos Respublikos vertybinių popierių komisijai pritarus Fondo taisyklėms ir prospektams. 2011 m. birželio 3 d. pakeistas fondo pavadinimas iš *SEB pasaulio rinkų fondų fondas* į *SEB aktyviai valdomas fondų portfelis 60*.

Fondo vienetai pradėti platinti 2005 m. gegužės 18 d.

Pagrindinė Fondo veikla yra investicinė veikla. Fondo tikslas yra užtikrinti ilgalaikį investicinio vieneto vertės augimą investuojant turtą į įvairių pasaulio regionų akcijų ir obligacijų fondus.

Investicinį fondą *SEB aktyviai valdomas fondų portfelis 60* valdo UAB *SEB investicijų valdymas* (toliau – Bendrovė), įsteigta ir įregistruota 2000 m. gegužės 3 d., įmonės kodas 125277981. 2003 m. rugpjūčio 28 d. Lietuvos Respublikos vertybinių popierių komisijos sprendimu Bendrovei išduota valdymo įmonės, veikiančios pagal Lietuvos Respublikos kolektyvinio investavimo subjektų įstatymą, veiklos licencija Nr. VJK – 001.

Fondo 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.

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

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

Finansiniai Fondo metai sutampa su kalendoriniais metais.

Sumos šiose finansinėse ataskaitose pateiktos Lietuvos Respublikos nacionaline valiuta – eurai (EUR). 2015 m. sausio 1 d. Lietuva prisijungė prie euro zonos narė ir jos valiuta tapo euras. Litai buvo pakeisti į eurus santykiu 3,4528 lito už 1 eurą. Bendrovė perskaičiavo palygi-namuosius 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 konkrečius skolos VP, finansinio pajėgumo. Valdydama šią riziką, bendrovė gali naudoti išvestines finansines priemones, kurių vertė kinta kartu su emitento kreditingumo kokybe;
3. VP pasirinkimo rizika. Nors 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

Vertybinių popierių padidėjusi vertės dalis traukiama į apskaitą, kai įsigijami 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 parodomas 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 valiutų 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 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) t.y 1 litas.

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 maža 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. Grynujų aktyvų vertė, vienetų skaičius ir vertė ataskaitinio laikotarpio pradžioje ir pabaigoje, prieš metus, prieš dujus metus. Kai vienetai yra skirtingų klasių, duomenys pateikiami pagal klases.

	Ataskaitinio laikotarpio pradžioje (2016 01 04)	Ataskaitinio laikotarpio pabaigoje (2016 06 30)	Prieš metus (2015 06 30)	Prieš dujus metus (2014 06 30)
Grynujų aktyvų vertė, Eur	45 958 301	46 305 662	47 967 844	43 900 297
Apskaitos vieneto vertė, Eur	0,4346	0,4427	0,4540	0,4148
Apskaitos vienetų skaičius	105 742 396	104 601 525	105 664 477	105 826 565

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

2016 m. birželio 30 d.

	Apskaitos vienetų skaičius	Vertė, Eur
Išplatinta (konvertuojant pinigines lėšas į investicinius vienetus)*	2 788 431	1 207 460
Išpirkta (konvertuojant investicinius vienetus į pinigines lėšas)	3 737 041	1 614 256
Skirtumas	(948 610)	(406 796)

2015 m. birželio 30 d.

	Apskaitos vienetų skaičius	Vertė, Eur
Išplatinta (konvertuojant pinigines lėšas į investicinius vienetus)*	2 827 075	1 298 495
Išpirkta (konvertuojant investicinius vienetus į pinigines lėšas)	3 516 570	1 645 084
Skirtumas	(689 496)	(346 589)

* išplatintų vienetų vertė pateikiama kartu su įmokos mokesčiais.

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

2016 m. birželio 30 d.

Investicijos	Pokytis					
	praėjusio ataskaitinio laikotarpio pabaigoje	įsigyta	parduota (išpirkta)	teigiamas vertės pokytis	neigiamas vertės pokytis	ataskaitinio laikotarpio pabaigoje
Ne nuosavybės vertybiniai popieriai	2 795 178	-	(1 197 087)	2 288	-	1 600 379
Kitų kolektyvinio investavimo subjektų investiciniai vienetai ir akcijos	36 639 639	3 786 841	(2 856 891)	1 146 992	(742 537)	37 974 044
Iš viso:	39 434 817	3 786 841	(4 053 978)	1 149 280	(742 537)	39 574 423

2015 m. birželio 30 d.

