

2009 metų sausio – birželio mėnesių ataskaita

SEB pensija 2

2009 m. birželio 30 d.

I. BENDROJI INFORMACIJA	3
II. GRYNŪJŲ AKTYVŲ, APSKAITOS VIENETŲ SKAIČIUS IR VERTĖ	3
III. ATSKAITYMAI IŠ PENSIJŲ TURTO.....	4
IV. INFORMACIJA APIE PENSIJŲ FONDO INVESTICINIŲ PRIEMONIŲ PORTFELĮ	5
V. PENSIJŲ FONDO LYGINAMASIS INDEKSAS, INVESTICIJŲ GRAŽA IR RIZIKOS RODIKLIAI .	14
VI. PENSIJŲ FONDO FINANSINĖ BŪKLĖ.....	15
VII. INFORMACIJA APIE PENSIJŲ FONDO DALYVIUS	25
VIII. IŠORINIAI PINIGŲ SRAUTAI	25
IX. INFORMACIJA APIE GARANTIJŲ REZERVĄ	25
X. INFORMACIJA APIE PENSIJŲ FONDO REIKMĖMS PASISKOLINTAS LĒŠAS	26
XI. KITA INFORMACIJA	26
XII. ATSAKINGI ASMENYS	27

PENSIJŲ FONDO *SEB PENSIIJA 2*
2009 M. SAUSIO-BIRŽELIO MĖNESIŲ ATASKAITA

I. BENDROJI INFORMACIJA

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

Valstybinio socialinio draudimo įmokos dalies kaupimo pensijų fondas *SEB pensija 2*, taisyklių Nr. PF-V02-K001-002(004);

2. Ataskaitinis laikotarpis, už kurį pateikta ataskaita — **2009 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, pavardė, pareigos (asmuo ar asmenys, priimančys investicinius sprendimus)
— **Mindaugas Mikalajūnas, portfelio valdytojas;**

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

AB SEB bankas

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

faks. (8 5) 268 1255

įmonės kodas 112021238;

II. GRYNŲJŲ AKTYVŲ, APSKAITOS VIENETŲ SKAIČIUS IR VERTĖ

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

	Ataskaitinio laikotarpio pradžioje	Ataskaitinio laikotarpio pabaigoje	Prieš metus (2008 06 30)	Prieš dvejus metus (2007 06 29)
Grynųjų aktyvų vertė, Lt	483 215 529	615 095 661	504 667 054	310 728 790
Apskaitos vieneto vertė, Lt	1,0015	1,0963	1,3275	1,3542
Apskaitos vienetų skaičius	482 489 469	561 063 612	380 173 409	229 453 743

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)	92 560 556	94 821 767
Apskaitos vienetų skaičius (konvertuojant vienetus į pinigines lėšas)	14 153 524	14 337 091

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	3,00 proc.	3,00 proc.	2 662 782	2 662 782
Nuo turto vertės	1,00 proc.	1,00 proc.	2 541 212	2 417 811
Už keitimą:				
<i>fondo keitimas toje pačioje bendrovėje daugiau kaip kartą per metus</i>	0,20 proc.	-	-	-
<i>pensijų kaupimo bendrovės keitimas kartą per metus</i>	0,20 proc.	-	-	-
<i>pensijų kaupimo bendrovės keitimas daugiau kaip kartą per metus</i>	4,00 proc.	-	-	-
Iš viso			5 203 994	5 080 593
BAR *				
Sąlyginis BIK ir (arba) tikėtinas sąlyginis BIK *				
PAR (portfelio apyvartumo rodiklis)*				

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

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>	81 013	Komisinis mokestis už sandorius	Ne
AB SEB bankas	11 646	Komisinis mokestis už sandorius	Taip
Iš viso*	92 659		

* nurodyti mokesčiai nemažina pensijų fondo grynujų 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). Pavyzdyje pateikti skaičiavimus, kiek būtų atskaityta (litas) nuo pensijų fondo dalyvio įmokų esant dabartiniam atskaitymų dydžiui ir kokią sumą jis atgautų po 1, 3, 5, 10 metų, jei būtų investuota 10 000 Lt, o metinė investicijų grąža – 5 proc.

-

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 emitent e, %	Dalis GA, %
Nuosavybės vertybiniai popieriai, įtraukti į Oficialųjį ar jį atitinkantį prekybos sąrašą									
AB TEO	LT	LT0000123911	2 146 604	2 146 604	3 852 538	2 382 730	http://market.lt.omxgroup.com	0,2634	0,3873
Baltika	EE	EE3100003609	1 033 917	2 281 545	4 426 353	2 034 848	http://market.lt.omxgroup.com	5,5453	0,3308
Tallink Grupp	EE	EE310000446E	3 944 211	8 703 690	6 654 882	4 494 129	http://market.lt.omxgroup.com	0,5854	0,7306
AB Sanitas	LT	LT0000106171	14 862	14 862	448 585	100 764	http://market.lt.omxgroup.com	0,0478	0,0163
Talina Kaubamaja AS	EE	EE0000001105	532 308	1 174 644	7 502 453	4 466 226	http://market.lt.omxgroup.com	1,3069	0,7261
Olympic Entertainment Group	EE	EE3100084021	2 047 961	4 519 236	7 360 371	4 172 008	http://market.lt.omxgroup.com	1,3563	0,6782
Iš viso:			9 719 863	18 840 581	30 245 181	17 650 705			2,8693
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:				18 840 581	30 245 181	17 650 705			2,8693

