

PENSIJŲ FONDO *SEB PENSIIJA 1*
2008 M. SAUSIO-BIRŽELIO MĖNESIŲ ATASKAITA

I. BENDROSIOS NUOSTATOS

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

Valstybinio socialinio draudimo įmokos dalies kaupimo konservatyvaus investavimo pensijų fondas *SEB pensija 1*, taisyklių Nr. PF-V01-K001-001(004)

2. Ataskaitinis laikotarpis, kurio ataskaita pateikta – **2008 m. I pusmetis**

3. Duomenys apie valdymo įmonę:

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

3.2. buveinė (adresas) – **Gedimino pr. 20, Vilnius, Lietuvos Respublika**

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

tel. (8 5) 268 1594

faks. (8 5) 268 1575

e. paštas info.invest@seb.lt

internetu adresas www.seb.lt

3.4. veiklos licencijos numeris – **VĮK – 001**

3.5. pensijų fondo valdytojo vardas ir pavardė, pareigos – **Vladislavas Zaborovskis, portfelio valdytojas**

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

AB SEB bankas

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

įmonės kodas 112021238

II. GRYNŲJŲ AKTYVŲ, APSKAITOS VIENETŲ SKAIČIUS IR VERTĖ

5. Nurodyti grynujų aktyvų, apskaitos vienetų skaičių ir vertę:

	Ataskaitinio laikotarpio pradžioje (2008 01 02)	Ataskaitinio laikotarpio pabaigoje (2008 06 30)	Prieš metus (2007 06 29)	Prieš dvejus metus (2006 06 30)
Grynujų aktyvų vertė, Lt	103 129 281	124 803 577	79 295 459	45 361 843
Apskaitos vieneto vertė, Lt	1,06	1,0510	1,0320	1,0317
Apskaitos vienetų skaičius	97 194 704	118 746 859	76 838 634	43 968 423

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

	Apskaitos vienetų skaičius	Vertė (Lt)
Apskaitos vienetų skaičius (konvertuojant pinigines lėšas į apskaitos vienetus)	25 098 444	27 109 851
Apskaitos vienetų skaičius (konvertuojant vienetus į pinigines lėšas)	3 571 671	3 810 768

III. ATSKAITYMAI IŠ PENSIJŲ TURTO

7. Atskaitymai iš pensijų turto:

Atskaitymai iš valstybinio socialinio draudimo įmokos dalies kaupimo pensijų fondo pensijų turto (jei per ataskaitinį laikotarpį keitėsi atskaitymų dydis, atskirai pateikti sumas pagal kiekvieną dydį); jei yra skaičiuojamas sąlyginis tikėtinas bendrasis išlaidų koeficientas, pateikti papildomą informaciją, nurodytą taisyklių 42.6 punkte:

Atskaitymai	Taisyklėse nustatyti maksimalūs dydžiai	Faktiškai taikomi atskaitymų dydžiai	Per ataskaitinį laikotarpį priskaičiuota atskaitymų suma, Lt	Per ataskaitinį laikotarpį sumokėtų atskaitymų suma, Lt
Nuo įmokų	2,00 proc.	2,00 proc.	534 381	534 381
Nuo turto vertės	1,00 proc.	1,00 proc.	539 931	520 161
Už keitimą:				
<i>fondo keitimas toje pačioje bendrovėje daugiau kaip kartą per metus</i>	0,20 proc.	0,20 proc.	-	-
<i>pensijų kaupimo bendrovės keitimas kartą per metus</i>	0,20 proc.	0,20 proc.	-	-
<i>pensijų kaupimo bendrovės keitimas daugiau kaip kartą per metus</i>	4,00 proc.	4,00 proc.	-	-
Iš viso			1 074 313	1 054 542
BAR *				-
Sąlyginis BIK ir (arba) tikėtinas sąlyginis BIK *				-
PAR (portfelio apyvartumo rodiklis)*				-

* Pateikti rodiklių paaiškinimus (rodiklius pateikti tik metų ataskaitoje).

Bendrasis išlaidų koeficientas (BIK) – procentinis dydis, kuris parodo, kokia vidutinė fondo grynųjų 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.

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

Tarpininko pavadinimas	Sumokėti mokesčiai Lt	Paslaugos pavadinimas	Ar susijęs su valdymo įmone
<i>Skandinaviska Enskilda Banken AB</i>	2 256	Komisinis mokestis už sandorius	Ne
Iš viso*	2 256		

* nurodyti mokesčiai nemažina pensijų fondo grynųjų aktyvų vertės. Valdymo įmonė perveda nurodytus mokesčius į fondo sąskaitą.

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).

-

IV. INFORMACIJA APIE PENSIJŲ FONDO INVESTICINIŲ PRIEMONIŲ PORTFELĮ

11. Ataskaitinio laikotarpio pabaigos investicinių priemonių portfelio sudėtis:

Emitento pavadinimas	Šalis	ISIN kodas	Kiekis, vnt.	Bendra nominali vertė	Bendra įsigijimo vertė	Bendra rinkos vertė	Rinka, pagal kurios duomenis nustatyta rinkos vertė (tinklalapio adresas)	Balsų dalis emitente, %	Dalis GA, %
Nuosavybės vertybiniai popieriai, įtraukti į Oficialųjį ar jį atitinkantį prekybos sąrašą									
Iš viso:									
Nuosavybės vertybiniai popieriai, įtraukti į Papildomąjį ar jį atitinkantį prekybos sąrašą									
Iš viso:									
Nuosavybės vertybiniai popieriai, kuriais prekiaujama kitose reguliuojamose rinkose									
Iš viso:									
Išleidžiami nauji nuosavybės vertybiniai popieriai									
Iš viso:									
Iš viso nuosavybės vertybinių popierių:									

Emitento pavadinimas	Šalis	ISIN kodas	Kiekis, vnt.	Bendra nominali vertė	Bendra įsigijimo vertė	Bendra rinkos vertė	Palūkanų norma	Išpirkimo / konvertavimo data	Dalis GA, %
Ne nuosavybės vertybiniai popieriai, įtraukti į Oficialųjį ar jį atitinkantį prekybos sąrašą									
Iš viso:									
Ne nuosavybės vertybiniai popieriai, įtraukti į Papildomąjį ar jį atitinkantį prekybos sąrašą									
Iš viso:									
Ne nuosavybės vertybiniai popieriai, kuriais prekiaujama kitose reguliuojamose rinkose									
Latvijos Respublika	LV	XS0138888689	266	1 305 608	988 645	948 232	5,14	2008.11.27	0,76
Slovakijos Respublika	SK	DE0001074763	200	690 560	784 894	728 537	5,02	2010.04.14	0,58
Slovėnijos Respublika	SI	XS0095561683	1 000	3 452 800	3 644 930	3 505 079	4,68	2009.03.18	2,81
Vengrijos Respublika	HU	XS0131593864	160	552 448	633 006	553 747	5,57	2011.06.27	0,44
Lenkijos Respublika	PL	XS0109070986	275	281 806	980 000	979 194	5,09	2010.03.22	0,78
Lenkijos Respublika	PL	XS0144238002	1 242	1 272 740	4 897 716	4 383 397	5,33	2012.03.12	3,51
Vengrijos Respublika	HU	XS0204418791	1 427	4 927 146	4 877 874	4 767 481	5,55	2011.10.28	3,82
Kipro Respublika	CY	XS0089349590	379	1 308 611	1 408 589	1 374 515	4,73	2008.07.28	1,10
Čekijos Respublika	CZ	XS0194957527	388	1 339 686	1 480 451	1 307 191	5,13	2014.06.23	1,05