Investicijos	Pokytis					
	praėjusio ataskaitinio laikotarpio pabaigoje	įsigyta	parduota (išpirkta)	teigiamas vertės pokytis	neigiamas vertės pokytis	ataskaitinio laikotarpio pabaigoje
Ne nuosavybės vertybiniai popieriai	2 223 812	1 003 419	(1 057 242)	3 461	(1 194)	2 172 256
Kitų kolektyvinio investavimo subjektų investiciniai vienetai ir akcijos	41 220 510	11 559 892	(14 954 510)	3 341 971	(154 020)	41 013 843
Iš viso:	43 444 322	12 563 311	(16 011 752)	3 345 432	(155 214)	43 186 099

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

2016 m. birželio 30 d.

Kodas	Emitento (KIS, kredito įstaigos, banko pavadinimas)	Šalis	ISIN kodas / Priemonės pavadinimas	Valiuta	Kiekis, vnt.	Valdytojas	Bendra nominali vertė, EUR	Investicinis sandoris (pozicija)	Sandorio (pozicijos) vertė	Kita sandorio šalis	Bendra įsigijimo vertė, EUR	Bendra rinkos vertė, EUR	Palūkanų norma, %	Rinka (šaltinis), pagal kurios duomenis nustatyta rinkos vertė (tinklalapio adresas)	KIS tipas	Balsų dalis emite, %	Išpirkimo / konvertavimo data / terminas	Dalis GA / dalis portfelėje, %	
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	LT0000605115	EUR	2 316 960		23 170				25 475	24 275	(0,08)				2016.10.20	0,05	
	Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT0000603276	EUR	60 000 000		600 000				612 208	609 061	(0,04)				2017.02.27	1,32	
	Iš viso:				62 316 960		623 170				637 683	633 336						1,37	
2.3	Ne nuosavybės vertybiniai popieriai, kuriais prekiaujama kitose reguliuojamose rinkose																		
	Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	XS0327304001	EUR	880		880 000				990 440	967 043	(0,14)				2018.02.07	2,09	
	Iš viso:				880		880 000				990 440	967 043						2,09	

Kodas	Emitento (KIS, kredito įstai- gos, banko pavadinimas)	Šalis	ISIN kodas / Priemonės pavadinimas	Valiuta	Kiekis, vnt.	Valdytojas	Bendra nominali vertė, EUR	Inves- ticinis sandoris (pozicija)	San- dorio (pozi- cijos vertė)	Kita sandorio šalis	Bendra įsigijimo vertė, EUR	Bendra rinkos vertė, EUR	Palūkanų norma, %	Rinka (šaltinis), pagal kurios duomenis nus- tatyta rinkos vertė (tinklala- pio adresas)	KIS ti- pas	Bal- sų dalis emi- ten- te, %	Išpirkimo / konverta- vimo data / terminas	Dalis GA / dalis port- felyje, %
2.4	Išleidžiami nauji ne nuosavybės vertybiniai popieriai																	
Iš viso:																		
Iš viso Obligacijos:					62 317 840		1 503 170				1 628 123	1 600 379						3,46
3	KIS																	
3.1	Kolektyvinių investa- vimo subjektų, atitinkančių Kolektyvinių investavimo subjektų 61 str. 1d. reikalavi- mus, vienetai (akcijos)																	
	HSBC Euro Govt Bond Fund-C	FR	FR0000971293	EUR	276	HSBC Global Asset Ma- nagement (France)					734 513	942 597		IS Bloomberg	KIS 1			2,04
	Lyxor UCITS ETF MSCI Emer- ging Markets C-EUR	FR	FR0010429068	EUR	328 000	Lyxor International Asset Mana- gement					2 880 694	2 634 496		IS Bloomberg	KIS 3			5,69
	PIMCO GIS Global Investment Grade Credit Fund Inst	IE	IE0032876397	EUR	132 523	PIMCO Glo- bal Advisors (Ireland) Limited					2 174 478	2 409 266		IS Bloomberg	KIS 1			5,20
	JOHCM European Select Val A Shares EUR	IE	IE0032904330	EUR	344 200	J O Hambro Capital Ma- nagement Limited					1 032 545	1 106 259		IS Bloomberg	KIS 3			2,39
	PIMCO GIS Global High Yield Bond Fund EUR (Hdg) A	IE	IE00B2R34Y72	EUR	91 150	PIMCO Glo- bal Advisors (Ireland) Limited					1 820 587	1 854 908		IS Bloomberg	KIS 1			4,01
	JOHCM Global Select B EUR	IE	IE00B3DBRM10	EUR	1 533 623	J O Hambro Capital Ma- nagement Limited					2 511 512	3 301 890		IS Bloomberg	KIS 3			7,13
	iShares Core MSCI World UCITS ETF	IE	IE00B4L5Y983	EUR	81 000	BlackRock Asset Mana- gement					2 895 930	3 005 910		IS Bloomberg	KIS 3			6,48
	Lazard Emerging Markets Equity Fund Institutional	IE	IE00B77H9381	EUR	22 785	Lazard Fund Managers Ireland					2 102 963	2 190 350		IS Bloomberg	KIS 3			4,73
	SEB Sicav 1-SEB Eastern Europe ex Russia	LU	LU0070133888	EUR	164 840	SEB Asset Manage- ment S.A.					435 843	423 474		IS Bloomberg	KIS 3			0,91