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									
Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT0000605099	5 153	515 300	532 984	534 613	4,2	2009.07.16	0,0869
Mortgage Bank of Latvia	LV	LV0000800340	17 485	6 037 221	6 017 990	5 639 393	2,375	2012.02.15	0,9168

AB Lietuvos energija	LT	LT1000403311	7 500	2 589 600	2 583 856	2 670 305	3,85	2009.09.29	0,4341
AB Pieno žvaigždės	LT	LT0000403354	20 000	2 000 000	2 007 755	2 025 122	15,5	2009.10.02	0,3292
AB DnB NORD bankas	LT	LT0000403388	42 233	4 223 300	4 208 250	4 320 102	8,84	2009.09.26	0,7023
Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT0000601833	50 000	5 000 000	4 914 311	4 942 424	7,65	2009.09.02	0,8035
Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT1000600023	1 369	5 199 572	4 832 464	4 995 335	6,45	2010.02.22	0,8121
AB DnB NORD bankas	LT	LT0000401978	50 000	5 000 000	4 536 500	4 553 357	10,6	2010.06.07	0,7402
Iš viso:			193 740	30 564 992	29 634 111	29 680 651			4,8251
Ne nuosavybės vertybiniai popieriai, kuriais prekiaujama kitose reguliuojamose rinkose									
Slovakijos Respublika	SK	XS0192595873	2 700	9 322 560	9 110 627	9 560 273	4,057	2014.05.20	1,5542
Vengrijos Respublika	HU	XS0183747905	1 714	5 918 099	6 536 245	5 663 790	6,085	2014.01.29	0,9207
Lenkijos Respublika	PL	XS0144238002	1 388	4 792 486	5 419 967	5 063 547	3,923	2012.03.12	0,8232
Lenkijos Respublika	PL	XS0162316490	1 300	4 488 640	4 911 874	4 575 300	4,485	2013.02.05	0,7438
Vengrijos Respublika	HU	XS0204418791	761	2 627 581	2 631 785	2 618 752	4,926	2011.10.28	0,4257
PAREX BANKA	LV	XS0253533318	1 500	5 179 200	5 123 351	3 404 938	36,103	2011.05.05	0,5535
Prancūzijos Respublika	FR	FR0010192997	2 075	7 164 560	6 581 005	7 072 202	3,962	2021.04.25	1,1497
Vokietijos Federacine Respublika	DE	DE0001135267	133	459 222	449 285	491 930	2,698	2015.01.04	0,0799
Prancūzijos Respublika	FR	FR0000571218	4 380	15 123 264	18 157 293	17 558 975	4,362	2029.04.25	2,8546
Bankas Snoras	LT	XS0301140512	3 501	12 088 253	12 063 853	7 957 051	55,62	2010.05.21	1,2936
Nyderlandu Karalyste	NL	NL0000102242	1 550	5 351 840	4 858 347	5 567 420	3,078	2015.07.15	0,9051
Vokietijos Federacine Respublika	DE	DE0001135317	200	690 560	666 197	730 988	3,133	2017.01.04	0,1188
Mobile telesystems -CLS	RU	XS0178419049	500	1 232 150	1 112 015	1 274 938	7,18	2010.10.14	0,2072
URSABK	RU	XS0301291729	820	2 831 296	2 591 171	2 780 323	10,316	2010.05.21	0,452
Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	XS0327304001	3 670	12 671 776	12 417 080	9 599 694	9,416	2018.02.07	1,5606
Slovakijos Respublika	SK	XS0299989813	4 000	13 811 200	13 420 343	13 475 081	4,922	2017.05.15	2,1907
ATF BANK	KZ	XS0217138139	1 200	2 957 160	3 018 891	2 536 750	17,307	2012.04.12	0,4124
Gaz Capital	RU	XS0237713226	400	1 381 120	1 247 842	1 303 617	7,483	2012.12.09	0,2119
Slovėnijos Respublika	SI	XS0292653994	3 580	12 361 024	11 586 368	12 184 838	4,36	2018.03.22	1,9809
EVRAZ GROUP SA	RU	XS0360055056	300	739 290	739 290	639 953	14,742	2013.04.24	0,104
Vengrijos Respublika	HU	XS0240732114	1 000	3 452 800	3 063 082	2 943 114	6,837	2016.07.18	0,4784
AK Bars Bank	RU	XS0371071233	1 300	3 203 590	3 203 590	2 875 706	15,821	2011.06.20	0,4675
Cekijos Respublika	CZ	XS0368800073	2 000	6 905 600	6 790 967	6 867 721	5,097	2018.06.11	1,1165