Prancūzijos Respublika	FR	FR0010192997	2 170	7 492 576	6 820 952	6 730 574	4,91	2021.04.25	5,39
Nyderlandų Karalystė	NL	NL0000102283	3 745	12 930 736	13 109 028	12 779 686	4,77	2016.07.15	10,24
Prancūzijos Respublika	FR	FR0000571218	1 800	6 215 040	7 454 381	6 661 822	5,02	2029.04.25	5,34
Airijos Respublika	IE	IE0034074488	5 050	17 436 640	18 278 481	16 728 361	5,07	2020.04.18	13,40
Nyderlandų Karalystė	NL	NL0000102242	800	2 762 240	2 504 937	2 604 280	4,76	2015.07.15	2,09
Vokietijos Respublika	DE	DE0001137164	4 300	14 847 040	14 784 385	15 109 857	4,39	2008.12.12	12,11
Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	XS0327304001	630	630 000	2 158 950	2 093 995	5,63	2018.02.07	1,68
Slovakijos Respublika	SK	XS0299989813	2 500	8 632 000	8 379 082	8 188 257	5,20	2017.05.15	6,56
Latvijos Respublika	LV	XS0350977244	1 600	7 853 280	5 511 995	5 427 427	5,99	2018.03.05	4,35
Vokietijos Federacinė Respublika	DE	DE0001135135	2 000	6 905 600	7 197 960	7 156 282	4,67	2010.01.04	5,73
Slovėnijos Respublika	SI	XS0292653994	677	2 337 546	2 249 904	2 175 151	5,07	2018.03.22	1,74
Rumunijos Respublika	RO	XS0171638330	213	735 446	779 805	775 888	5,90	2010.07.02	0,62
Vengrijos Respublika	HU	XS0240732114	400	1 381 120	1 268 908	1 232 808	5,74	2016.07.18	0,99
Vengrijos Respublika	HU	XS0369470397	1 000	3 452 800	3 436 917	3 420 989	5,92	2018.06.11	2,74
Rumunijos Respublika	RO	XS0371163600	2 575	8 890 960	8 765 597	8 648 248	6,93	2018.06.18	6,93
Iš viso:			34 797	117 634 429	122 397 388	118 280 997			94,77
Išleidžiami nauji ne nuosavybės vertybiniai popieriai									
Iš viso:									
Iš viso ne nuosavybės vertybinių popierių:				117 634 429	122 397 388	118 280 997			94,77

KIS pavadinimas	Šalis	ISIN kodas	Kiekis, vnt.	Valdytojas	Bendra įsigijimo vertė	Bendra rinkos vertė	Rinkos vertės nustatymo šaltinis (tinklalapio adresas)	KIS tipas*	Dalis GA, %
Kolektyvinio investavimo subjektų įstatymo 61 str. 1 d. reikalavimus atitinkančių kolektyvinio investavimo subjektų (KIS) vienetai (akcijos)									
Iš viso:									
Kitų kolektyvinio investavimo subjektų vienetai (akcijos)									
Iš viso:									
Iš viso KIS vienetai (akcijų):									

* - nurodyti KIS tipą:

KIS 1 – KIS, kurių investavimo strategijoje numatyta iki 100 proc. grynujų 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. 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 fondų investavimo strategiją.

Emitento pavadinimas	Šalis	Priemonės pavadinimas	Kiekis, vnt.	Valiuta	Bendra rinkos vertė	Palūkanų norma	Galiojimo pabaigos data	Dalis GA, %
Pinigų rinkos priemonės, kuriomis prekiaujama reguliuojamose rinkose								
Iš viso:								
Kitos pinigų rinkos priemonės								
Iš viso:								
Iš viso pinigų rinkos priemonių:								

Kredito įstaigos pavadinimas	Šalis	Valiuta	Bendra rinkos vertė	Palūkanų norma	Indėlio termino pabaiga	Dalis GA, %
Indėliai kredito įstaigose						
Iš viso indėlių kredito įstaigose						

Priemonės pavadinimas	Emitentas	Šalis	Kita sandorio šalis	Va-liu-ta	Investicinis sandoris (pozicija)	Sandorio (pozicijos) vertė	Bendra rinkos vertė	Rinkos pavadinimas (tinklalapio adresas)	Galiojimo terminas	Dalis GA, %
Išvestinės finansinės priemonės, kuriomis prekiaujama reguliuojamose rinkose										
D5008306	EUREX	CH		EUR	EUREX BUND FUTURE_P1		3 625		2008.09.06	0
Iš viso:							3 625			0
Kitos išvestinės finansinės priemonės										
NDF6133	AB SEB bankas	LT	AB SEB bankas	LTL	FORW_P1_EUR		182 444		2008.12.18	0,15
NDF6359	AB SEB bankas	LT	AB SEB bankas	LTL	FORW_P1_EUR		- 39 065		2008.12.15	-0,03
NDF6366	AB SEB bankas	LT	AB SEB bankas	LTL	FORW_P1_EUR		- 18 109		2008.12.17	-0,01
Iš viso:							125 269			0,1
Iš viso išvestinės finansinės priemonės							128 895			0,1

Banko pavadinimas	Valiuta	Bendra rinkos vertė	Palūkanų norma	Dalis GA, %
Pinigai				
AB SEB bankas	LTL	4 314 291	3,99	3,46
AB SEB bankas	EUR	93 095	3,86	0,07
SEB London Futures	EUR	2 120 332		1,7
Iš viso pinigai:		6 527 718		5,23

Pavadinimas	Trumpas apibūdinimas	Bendra vertė	Paskirtis	Dalis GA, %
Kitos priemonės (aiškiai įvardyti), nenurodytos Kolektyvinio investavimo subjektų įstatymo 57 str. 1. d				
Iš viso:		124 937 610		



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.):