Kodas	Emitento (KIS, kredito įstai- gos, banko pavadinimas)	Šalis	ISIN kodas / Priemonės pavadinimas	Valiuta	Kiekis, vnt.	Valdytojas	Bendra nominali vertė, EUR	Investicinis sandoris (pozicija)	Sandorio (pozicijos vertė)	Kita sandorio šalis	Bendra įsigijimo vertė, EUR	Bendra rinkos vertė, EUR	Palūkanų norma, %	Rinka (šaltinis), pagal kurios duomenis nus- tatyta rinkos vertė (tinklala- pio adresas)	KIS ti- pas	Bal- sų dalis emi- ten- te, %	Išpirkimo / konverta- vimo data / terminas	Dalis GA / dalis port- felyje, %
	SEB Fund 1 - SEB Global Chance / Risk Fund C EUR	LU	LU0122113094	EUR	785 000	SEB Asset Manage- ment SA					875 655	936 505		IS Bloomberg	KIS 3			2,02
	MFS GLOBAL CONCENTRA- TED FUND I	LU	LU0219424644	EUR	11 440	MFS Meri- dian Fund					2 111 821	2 628 683		IS Bloomberg	KIS 3			5,68
	GS Global Credit Portfolio (Hedged) I	LU	LU0234688595	EUR	159 176	Goldman Sachs Asset Manage- ment					2 125 648	2 311 233		IS Bloomberg	KIS 1			4,99
	Robeco Lux-O-Rente I EUR	LU	LU0239950693	EUR	11 538	Robeco Luxembourg SA					1 538 817	1 868 025		IS Bloomberg	KIS 1			4,03
	DB X-Trackers MSCI World Index UCITS ETF	LU	LU0274208692	EUR	62 667	DB Platinum Advisors					2 207 264	2 508 560		IS Bloomberg	KIS 3			5,42
	DB X-Trackers MSCI Europe Index UCITS ETF	LU	LU0274209237	EUR	13 040	DB Platinum Advisors					663 918	607 273		IS Bloomberg	KIS 3			1,31
	JPMorgan Funds - Emerging Markets Local Currency D	LU	LU0332400828	USD	155 676	JPMorgan Asset Ma- nagement Europe SAR					1 828 094	1 947 007		IS Bloomberg	KIS 1			4,20
	Morgan Stanley Investment Funds Global Brands Z	LU	LU0360482987	USD	43 199	Morgan Stanley Investment Manage- ment					1 261 373	1 915 328		IS Bloomberg	KIS 3			4,14
	DB X-Trackers Euro Stoxx 50 UCITS ETF	LU	LU0380865021	EUR	24 400	DB Platinum Advisors					1 067 458	933 422		IS Bloomberg	KIS 3			2,02
	Vontobel Fund-Harcourt Commodity I	LU	LU0415415800	USD	8 020	Vontobel Manage- ment SA/ Luxembourg					674 661	569 500		IS Bloomberg	KIS 5			1,23
	SEB Fund 1 - SEB Global Fund EUR	LU	LU0957649758	EUR	26 596	SEB Asset Manage- ment SA					3 405 674	3 438 210		IS Bloomberg	KIS 3			7,43
	Carmignac Portfolio Capital Plus F EUR acc	LU	LU0992631217	EUR	433	Carmignac Gestion					442 501	441 148		IS Bloomberg	KIS 5			0,95
	Iš viso:				3 999 582						34 791 949	37 974 044						82,00
3.2	Kitų kolektyvinių investavimo subjektų vienetai																	
	Iš viso:																	
	Iš viso KIS:				3 999 582						34 791 949	37 974 044						82,00
4	Pinigų rinkos priemonės																	
4.1	Pinigų rinkos priemonės, kuriomis prekiaujama reguliu- ojamose rinkose																	

Kodas	Emitento (KIS, kredito įstaigos, banko pavadinimas)	Šalis	ISIN kodas / Priemonės pavadinimas	Valiuta	Kiekis, vnt.	Valdytojas	Bendra nominali vertė, EUR	Investicinis sandoris (pozicija)	Sandorio (pozicijos) vertė	Kita sandorio šalis	Bendra įsigijimo vertė, EUR	Bendra rinkos vertė, EUR	Palūkanų norma, %	Rinka (šaltinis), pagal kurios duomenis nustatyta rinkos vertė (tinklalapio adresas)	KIS tipas	Balų dalis emitente, %	Išpirkimo / konvertavimo data / terminas	Dalis GA / dalis portfelyje, %					
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 prekiaujama reguliuojamose rinkose																						
Iš viso:																							
6.2	Kitos išvestinės investicinės priemonės																						
Iš viso:																							
Iš viso Išvestinės investicinės priemonės:																							
7	Pinigai																						
	SEB LONDON	GB		USD								849						0,00					
	AB SEB bankas	LT		USD								116	0,3324					0,00					
	SEB LONDON	GB		JPY								2						0,00					
	SEB LONDON	GB		EUR								165 184						0,36					
	AB SEB bankas	LT		EUR								6 667 033						14,40					
Iš viso:												6 833 185				14,76							
Iš viso Pinigai:												6 833 185				14,76							
8	Kitos priemonės, nenumatytos Kolektyvinio investavimo subjektų įstatymo 57 str. 1 d.																						
	Gautinos sumos																		-				-
	Mokėtinos sumos																		(101 946)				(0,22)
Iš viso:												(101 946)				(0,22)							
Iš viso Kitos priemonės, nenumatytos Kolektyvinio investavimo subjektų įstatymo 57 str. 1 d.:																							
9	IŠ VISO:											46 305 662				100,00							

2015 m. birželio 30 d.

Kodas	Emitento (KIS, kredito įstaigos, banko pavadinimas)	Šalis	ISIN kodas / Priemonės pavadinimas	Valiuta	Kiekis, vnt.	Valdytojas	Bendra nominali vertė, Eur	Investicinis sandoris (pozicija)	Sandorio (pozicijos) vertė	Kita sandorio šalis	Bendra įsigijimo vertė, Eur	Bendra rinkos vertė, Eur	Palūkanų norma, %	Rinka (šaltinis), pagal kurios duomenis nustatyta rinkos vertė (tinklalačio adresas)	KIS tipas	Balsų dalis emite, %	Išpirkimo / konvertavimo data / terminas	Dalis GA / dalis portfelje, %	
1	Akcijos																		
1.1	Nuosavybės vertybiniai popieriai, įtraukti į Oficialųjį ar įj atitinkantį prekybos sąrašą																		
	Iš viso:																		
1.2	Nuosavybės vertybiniai popieriai, įtraukti į Papildomąjį ar įj 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 įj atitinkantį prekybos sąrašą																		
	Iš viso:																		
2.2	Ne nuosavybės vertybiniai popieriai, įtraukti į Papildomąjį ar įj atitinkantį prekybos sąrašą																		
	Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT0000603250	EUR	49 026 877		490 269				496 429	499 279	0,10				2016.01.31	1,04	
	Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT0000605115	EUR	2 316 960		23 170				25 475	25 349	0,13				2016.10.20	0,05	
	Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT0000611014	EUR	62 248 031		622 480				630 013	645 371	0,10				2016.02.10	1,35	
	Iš viso:																		
					113 591 868		1 135 919				1 151 917	1 169 999						2,44	
2.3	Ne nuosavybės vertybiniai popieriai, kuriais prekiaujama kitose reguliuojamose rinkose																		
	Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	XS0327304001	EUR	880		880 000				1 003 419	1 002 260	0,22				2018.02.07	2,09	
	Iš viso:																		
					880		880 000				1 003 419	1 002 260						2,09	
2.4	Išleidžiami nauji ne nuosavybės vertybiniai popieriai																		