Investicijų pasiskirstymas	Ataskaitinio laikotarpio pabaigoje		Ataskaitinio laikotarpio pradžioje	
	Rinkos vertė, Lt	Dalis aktyvuose, %	Rinkos vertė, Lt	Dalis aktyvuose, %
Vyriausybių obligacijos	118 280 997	94,77%	101 096 628	98,49%
Įmonių obligacijos	-	-	-	-
Akcijos	-	-	-	-
KIS	-	-	-	-
Išvestinės priemonės	128 895	0,10%	856 625	0,83%
Grynieji pinigai ir pinigų rinkos priemonės	6 393 685	5,12%	697 585	0,68%
Iš viso	124 803 577	100,00%	102 650 837	100,00%
Pagal valiutas				
litais	4 303 193,81	3,45%	27 810	0%
eurais	120 500 383	96,55%	102 552 817	100%
kita valiuta	-	-	-	-
Iš viso	124 803 576,78	100%	102 580 628	100%
Pagal geografinę zoną				
Lietuva	6 492 617,27	5,20%	2 892 412	3%
kitos Europos Sąjungos valstybės	118 307 334	94,79%	98 851 982	96%
kitos Europos ekonominės erdvės valstybės (Islandija, Norvegija, Lichtenšteinas)	-	-	-	-
Jungtinės Amerikos Valstijos ir Kanada	-	-	-	-
Japonija	-	-	-	-
kitos šalys	3 625	0%	836 234	0
Iš viso:	124 803 576,78	100%	102 580 628	100%
Pagal kredito reitingą				
AAA	67 770 862	54%	73 028 883	71%
AA+	-	-	-	-
AA	5 680 230	5%	3 603 567	4%
AA-	1 374 515	1%	1 344 429	1%
A+	2 035 728	2%	2 860 556	3%
A	31 995 526	26%	20 259 193	20%
BBB	775 888	1%	-	-
Nereitinguojami	8 648 248	7%	-	-
Iš viso	118 280 997	95%	101 096 628	98%
Pagal regionus				
Vidurio ir Rytų Europa	49 135 620	39%	26 015 362	25%
Vakarų Europa	69 145 377	55%	75 081 266	73%
Iš viso:	118 280 997	95%	101 096 628	98%
Pagal laiką iki išpirkimo				
Iki 3 mėn.	1 374 515	1%	2 052 383	2%
Nuo 3 mėn. iki 2 m.	28 427 181	23%	21 159 934	21%
Nuo 2 m. iki 4 m.	10 480 512	8%	6 827 801	7%
Nuo 4 m. iki 7 m.	1 307 191	1%	1 381 293	1%
Nuo 7 m. iki 10 m.	46 570 840	37%	30 212 549	29%
Daugiau 10 m.	30 120 757	24%	39 462 668	38%

13. 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 reguliuojamosiose rinkose ir šalių tarpusavio sandorius bei kitą svarbią informaciją).

Priemonės pavadinimas	Priemonės rūšis	Išpirkimo data	Pelnas/nuostolis valiuta	Valiutos kodas	Priemonės panaudojimo tikslas	Pastabos
EUREX BUND FUTURE	Ateities sandoris (angl. <i>future</i>)	2008 01 09	2641,75	EUR	Obligacijų rizikos valdymas	Reguliuojamų rinkų IP
EUREX BUND FUTURE	Ateities sandoris (angl. <i>future</i>)	2008 03 04	-222 130	EUR	Obligacijų rizikos valdymas	Reguliuojamų rinkų IP
EUREX BUND FUTURE	Ateities sandoris (angl. <i>future</i>)	2008 04 18	47 986	EUR	Obligacijų rizikos valdymas	Reguliuojamų rinkų IP
EUREX BUND FUTURE	Ateities sandoris (angl. <i>future</i>)	2008 05 23	206 924	EUR	Obligacijų rizikos valdymas	Reguliuojamų rinkų IP
EUREX BUND FUTURE	Ateities sandoris (angl. <i>future</i>)	2008 05 29	211 492	EUR	Obligacijų rizikos valdymas	Reguliuojamų rinkų IP
EUREX BUND FUTURE	Ateities sandoris (angl. <i>future</i>)	2008 06 04	228	EUR	Obligacijų rizikos valdymas	Reguliuojamų rinkų IP
-	Išankstinis sandoris (angl. <i>forward</i>)	-	48 149	LTL	Valiutos draudimas	Kitos nei reguliuojamų rinkų IP
-	Išankstinis sandoris (angl. <i>forward</i>)	-	151 391	LTL	Valiutos draudimas	Kitos nei reguliuojamų rinkų IP
-	Išankstinis sandoris (angl. <i>forward</i>)	-	115 889	LTL	Valiutos draudimas	Kitos nei 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.

Ataskaitiniu laikotarpiu fondas naudojo:

-obligacijų ateities (*bond futures*)

-valiutos kurso išankstinius sandorius (*forwards*)

Išvestinėms finansinėms priemonėms būdingas didelis svertas (*leverage*): net ir nereikšmingai pakitus bazinės priemonės vertei, išvestinės finansinės priemonės vertė kinta daugiau. Todėl naudojant išvestines finansines priemones ne rizikos draudimo tikslais fondo vieneto vertės svyravimai sustiprėja: yra galimybė tiek uždirbti didesnę investicinę gražą, tiek ir patirti ženklus nuostolius.

Naudojant ne biržoje prekiaujamas išvestines finansines priemones (pvz. išankstinius sandorius) yra prisiimama kitos sandorio šalies arba emitento kredito rizika. Tai rizika, kad esant teigiamam išvestinės finansinės priemonės kainos pokyčiui, kita sandorio šalis ar emitentas nevykdys fondo atžvilgiu prisiimtų finansinių įsipareigojimų. Apskaičiuojant fondui nustatytus investavimo į vieną emitentą apribojimus, yra atsižvelgiama ir į turimas išvestinių finansinių priemonių pozicijas.

Palūkanų normų rizikai valdyti buvo sudaromi tik ateities sandoriai, kurių bazinė priemonė yra Vokietijos vyriausybės obligacijos eurais. Sudarant šiuos sandorius, yra keičiama bendra fondo palūkanų normų rizika (obligacijų rinkos rizika). Tokių išvestinių priemonių rizika yra įvertinama pagal tai, kiek jie prisideda mažinant arba didinant fondo finansinę trukmę (fondo vertės jautrumas rinkos palūkanų normai). Siekdama valdyti šią riziką, valdymo įmonė riboja fondo investicijų į skolos VP vidutinę finansinę trukmę nuo 3 iki 9 metų.

Ataskaitinių laikotarpiu sudaryti išvestinių investicinių priemonių sandoriai buvo naudojami bendros fondo palūkanų normos rizikos valdymo tikslais. Palūkanų normų rizika buvo keičiama įgyvendinant valdytojo investavimo sprendimus. Tokiu būdu ženkliai sutrumpėjo laikas nuo sprendimo priėmimo iki jo įgyvendinimo, gerokai sumažėjo įgyvendinimo kaštai. Taip pat sumažėjo sandorių kiekis bei operacinė rizika (klaidų tikimybė).

Išankstiniai valiutos kurso sandoriai buvo naudojami rizikai valdyti. Taikant išvestines finansines priemones valiutos kursų rizikos draudimo tikslais yra siekiama, kad fondo investicijų pigimas (brangimas) dėl valiutos kursų pokyčių būtų pilnai ar iš dalies kompensuojamas išvestinių finansinių priemonių brangimu (pigimu). Taip pašalinami ar sumažinami fondo investicijų ir fondo vieneto vertės svyravimai dėl valiutos kurso pokyčių. Dauguma fondo

investicinių pozicijų yra denominuotos eurai. Įsigydamas tokias investicines pozicijas fondas prisiima lito revalvavimo/devalvavimo riziką. Šios rizikos draudimo tikslais ataskaitiniu laikotarpiu naudoti EUR/LTL išankstiniai sandoriai.