Kodas	Emitento (KIS, kredito įstaigos, banko pavadinimas)	Šalis	ISIN kodas / Priemonės pavadinimas	Valiuta	Kiekis, vnt.	Valdytojas	Bendra nominali vertė, Eur	Investicinis sandoris (pozicija)	Sandorio (pozicijos) vertė	Kita sandorio šalis	Bendra įsigijimo vertė, Eur	Bendra rinkos vertė, Eur	Palūkanų norma, %	Rinka (šaltinis), pagal kurios duomenis nustatyta rinkos vertė (tinklalapio adresas)	KIS tipas	Balsų dalis emitente, %	Išpirkimo / konvertavimo data / terminas	Dalis GA / dalis portfelyje, %
Iš viso:																		
Iš viso Obligacijos:																		
3	KIS																	
3.1	Kolektyvinių investavimo subjektų, atitinkančių Kolektyvinių investavimo subjektų 61 str. 1d. reikalavimus, vienetai (akcijos)																	
	SEB Eastern Europe Bond Fund	EE	EE3600087532	EUR	64 582	AS SEB Varahaldus					748 143	783 178		IS Bloomberg	KIS 1			1,63
	HSBC Euro Govt Bond Fund-C	FR	FR0000971293	EUR	275	HSBC Global Asset Management (France)					734 513	872 154		IS Bloomberg	KIS 1			1,82
	Lyxor UCITS ETF MSCI Emerging Markets C-EUR	FR	FR0010429068	EUR	165 000	Lyxor International Asset Management					1 598 795	1 491 435		IS Bloomberg	KIS 3			3,11
	M&G Global Dividend EUR C	GB	GB00B39R2T55	EUR	76 782	M&G Securities					1 411 441	1 799 916		IS Bloomberg	KIS 3			3,75
	PIMCO GIS Global Investment Grade Credit Fund Inst	IE	IE0032876397	EUR	93 823	PIMCO Global Advisors (Ireland) Limited					1 491 063	1 614 692		IS Bloomberg	KIS 1			3,37
	JOHCM European Select Val A Shares EUR	IE	IE0032904330	EUR	472 200	J O Hambro Capital Management Limited					1 416 524	1 559 677		IS Bloomberg	KIS 3			3,25
	PIMCO GIS Global High Yield Bond Fund EUR (Hdg) A	IE	IE00B2R34Y72	EUR	47 850	PIMCO Global Advisors (Ireland) Limited					949 408	958 920		IS Bloomberg	KIS 1			2,00
	JOHCM Global Select B EUR	IE	IE00B3DBRM10	EUR	1 668 623	J O Hambro Capital Management Limited					2 732 592	4 001 357		IS Bloomberg	KIS 3			8,34
	iShares Core MSCI World UCITS ETF	IE	IE00B4L5Y983	EUR	60 000	BlackRock Asset Management					2 171 172	2 287 200		IS Bloomberg	KIS 3			4,77
	Lazard Emerging Markets Equity Fund Institutional	IE	IE00B77H9381	EUR	22 785	Lazard Fund Managers Ireland					2 102 963	2 421 616		IS Bloomberg	KIS 3			5,05
	SEB Sicav I-SEB Eastern Europe ex Russia	LU	LU0070133888	EUR	164 840	SEB Asset Management S.A.					435 843	511 169		IS Bloomberg	KIS 3			1,07
	MFS GLOBAL CONCENTRATED FUND I	LU	LU0219424644	EUR	18 890	MFS Meridian Fund					3 487 090	4 475 797		IS Bloomberg	KIS 3			9,32

Kodas	Emitento (KIS, kredito įstaigos, banko pavadinimas)	Šalis	ISIN kodas / Priemonės pavadinimas	Valiuta	Kiekis, vnt.	Valdytojas	Bendra nominali vertė, Eur	Investicinis sandoris (pozicija)	Sandorio (pozicijos) vertė	Kita sandorio šalis	Bendra įsigijimo vertė, Eur	Bendra rinkos vertė, Eur	Palūkanų norma, %	Rinka (šaltinis), pagal kurios duomenis nustatyta rinkos vertė (tinklalapio adresas)	KIS tipas	Balsų dalis emitente, %	Išpirkimo / konvertavimo data / terminas	Dalis GA / dalis portfelyje, %
	GS Global Credit Portfolio (Hedged) I	LU	LU0234688595	EUR	125 176	Goldman Sachs Asset Management					1 643 628	1 727 427		IS Bloomberg	KIS 1			3,60
	Robeco Lux-O-Rente I EUR	LU	LU0239950693	EUR	13 638	Robeco Luxembourg SA					1 818 890	2 011 489		IS Bloomberg	KIS 1			4,19
	DB X-Trackers MSCI World Index UCITS ETF	LU	LU0274208692	EUR	79 900	DB Platinum Advisors					2 793 574	3 289 483		IS Bloomberg	KIS 3			6,86
	DB X-Trackers MSCI Europe Index UCITS ETF	LU	LU0274209237	EUR	23 400	DB Platinum Advisors					1 191 386	1 226 160		IS Bloomberg	KIS 3			2,56
	JPMorgan Funds - Emerging Markets Local Currency	LU	LU0332400661	USD	125 892	JPMorgan Asset Management Europe SARL					1 569 956	1 630 614		IS Bloomberg	KIS 1			3,40
	Morgan Stanley Investment Funds Global Brands Z	LU	LU0360482987	USD	43 199	Morgan Stanley Investment Management					1 261 373	1 772 509		IS Bloomberg	KIS 3			3,70
	DB X-Trackers Euro Stoxx 50 UCITS ETF	LU	LU0380865021	EUR	33 400	DB Platinum Advisors					1 461 193	1 478 284		IS Bloomberg	KIS 3			3,08
	Vontobel Fund-Belvista Commodity I	LU	LU0415415800	USD	8 020	Vontobel Management SA/Luxembourg					674 661	596 475		IS Bloomberg	KIS 5			1,24
	SEB Fund 1 - SEB Global Fund EUR	LU	LU0957649758	EUR	27 646	SEB Asset Management SA					3 542 998	3 741 346		IS Bloomberg	KIS 3			7,80
	Carmignac Portfolio Capital Plus F EUR acc	LU	LU0992631217	EUR	433	Carmignac Gestion					442 500	448 797		IS Bloomberg	KIS 5			0,94
	SKAGEN GLOBAL FUND	NO	NO0008004009	NOK	2 048	SKAGEN A/S					256 462	314 148		IS Bloomberg	KIS 3			0,65
	Iš viso:				3 338 402						35 936 168	41 013 843						85,50
3.2	Kitų kolektyvinių investavimo subjektų vienetai																	
	Iš viso:																	
	Iš viso KIS:				3 338 402						35 936 168	41 013 843						85,50
4	Pinigų rinkos priemonės																	
4.1	Pinigų rinkos priemonės, kuriomis prekiaujama reguliuojamose rinkose																	
	Iš viso:																	
4.2	Kitos pinigų rinkos priemonės																	
	Iš viso:																	

Kodas	Emitento (KIS, kredito įstaigos, banko pavadinimas)	Šalis	ISIN kodas / Priemonės pavadinimas	Valiuta	Kiekis, vnt.	Valdytojas	Bendra nominali vertė, Eur	Investicinis sandoris (pozicija)	Sandorio (pozicijos) vertė	Kita sandorio šalis	Bendra įsigijimo vertė, Eur	Bendra rinkos vertė, Eur	Palūkanų norma, %	Rinka (šaltinis), pagal kurios duomenis nustatyta rinkos vertė (tinklalapio adresas)	KIS tipas	Balsų dalis emitente, %	Išpirkimo / konvertavimo data / terminas	Dalis GA / dalis portfelyje, %
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 prekiaujama reguliuojamose rinkose																	
Iš viso:																		
6.2	Kitos išvestinės investicinės priemonės																	
Iš viso:																		
Iš viso Išvestinės investicinės priemonės:																		
7	Pinigai																	
	SEB LONDON	GB		USD								846						0,00
	SEB LONDON	GB		JPY								1						0,00
	SEB LONDON	GB		EUR								40						0,00
	AB SEB bankas	LT		EUR								4 823 956						10,06
Iš viso:												4 824 843				10,06		
Iš viso Pinigai:												4 824 843				10,06		
8	Kitos priemonės, nenumatytos Kolektyvinio investavimo subjektų įstatymo 57 str. 1 d.																	
	Gautinos sumos											5 626				0,01		
	Mokėtinos sumos											(48 727)				(0,10)		
Iš viso:												(43 101)				(0,09)		
Iš viso Kitos priemonės, nenumatytos Kolektyvinio investavimo subjektų įstatymo 57 str. 1 d.:																		
9	IŠ VISO:											47 967 844				100,00		