15. Iš išvestinių finansinių priemonių sandorių kylančių įsipareigojimų bendra vertė ataskaitinio laikotarpio pabaigoje (atskirai nurodyti sumas pagal skirtingas įsigytų išvestinių finansinių priemonių kategorijas).

-

16. 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.

17. 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 rinkos palūkanų (eurais ir litais) normos pokyčiai.

Ataskaitinis laikotarpis vyriausybės obligacijoms buvo nepalankus. Nors jų pajamingumas (t.y. ateities grąža) didėjo, pusmečio bėgyje šių investicijų vertė kiek sumažėjo. Palūkanų kilimą sąlygojo infliacijos grėsmė ir Europos centrinio banko veiksmai.

V. PENSIJŲ FONDO INVESTICIJŲ GRAŽA IR RIZIKOS RODIKLIAI

-

VI. PENSIJŲ FONDO FINANSINĖ BŪKLĖ

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

23.1. paskutinių 3 finansinių metų balansus, išdėstytus palyginamojoje lentelėje;

BALANSAS (LT)

2008 m. birželio 30 d.

Eil. nr.	Turtas	Pastabų Nr.	2008 06 30	2007 12 31	2006 12 31
I.	PINIGAI IR PINIGŲ EKVIVALENTAI	2	6 527 718	749 445	71 118
II.	TERMINUOTIEJI INDĖLIAI		-	-	-
III.	INVESTICIJOS	1,2	118 280 998	101 096 628	64 002 343
1	Skolos vertybiniai popieriai		118 280 998	101 096 628	64 002 343
1.1.	Vyriausybės ir centrinių bankų arba jų garantuoti skolos vertybiniai popieriai		118 280 998	101 096 628	64 002 343
1.2.	Kiti skolos vertybiniai popieriai		-	-	-
2	Nuosavybės vertybiniai popieriai		-	-	-
3	Kolektyvinio investavimo subjektų investiciniai vienetai ir akcijos		-	-	-
4	Kitos investicijos		-	-	-
IV.	PRETENZIJS DĖL IŠVESTINIŲ FINANSINIŲ PRIEMONIŲ	2	186 069	906 374	-
V.	GAUTINOS SUMOS	2	22 674	19 429	-
1	Investicijų pardavimo sandorių gautinos sumos		-	-	-
2	Kitos gautinos sumos		22 674	19 429	-
	IŠ VISO TURTO		125 017 459	102 771 876	64 073 461

Eil. nr.	Įsipareigojimai ir grynieji aktyvai		2008 06 30	2007 12 31	2006 12 31
VI.	ĮSIPAREIGOJIMAI		156 708	89 500	57 158
1	Investicijų pirkimo įsipareigojimai		-	-	-
2	Mokėtinos sumos kaupimo bendrovei ir depozitoriumui		95 160	75 390	45 468
3	Kitos mokėtinos sumos ir įsipareigojimai		61 548	14 110	11 690
VII.	ĮSIPAREIGOJIMAI DĖL IŠVESTINIŲ FINANSINIŲ PRIEMONIŲ		57 174	30 958	-
VIII.	GRYNIJAI AKTYVAI (I+II+III+IV+V-VI-VII)		124 803 577	102 651 418	64 016 303
	IŠ VISO ĮSIPAREIGOJIMŲ IR GRYNŲJŲ AKTYVŲ		125 017 459	102 771 876	64 073 461

11 – 17 puslapiuose pateiktas aiškinamasis raštas yra neatskiriama šios finansinės atskaitomybės dalis

23.2. paskutinių 3 finansinių metų grynujų aktyvų pokyčių ataskaitas, išdėstytas palyginamojoje lentelėje;

GRYNUJŲ AKTYVŲ POKYČIŲ ATASKAITA (LT)

2008 m. birželio 30 d.

Eil. nr.	Straipsniai	Pastabų Nr.	2008 01 01-2008 06 30	2007 01 01-2007 06 30	2006 01 01-2006 06 30
I.	GRYNIEJI AKTYVAI ATASKAITINIO LAIKOTARPIO PRADŽIOJE		102 651 418	64 016 303	31 879 446
II.	PADIDĖJIMAS, IŠ VISO		35 595 146	29 822 212	18 309 026
1	Pensijų įmokos		26 718 248	21 632 884	15 118 954
2	Iš kitų pensijų fondų pervestos sumos		391 603	74 463	8 462
3	Kaupimo bendrovės garantinės įmokos		0	-	-
4	Palūkanos ir dividendai		2 366 088	1 333 723	1 021 998
5	Investicijų pardavimo pelnas		857 902	234 003	80 747
6	Investicijų vertės padidėjimo suma		2 461 774	3 232 621	2 078 865
7	Turto vertės padidėjimas dėl užsienio valiutų kursų pasikeitimo		-	-	-
8	Kitos pajamos	3	2 799 531	3 314 518	-
III.	SUMAŽĖJIMAS, IŠ VISO		13 442 987	14 543 056	4 826 629
1	Pensijų išmokos		409 705	165 725	48 023
2	Į kitus pensijų fondus pervestos sumos		3 401 063	4 604 516	820 566
3	Investicijų pardavimo nuostoliai		1 567 439	947 384	8 208
4	Investicijų vertės sumažėjimo suma		5 411 910	6 305 990	3 472 049
5	Turto vertės sumažėjimas dėl užsienio valiutų kursų pasikeitimo		-	-	-
6	Valdymo sąnaudos	4	1 074 313	765 355	477 783
7	Kitos sąnaudos	5	1 578 557	1 754 086	-
IV.	GRYNIEJI AKTYVAI ATASKAITINIO LAIKOTARPIO PABAIGOJE		124 803 577	79 295 459	45 361 843

		2008 01 01-2008 06 30	2007 01 01-2007 06 30	2006 01 01-2006 06 30
V.	APSKAITOS VIENETO VERTĖ	1,0510	1,0320	1,0317
VI.	APSKAITOS VIENETŲ SKAIČIUS	118 746 859	76 838 634	43 968 423

11 – 17 puslapiuose pateiktas aiškinamasis raštas yra neatskiriama šios finansinės atskaitomybės dalis.

23.3. aiškinamąjį raštą (pateikiamas tik metų ir pusmečio ataskaitose).

AIŠKINAMASIS RAŠTAS

Bendroji informacija

Valstybinio socialinio draudimo įmokos dalies kaupimo konservatyvaus investavimo pensijų fondo SEB pensija 1 (toliau - Fondas) taisyklės Nr. PF-V01-K001-001(001) patvirtino Lietuvos Respublikos vertybinių popierių komisija 2003 m. rugpjūčio 28 d. 2006 m. vasario 23 d. Pensijų fondo pavadinimas pakeistas į SEB Pensija 1.