* – nurodyti KIS tipą:

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

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

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

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

KIS 5 – visų kitų rūšių KIS (alternatyvaus 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 2016 06 30		Ataskaitinio laikotarpio pradžioje 2015 12 31	
	Rinkos vertė, Eur	Dalis aktyvuose, %	Rinkos vertė, Eur	Dalis aktyvuose, %
Pagal turto rūšis				
Išsivysčiusių šalių akcijos	20 382 039	44,02	21 771 022	46,89
Besivystančių šalių akcijos	4 824 847	10,42	4 522 610	9,74
Rytų ir Vidurio Europos akcijos	423 474	0,91	448 200	0,97
Išsivysčiusių šalių įmonių obligacijos	6 575 408	14,20	4 263 698	9,18
Išsivysčiusių šalių vyriausybės obligacijos	2 810 621	6,07	2 951 187	6,36
Besivystančių šalių vyriausybės obligacijos	1 947 007	4,20	1 746 499	3,76
Lietuvos obligacijos	1 600 379	3,46	2 795 178	6,02
Žaliavos	569 500	1,23	492 754	1,06
Kitos alternatyvios investicijos	441 148	0,95	443 669	0,96
Išvestinės priemonės	-	-	-	-
Pinigų rinkos priemonės	6 731 239	14,54	6 994 671	15,07
Iš viso:	46 305 662	100,00	46 429 488	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 laikotarpiu fondas sudarė akcijų ateities (equity futures) sandorius.

Sudarytų akcijų ateities sandorių kainų pokyčiai tiesiogiai priklauso nuo Vakarų Europos akcijų indekso STOXX 50 reikšmių pokyčio. Šie sandoriai buvo sudaryti norint sumažinti fondo riziką, susijusią su akcijų rinkų svyravimais, ir galimą fondo turto vertės sumažėjimą dėl Vakarų Europos akcijų rinkų kritimo. Šių ateities sandorių rizika yra nustatoma atsižvelgiant į nominaliąją sandorio vertę. Ši rizika yra kontroliuojama stebint, kad bendra akcijų dalies ir ateities sandorių nominalioji vertė neviršytų ribų, nustatytų fondo taisyklėse.

Sudaryti išvestinių investicinių priemonių sandoriai buvo taikomi norint valdyti akcijų kainų kritimo riziką.

2016 m. birželio 30 d. ir 2015 m. birželio 30 d. galiojusių ateities sandorių nebuvo.

9 Pastaba. Atlyginimo tarpininkams sąnaudos.

2016 m. birželio 30 d.

Tarpininko pavadinimas	Sumokėti mokesčiai, Eur	Ar susijęs su valdymo įmone
AB SEB bankas	212	Taip
Skandinaviska Enskilda Banken AB	256	Taip
Iš viso:	468	-

2015 m. birželio 30 d.

Tarpininko pavadinimas	Sumokėti mokesčiai, Eur	Ar susijęs su valdymo įmone
AB SEB bankas	1 773	Taip
Skandinaviska Enskilda Banken AB	-	Taip
Iš viso:	1 773	-

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.

2016 m. birželio 30 d. ir 2015 m. birželio 30 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	
	2016 01 01 - 2016 06 30	2015 01 01 - 2015 06 30	2016 06 30	2015 06 30
AB SEB bankas				
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	22 482	11 939	11 643	6 099
Valdymo mokesčio į investuojamus fondus nuolaida	-	55	-	-
UAB SEB investicijų valdymas				
Atskaitymai nuo įmokų	422	1 415	79	62
Atskaitymai nuo turto vertės	168 074	178 469	31 365	31 614
Skandinaviska Enskilda Banken AB				
Komisinis mokestis už sandorius	Žr. 9 pastaba	Žr. 9 pastaba	-	-
Valdymo mokesčio į investuojamus fondus nuolaida	30 059	31 435	-	-
Investicijos į SEB grupės valdomus fondus	Žr. 5 pastaba	Žr. 5 pastaba	Žr. 5 pastaba	Žr. 5 pastaba
Pinigai laikomi banke	Žr. 5 pastaba	Žr. 5 pastaba	Žr. 5 pastaba	Žr. 5 pastaba
SEB Eesti Uhispank				
Valdymo mokesčio į investuojamus fondus nuolaida	1 005	2 286	-	-

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, 2015 m. birželio 30 d. vyriausybės vertybinių popierių sukaupotos palūkanos iškeltos iš grynujų aktyvų pokyčių ataskaitos II.4.1 eilutės (31 359 EUR suma) į II.5 (3 495 EUR suma) bei III.3 (27 864 EUR suma) eilutes. Patikslintas klasifikavimas atitinka 2016 m. birželio 30 d. 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.

24. Visas audito išvados tekstas.

-

25. Informacija apie kolektyvinio investavimo subjekto investicinės veiklos pajamas ir patirtas sąnaudas per ataskaitinį laikotarpį.

I.	Pajamos iš investicinės veiklos	
1.	Palūkanų pajamos	42 352
2.	Realizuotas pelnas iš investicijų į:	53 077
2.1.	nuosavybės vertybinius popierius	-
2.2.	vyriausybės skolos vertybinius popierius	(62)
2.3.	įmonių skolos vertybinius popierius	-
2.4.	finansines priemones	-
2.5.	išvestines finansines priemones	10 000
2.6.	kitų kolektyvinio investavimo subjektų vienetų	(8 101)
2.7.	kita	51 240
3.	Nerealizuotas (nuostolis) / pelnas iš:	380 185
3.1.	nuosavybės vertybinių popierių	-
3.2.	vyriausybės skolos vertybinių popierių	(27 331)
3.3.	įmonių skolos vertybinių popierių	-
3.4.	finansinių priemonių	-
3.5.	išvestinių finansinių priemonių	-
3.6.	kitų kolektyvinio investavimo subjektų vienetų	412 556
3.7.	Kitų	(5 040)
	Pajamų iš viso:	475 614
II.	Sąnaudos	
1.	Veiklos sąnaudos	192 646
1.1.	valdymo mokesčiai	168 496
1.2.	mokesčiai depozitoriumui	22 482
1.3.	mokesčiai tarpininkams	468
1.4.	mokesčiai už auditą	1 200
1.5.	kiti mokesčiai ir išlaidos	-
2.	Kitos išlaidos	-
	Sąnaudų iš viso:	192 646
III.	Grynosios pajamos	282 968
IV.	Išmokos (dividendai) investicinių vienetų savininkams	-
V.	Reinvestuotos pajamos	-

26. Kita reikšminga informacija apie kolektyvinio investavimo subjekto finansinę būklę, veiksniai ir aplinkybės, turėję įtakos kolektyvinio investavimo subjekto turtui ar įsipareigojimams.

-

VII. Informacija apie dividendų išmokėjimą

27. Pateikti informaciją apie priskaičiuotų ir (ar) išmokėtų dividendų (pusmečio ataskaitoje – tarpinių dividendų po mokesčių) sumas, nurodyti laikotarpį, už kurį dividendai buvo mokami, išmokėjimo datas, dividendų dydį, tenkantį vienam investiciniam vienetui (akcijai), ir kitą svarbią informaciją.

-

VIII. Informacija apie kolektyvinio investavimo subjekto reikmėms pasiskolintas lėšas

28. Kolektyvinio investavimo subjekto reikmėms pasiskolintos lėšos ataskaitinio laikotarpio pabaigoje.

(Žr. 23.3. punktas, 11 Pastaba)

IX. Kita informacija

29. Paaiškinimai, komentarai, iliustruojamoji grafinė medžiaga ir kita svarbi informacija apie kolektyvinio investavimo subjekto veiklą, kad investuotojas galėtų tinkamai įvertinti subjekto veiklos pokyčius ir rezultatus

Viso laikotarpio vieneto vertė eurais



X. 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 _____

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

Tvirtinu _____

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.

-