Pensijų fondą SEB pensija 1 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. VĮK – 001.

Pensijų fondo SEB pensija 1 depozitoriumas yra AB SEB bankas, įmonės kodas 112021238, esantis adresu Gedimino pr. 12, LT-03111 Vilnius, veikiantis pagal Lietuvos banko išduotą licenciją Nr. 2.

Fondo auditą atlieka UAB PricewaterhouseCoopers, įmonės kodas 111473315, buveinės adresas J.Jasinskio g. 16B, LT-01112 Vilnius, veikianti pagal 2005 m. gruodžio 20 d. Lietuvos auditorių rūmų pažymėjimą Nr.001273.

Apskaitos principai

Finansinė atskaitomybė parengta vadovaujantis Lietuvos Respublikos buhalterinės apskaitos įstatymu, bendraisiais apskaitos principais, nustatytais Verslo apskaitos standartuose, pensijų fondų buhalterinės apskaitos ir finansinės atskaitomybės tvarka ir kitais teisės aktais.

Pateikiama finansinė atskaitomybė yra ketvirtųjų veiklos metų finansinė atskaitomybė. Fondas pirmąsias įmokas ir pajamas gavo 2004 m. birželio 15 d.

Finansinė atskaitomybė parengta 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 šioje finansinėje atskaitomybėje pateiktos Lietuvos Respublikos nacionaline valiuta – litais (Lt).

Toliau yra išdėstyti svarbiausi apskaitos principai, kuriais buvo vadovautasi rengiant šią finansinę atskaitomybę:

(a) Investavimo politika

Fondo lėšos investuojamos į Lietuvos Respublikos, Europos Sąjungos, Ekonominio bendradarbiavimo ir plėtros organizacijos valstybių vyriausybių, centrinių bankų arba Europos centrinio banko išleistus ar jų garantuotus skolos vertybinius popierius. Tokių investicijų rizika yra nedidelė.

Iki 10 procentų Fondo turto gali būti saugoma pinigais banko sąskaitoje.

Fondo investicijos gali būti įvairiomis užsienio valiutomis.

(b) Finansinės rizikos valdymo politika

Su Fondo investicijomis yra susijusi ši rizika:

1. **palūkanų normų rizika.** Taisyklėse numatyti investavimo objektai, kaip ir daugelis skolos VP, susiję su rizika, kad VP vertė gali sumažėti dėl pasikeitusių palūkanų normų, t. y. investicijų vertė mažėja didėjant palūkanų normoms, ir atvirkščiai, investicijų vertė didėja, kai palūkanų normos mažėja. Valdant 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 dėl didėjančių palūkanų normų, naujo priežiūros institucijų nustatyto reglamentavimo, nepalankių 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. Valdant 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 išgytų VP kaina gali skirtis nuo prognozuotos kainos. Bendrovė valdo VP pasirinkimo riziką laikydama 9 straipsnyje nustatytą fondo investicijų portfelio diversifikavimo reikalavimą;
4. **valiutų kursų svyravimų rizika.** Jei investuojama į VP užsienio valiuta, tai, keičiantis valiutos, kuria investuota, kursui lito 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 taikomomis rizikos valdymo priemonėmis sieks išvengti didelio fondo grynųjų aktyvų ir apskaitos vieneto vertės svyravimo, todėl dalyviams išlieka laikino sąskaitose kaupiamo turto dalinio sumažėjimo rizika .

(c) Turto padidėjimo ir sumažėjimo pripažinimo principai

Pinigų ir pinigų ekvivalentų padidėjimas pripažįstamas fiksuojant pinigų padidėjimą banko sąskaitoje bei pinigų ekvivalentų įsigijimą. Atitinkamai pripažįstamas šios sąskaitos sumažėjimas.

Vertybinių popierių padidėjimas pripažįstamas įsigyjant vertybinius popierius, jei sumokėta iš anksto – sumokėto avanso dalimi bei padidėjus vertybinių popierių vertei. Atitinkamai vertybinių popierių sumažėjimas pripažįstamas juos pardavus, emitentui išpirkus skolos vertybinius popierius, sumažėjus vertybinių popierių vertei. Vertybinių popierių pripažinimo momentas yra perkamo turto gavimo arba parduodamo turto perleidimo diena.

Išvestinės finansinės priemonės yra atvaizduojamos kaip turtas, jeigu tikroji vertė yra teigiama, arba kaip įsipareigojimas, jeigu tikroji vertė neigiama. Išvestinių finansinių priemonių vertės padidėjimas yra traukiamas į kitas pajamas, o vertės sumažėjimas į kitas sąnaudas.

Gautinų sumų padidėjimas fiksuojamas sumokant avansus. Šio straipsnio padidėjimas ar sumažėjimas fiksuojamas, jei atsiskaitoma užsienio valiuta dėl oficialaus lito ir Lietuvos banko skelbiamo lito ir užsienio valiutos santykio pasikeitimo. Sumažėjimas pripažįstamas gavus prekes ar paslaugas arba nebesitikint atgauti sumokėtų sumų.

(d) Atskaitymų valdymo įmonei ir depozitoriumui taisyklės

Iš pensijų fondo turto galima daryti tik tokius atskaitymus, kurie yra susiję su Fondo valdymu ir yra nustatyti Fondo taisyklėse. Visos kitos taisyklėse nenumatytos arba nustatytus dydžius viršijančios išlaidos dengiamos iš valdymo įmonės.

Atskaitymai iš pensijų fondo turto pagal kiekvieną pensijų kaupimo sutartį su Bendrove per metus yra:

1. **turto valdymo mokestis** - iki 1(vieno) procento per metus nuo dalyvio pensijų sąskaitoje apskaičiuotų lėšų vidutinės metinės vertės;
2. **įmokos mokestis** - iki 2 (dviejų) procentų dalyvio vardu įmokėtų įmokų.

2007 m. taikomi atitinkamai 1 ir 2 procentų dydžio mokesčiai.

Turto valdymo mokestis apskaičiuojamas kiekvieną dieną nuo grynosios pensijų fondo turto vertės.

Valdymo, įmokos mokestis bei taisyklėse numatytos su asmens pritraukimu bei dalyvio perėjimu į kitą fondą susijusios išlaidos mokamos iš pensijų fondo turto.

Atskaitymai depozitoriumui mokami iš valdymo įmonės.

Dalyviui pereinant į kitą Bendrovės valdomą fondą dažniau nei vieną kartą per kalendorinius metus, Bendrovė iš pervedamų lėšų gali išskaityti išlaidas, susijusias su pensijų sąskaitos uždarymu bei lėšų pervedimu, bet ne daugiau nei 0,2 proc. pervedamų lėšų.

Dalyviui pereinant į kitos pensijų kaupimo bendrovės valdomą fondą vieną kartą per kalendorinius metus, Bendrovė iš pervedamų lėšų gali išskaityti išlaidas, susijusias su pensijų sąskaitos uždarymu bei lėšų pervedimu, bet ne daugiau nei 0,2 proc. pervedamų lėšų. Keičiant fondą dažniau nei vieną kartą per kalendorinius metus Bendrovė iš pervedamų lėšų išskaito išlaidas, susijusias su dalyvio pritraukimu, pensijų sąskaitos uždarymu bei lėšų pervedimu, bet ne daugiau nei 4 proc. pervedamų lėšų.

Visi atskaitymai valdymo įmonei vyksta kaupimo principu.

(e) Investicijų įvertinimo metodai, investicijų pervaldinimo periodiškumas

Investicijos į balansą įtraukiamos pagal ataskaitinio laikotarpio pabaigos tikrąją vertę.

Finansinių priemonių, kuriomis prekiaujama reguliuojamose rinkose, tikroji vertė nustatoma pagal rinkos viešai paskelbtą vertinimo dieną vidutinę rinkos kainą. Jei reguliuojamoje rinkoje vidutinė rinkos kaina nenustatoma ar neskelbiama, naudojama sesijos pabaigoje skelbiama uždarymo kaina. Jei finansinės priemonės kotiruojamos keliose reguliuojamose rinkose, jų tikrajai vertei nustatyti yra naudojama tos reguliuojamos rinkos, kurioje prekyba šiomis finansinėmis priemonėmis pasižymi didesniu likvidumu, reguliarumu ir dažnumu, duomenys arba rinkos, kurioje yra emitento buveinė, duomenys. Jei finansinė priemonė nebuvo kotiruojama per paskutinę prekybos sesiją, tikrajai vertei nustatyti naudojama paskutinė žinoma, bet ne vėlesnė nei 30 dienų, vidutinė rinkos kaina arba uždarymo kaina. Jei priemonė nebuvo kotiruojama daugiau nei 30 dienų ar kotiruojama rečiau nei nustatyta apskaičiavimo procedūrose, jos vertė nustatoma kaip priemonių, kuriomis reguliuojamose rinkose neprekiuojama.

Jei gali būti gaunamas tikslesnis įvertinimas, tikroji vertė nustatoma remiantis pirminių dilerių (AB SEB banko, AB DnB NOR banko ir AB Hansabankas) skelbiamais pelningumų vidurkiais, atsižvelgiant į analogiškos trukmės, reitingo ir panašių išleidimo sąlygų vertybinių popierių vertę, pagal tikėtiną pardavimo kainą, naudojantis tarptautinių naujienų agentūrų, informacijos šaltinių teikiamais pelningumo duomenimis ir kainomis.

Investicijos vertinamos kiekvieną dieną. Vertybinių popierių ir kitų investicijų, turėtų ataskaitinio laikotarpio pradžioje, taip pat per ataskaitinį laikotarpį įsigytų vertybinių popierių ir kitų investicijų kiekvienos dienos vertės pasikeitimo rezultatas priskiriamas investicijų vertės padidėjimui arba sumažėjimui. Pardavus investicijas, skirtumas tarp jų tikrosios vertės ir pardavimo kainos parodomas „grynųjų aktyvų pokyčio ataskaitoje“ kaip „investicijų pardavimo pelnas“ arba „investicijų pardavimo nuostolis“.

Skolos vertybinių popierių tikroji vertė apima ir palūkanų pajamas.

Terminuotieji indėliai bankuose vertinami amortizuota savikaina. Palūkanų pajamos pripažįstamos remiantis kaupimo principu ir įtraukiamos į palūkanų pajamas.

Grynieji pinigai ir lėšos kredito įstaigose vertinami nominalia verte.

(f) Išvestinės finansinės priemonės

Iš išvestinės finansinės priemonės atsirandanti finansinė turtą ir finansinį įsipareigojimą Bendrovė registruoja apskaitoje, kai pagal sutartį įgyja teisę gauti turtą arba prievolę vykdyti įsipareigojimą. Iš išvestinės finansinės priemonės atsirandantis finansinis turtas ir finansinis įsipareigojimas pirmą kartą apskaitoje registruojamas įsigijimo savikaina. Registruojant apskaitoje ir kiekvieno balanso datą iš išvestinės finansinės priemonės atsirandantis finansinis turtas ir finansinis įsipareigojimas vertinami ir pateikiami finansinėse ataskaitose tikrąja verte. Kiekvienos dienos tikrosios vertės pasikeitimas, nustatytas vertinant iš išvestinės finansinės priemonės atsirandanti finansinį turtą ir finansinį įsipareigojimą, parodomas „grynųjų aktyvų pokyčio ataskaitoje“ kaip „kitos pajamos“ arba „kitos sąnaudos“. Pasibaigus iš išvestinės finansinės priemonės kylančioms teisėms ir įsipareigojimams, apskaitoje yra registruojamas gautas (gautinas) ar sumokėtas (mokėtinas) atlygis.

2006 metų balanse pretenzijos dėl išvestinių finansinių priemonių buvo klasifikuojamos kaip investicijos, o įsipareigojimai dėl išvestinių finansinių priemonių – kaip mokėtinos sumos. Siekiant aiškiau atvaizduoti fondo turto ir įsipareigojimų struktūrą, 2007 metais išvestinės finansinės priemonės balanse buvo išskirtos į atskirą straipsnį ir atitinkamai perklasifikuoti palyginamieji skaičiai.

(g) Apskaitos vieneto vertės nustatymo taisyklės

Fondas turi savo apskaitos vienetus. Fondo apskaitos vienetai išreiškia dalyviui priklausančią pensijų fondo turto dalį.

Fondo apskaitos vienetai (jų dalys) neturi nominaliosios vertės.

Apskaitos vieneto (jo dalies) vertė išreiškiama Lietuvos Respublikos valiuta – litais. Pradinė apskaitos vieneto vertė lygi 1 litui.

Kiekvieno apskaitos vieneto vertė nustatoma padalijus Fondo grynųjų aktyvų vertę iš bendro Fondo apskaitos vienetų skaičiaus jos skaičiavimo dieną. Bendra visų Fondo apskaitos vienetų vertė visada yra lygi Fondo grynųjų aktyvų

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

Fondo grynujų aktyvų ir apskaitos vienetų vertė nustatoma pagal paskutinius turimus Fondo turto rinkos kainų duomenis.

(h) 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.

(i) Investicijų portfelio struktūra

Į vieno emitento (EBPO valstybės narės vyriausybės ir centrinio banko bei Europos centrinio banko) vertybinius popierius investuojama ne daugiau kaip 5 procentai pensijų fondo turta sudarančių grynujų aktyvų. Į vieno emitento vertybinius popierius gali būti investuojama daugiau kaip 5 procentai, bet ne daugiau kaip 10 procentų grynujų aktyvų, su sąlyga, kad tokių investicijų bendra suma nebus didesnė kaip 40 procentų Fondo grynujų aktyvų.

Investicijos į Lietuvos Respublikos, EBPO valstybių narių, Europos Sąjungos valstybių vyriausybių, centrinių bankų ir Europos centrinio banko išleistus ar jų garantuotus vieno emitento vertybinius popierius gali sudaryti iki 100 procentų pensijų fondo turta sudarančių grynujų aktyvų, su sąlyga, kad dalyvių interesai bus pakankamai apsaugoti, ir:

1. Fondo turtas investuojamas į ne mažiau kaip 6 emisijų vertybinius popierius;
2. į vienos emisijos vertybinius popierius investuoja ne daugiau kaip 30 procentų fondo grynujų aktyvų.

Pastarieji vertybiniai popieriai nėra įskaitomi skaičiuojant investicijas, kurioms taikoma didžiausia leistina 40 procentų riba.

1 PASTABA

INVESTICIJŲ VERTĖS POKYTIS

(Lt)

Balanso straipsniai	Pokytis					
	praėjusio ataskaitinio laikotarpio pabaigoje	įsigyta	parduota (išpirkta)	vertės padidėjimas	vertės sumažėjimas	ataskaitinio laikotarpio pabaigoje
vyriausybių ir centrinių bankų arba jų garantuoti skolos vertybiniai popieriai	101 096 628	32 614 172	(12 657 945)	19 447 315	(22 219 173)	118 280 997
Iš viso	101 096 628	32 614 172	(12 657 945)	19 447 315	(22 219 173)	118 280 997

2 PASTABA

TURTO STRUKTŪRA ATASKAITINIO LAIKOTARPIO PABAIGOJE

Turto arba emitento pavadinimas	Valstybės, į kurios vertybinius popierius investuota, pavadinimas	Valiutos, kuria denominuotas turtas, pavadinimas	Nominali vertė (jeigu ji yra)	Metinė palūkanų norma (jeigu ji yra)	Indėlio, investicijos pabaigos terminas (jeigu ji terminuota)	Tikroji vertė (Lt)	Turto, investicijos lyginamoji dalis (procentais)
Pinigai						6 527 718	5,22
Sąskaita EUR AB SEB banke	-	EUR	26 962	3,86	-	93 095	0,07
Sąskaita LTL AB SEB banke	-	LTL	4 314 291	3,99	-	4 314 291	3,45
SEB London Futures	-	EUR	614 090	-	-	2 120 332	1,70
Investicijos						118 280 998	94,61
Kipro Respublika	Kipras	EUR	379 000	5,375	2008.07.28	1 374 515	1,10
Čekijos Respublika	Čekija	EUR	388 000	4,625	2014.06.23	1 307 191	1,05
Prancūzijos Respublika	Prancūzija	EUR	2 170 000	3,75	2021.04.25	6 730 574	5,38
Prancūzijos Respublika	Prancūzija	EUR	1 800 000	5,5	2029.04.25	6 661 822	5,33
Vokietijos Respublika	Vokietija	EUR	4 300 000	3,75	2008.12.12	15 109 857	12,09
Vokietijos Federacinė Respublika	Vokietija	EUR	2 000 000	5,375	2010.01.04	7 156 282	5,72
Vengrijos Respublika	Vengrija	EUR	400 000	3,5	2016.07.18	1 232 808	0,99
Vengrijos Respublika	Vengrija	EUR	1 427 000	3,625	2011.10.28	4 767 481	3,81
Vengrijos Respublika	Vengrija	EUR	160 000	5,625	2011.06.27	553 747	0,44
Vengrijos Respublika	Vengrija	EUR	1 000 000	5,75	2018.06.11	3 420 989	2,74
Airijos Respublika	Airija	EUR	5 050 000	4,5	2020.04.18	16 728 361	13,38
Latvijos Respublika	Latvija	EUR	266 000	5,375	2008.11.27	948 232	0,76
Latvijos Respublika	Latvija	EUR	1 600 000	5,50	2018.03.05	5 427 427	4,34
Lietuvos Respublikos Vyriausybė	Lietuva	EUR	630 000	4,85	2018.02.07	2 093 995	1,67
Nyderlandų Karalystė	Nyderlandų Karalystė	EUR	3 745 000	4,00	2016.07.15	12 779 686	10,22
Nyderlandų	Nyderlandų	EUR	800 000	3,25	2015.07.15	2 604 280	2,08

Karalystė	Karalystė						
Lenkijos Respublika	Lenkija	EUR	1 242 000	5,50	2012.03.12	4 383 397	3,51
Lenkijos Respublika	Lenkija	EUR	1 200 000	5,625	2018.06.20	0	0,00
Lenkijos Respublika	Lenkija	EUR	275 000	6	2010.03.22	979 194	0,78
Rumunijos Respublika	Rumunija	EUR	213 000	5,75	2010.07.02	775 888	0,62
Rumunijos Respublika	Rumunija	EUR	2 575 000	6,50	2018.06.18	8 648 248	6,92
Slovakijos Respublika	Slovakija	EUR	200 000	7,375	2010.04.14	728 537	0,58
Slovakijos Respublika	Slovakija	EUR	2 500 000	4,375	2017.05.15	8 188 257	6,55
Slovėnijos Respublika	Slovėnija	EUR	677 000	4,00	2018.03.22	2 175 151	1,74
Slovėnijos Respublika	Slovėnija	EUR	1 000 000	4,875	2009.03.18	3 505 079	2,80
Pretenzijos dėl išvestinių finansinių priemonių	-	-	-	-	-	186 069	0,15
FORW_P1_EUR, AB SEB bankas	-	-	-	-	2008.12.18	182 444	0,15
EUREX BUND FUTURE_P1	-	-	-	-	2008.09.06	3 625	0,00
	-	-	-	-			0,00
Kitos gautinos sumos	-	LTL	-	-	-	22 674	0,02
Iš viso	-	-	-	-	-	125 017 459	100,00

3 PASTABA KITOS PAJAMOS

(Lt)

Straipsnis	2008 01 01-2008 06 30	2007 01 01-2007 06 30
Kitos pajamos	4 744	
Išvestinių finansinių priemonių pajamos	2 794 787	3 314 518
Iš viso	2 799 531	3 314 518

4 PASTABA VALDYMO SĄNAUDOS

(Lt)

Straipsnis	2008 01 01-2008 06 30	2007 01 01-2007 06 30
Turto valdymo mokestis	539 932	332 681
Pardavimo mokestis	534 381	432 674
Iš viso	1 074 313	765 355

5 PASTABA KITOS SĄNAUDOS

(Lt)

Straipsnis	2008 01 01-2008 06 30	2007 01 01-2007 06 30
Kitos sąnaudos	4 745	
Išvestinių finansinių priemonių sąnaudos	1 573 812	1 754 086
Iš viso	1 578 557	1 754 086

VII. INFORMACIJA APIE PENSIJŲ FONDO DALYVIUS

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

-

26. Per ataskaitinį laikotarpį prisijungusių dalyvių skaičius:

-

27. Per ataskaitinį laikotarpį pasitraukusių dalyvių skaičius:

-

28. Pensijų fondo dalyvių struktūra:

28.1. pagal amžių ir lytį ataskaitinio laikotarpio pabaigoje

-

VIII. IŠORINIAI PINIGŲ SRAUTAI

28. Per ataskaitinį laikotarpį faktiškai gautos lėšos:

Bendra gautų lėšų suma		27 109 851
Periodinės įmokos į pensijų fondą	iš Valstybinio socialinio draudimo fondo	26 718 248
	pačio dalyvio įmokėtos lėšos (pildoma tik papildomo savanoriško pensijų kaupimo pensijų fondo atveju)	-
	darbdavių ir kitų trečiųjų asmenų įmokėtos lėšos (pildoma tik papildomo savanoriško pensijų kaupimo pensijų fondo atveju)	-
Valstybinio socialinio draudimo fondo sumokėti delspinigiai		
Iš garantijų rezervo sumokėtos lėšos		
Iš kitų pensijų fondų pervestos lėšos	iš tos pačios pensijų kaupimo bendrovės	307 672
	iš kitos pensijų kaupimo bendrovės	83 930
Kitos gautos lėšos (nurodyti šaltinį ir gautų lėšų sumą), iš viso		

29. Išmokėtos lėšos:

Bendra išmokėtų lėšų suma		3 810 768
Pensijų išmokos	vienkartinės išmokos dalyviams	339 360
	periodinės išmokos dalyviams	
	išmokos anuiteto įsigijimui	
Į kitus pensijų fondus pervestos lėšos	valdomus tos pačios pensijų kaupimo bendrovės	339 360
	valdomus kitos pensijų kaupimo bendrovės	414 129
Išstojusiesiems dalyviams išmokėtos lėšos (pildoma tik papildomo savanoriško kaupimo pensijų fondų atveju)		-
Paveldėtojams išmokėtos lėšos		70 344
Iš viso kitais pagrindais išmokėtų lėšų (nurodyti šaltinį ir išmokėtų lėšų sumą)		

IX. INFORMACIJA APIE GARANTIJŲ REZERVĄ

30. Jei pensijų fondo taisyklėse nustatytas įsipareigojimas garantuoti tam tikrą pelningumą, nurodyti garantuojamo pajamingumo dydį, per ataskaitinį laikotarpį į garantinį rezervą įmokėtų įmokų sumą, pateikti jo investicijų 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

31. Pensijų fondo reikmėms pasiskolintos lėšos ataskaitinio laikotarpio pabaigoje:

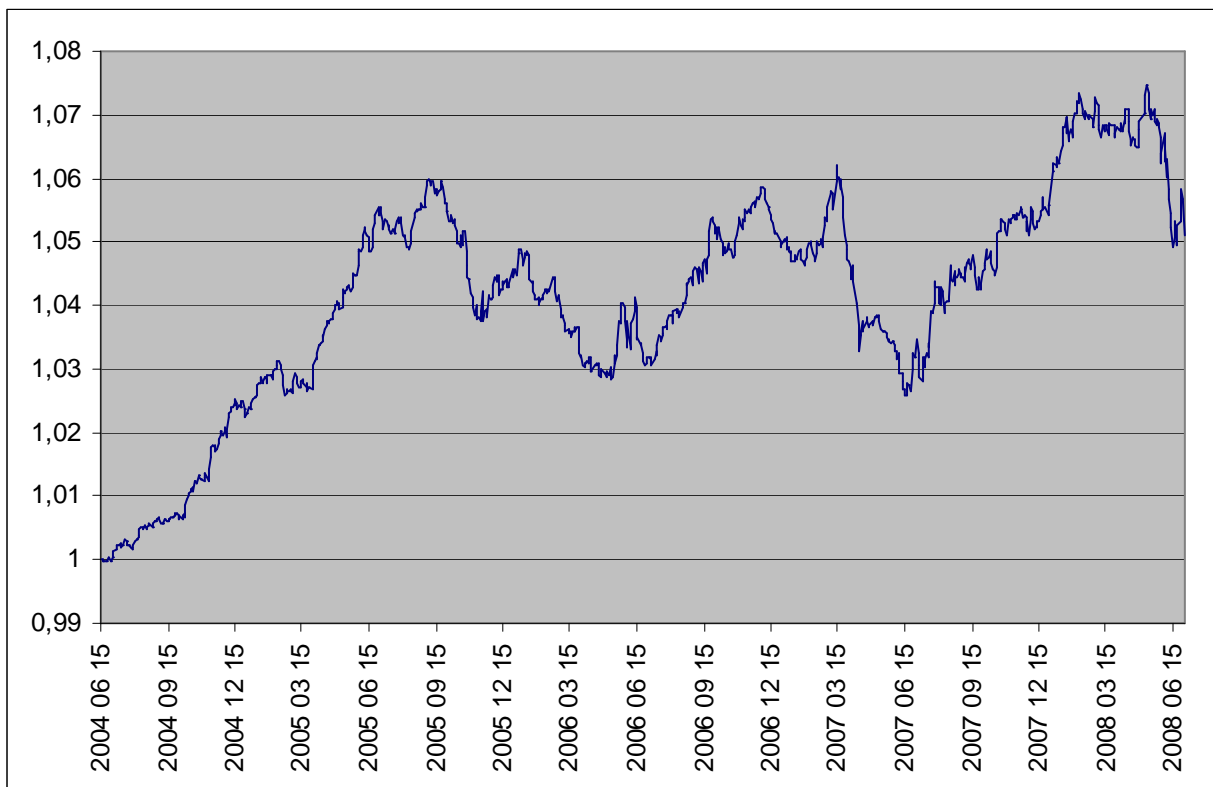
Eil. nr.	Paskolos suma	Paskolos valiuta	Paskolos paėmimo data	Paskolos grąžinimo terminas	Palūkanų dydis	Skolinimosi tikslas	Kreditorius	Skolintų lėšų dalis, palyginti su fondo GA (%)
-	-	-	-	-	-	-	-	-
Iš viso	-	-	-	-	-	-	-	-

XI. KITA INFORMACIJA

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

Fondo *SEB pensija 1* lėšos investuojamos į Lietuvos Respublikos, Europos Sąjungos, Ekonominio bendradarbiavimo ir plėtros organizacijos valstybių vyriausybių arba Europos centrinio banko išleistus ar jų garantuotus skolos vertybinius popierius. Tokių investicijų rizika yra nedidelė.

Vieneto vertės dinamika



XII. ATSAKINGI ASMENYS

33. 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.

-

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

-

35. 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.

-

36. Asmenys, atsakingi už ataskaitoje pateiktą informaciją:

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

Tvirtinu _____ Jonas Iržikevičius, generalinis direktorius.
Tel.: 8 5 2682355, e-mail: jonas.irzikevicius@seb .lt

Tvirtinu _____ Inga Riabovaitė, Operacijų departamento vadovė
Tel.: 8 5 2681576, e-mail: inga.riabovaite@seb .lt

Tvirtinu _____ Sonata Šablinskaitė-Braškienė, vyriausioji buhalterė
Tel.: 8 5 2681262, e-mail: sonata.braskiene@seb .lt

36.2. 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.