Lenkijos Respublika	PL	XS0371500611	2 000	6 905 600	6 930 460	6 756 808	5,975	2018.06.20	1,0984
Transcreditbank	RU	XS0372158054	500	1 232 150	1 232 150	1 214 777	10,283	2011.06.25	0,1974
OAO TMK	RU	XS0373732063	700	1 725 010	1 725 010	1 578 403	17,949	2011.07.29	0,2566
Steel Capital	RU	XS0376189857	500	1 232 150	1 232 150	1 098 290	14,801	2013.07.29	0,1785
Belgijos Karalyste	BE	BE0000306150	1 700	5 869 760	5 709 516	6 175 878	3,317	2015.09.28	1,004
Rumunijos Respublika	RO	XS0147466501	900	3 107 520	3 361 094	3 349 146	5,892	2012.05.08	0,5444
VIMPELCOM	RU	XS0212255763	500	1 232 150	1 153 908	1 286 885	6,243	2010.02.11	0,2092
TRANSNEFT	RU	XS0306900795	300	1 035 840	735 446	991 033	7,194	2012.06.27	0,1611
Vokietijos Federacine Respublika	DE	DE0001135374	600	2 071 680	2 175 202	2 191 607	3,314	2019.01.04	0,3563
Prancuzijos Respublika	FR	FR0010061242	2 750	9 495 200	10 039 750	10 126 741	2,67	2014.04.25	1,6463
Airijos Respublika	IE	IE00B28HXX02	2 100	7 250 880	6 782 546	7 017 316	5,382	2018.10.18	1,1408
Graikijos Respublika	GR	GR0128001584	1 500	5 179 200	5 942 977	6 007 863	3,274	2013.05.20	0,9767
Iš viso:			54 022	181 090 412	182 720 677	174 541 648			28,3746
Išleidžiami nauji ne nuosavybės vertybiniai popieriai									
Iš viso:									
Iš viso ne nuosavybės vertybinių popierių:				211 655 404	212 354 788	204 222 298			33,1997

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)									
SEB Sicav 2 - SEB Europe Chance/Risk Fund	LU	LU0086811550	2 821	SEB Asset Management S.A.	8 997 641	8 282 199	http://www.bours e.lu Elektroninio pašto pranešimas	KIS 3	1,3464
Raiffeisen Euro Bond	AT	AT0000785308	92 392	Raiffeisen Kapitalanlage -Gesellschaft m.b.H.	33 840 247	35 273 102	informacine sistema Bloomberg	KIS 1	5,7345
Raiffeisen-Eastern European Equities	AT	AT0000785241	15 120	Raiffeisen Kapitalanlage -Gesellschaft m.b.H.	8 747 411	9 623 959	informacine sistema Bloomberg	KIS 3	1,5646
SEB Fund 1 - SEB Europe 1 Fund	LU	LU0030166507	1 144 465	SEB Asset Management S.A.	9 626 752	9 109 644	http://www.bours e.lu Elektroninio pašto pranešimas	KIS 3	1,481

SEB Fund 1 - SEB North America Fund	LU	LU0030166176	3 070 979	SEB Asset Management S.A.	30 847 736	24 736 153	http://www.bourse.lu Elektroninio pašto pranešimas	KIS 3	4,0215
SEB Sicav 1-SEB Eastern Europe ex Russia	LU	LU0070133888	1 294 550	SEB Asset Management S.A.	8 181 137	8 294 204	http://www.bourse.lu Elektroninio pašto pranešimas	KIS 3	1,3484
SEB NVS akciju fondas	LT	LTIF00000104	12 444 905	UAB SEB investiciju valdymas	22 563 139	15 361 991	www.seb.lt	KIS 3	2,4974
SEB NVS obligacijų fondas	LT	LTIF00000112	10 811 493	UAB SEB investiciju valdymas	10 838 893	9 402 756	www.seb.lt	KIS 1	1,5286
Raiffeisen EuroPlus Bond	AT	AT0000689971	1 008 157	Raiffeisen Kapitalanlage-Gesellschaft m.b.H.	35 370 936	36 410 881	informacinė sistema Bloomberg	KIS 1	5,9195
JB Commodity Fund EUR-C	LU	LU0244125398	60 834	Bank Julius Baer & Co. AG, Zurich	17 858 281	16 066 520	http://jbggroup.jbfundnet.com	KIS 5	2,612
JB US Leading Stock Fund-C	LU	LU0099407586	16 005	Bank Julius Baer & Co. AG, Zurich	15 366 744	11 449 278	http://jbggroup.jbfundnet.com	KIS 3	1,8613
SEB Fund 2-SEB Russia Fund	LU	LU0273119544	989 608	SEB Asset Management S.A.	20 056 500	20 354 581	http://www.bourse.lu Elektroninio pašto pranešimas	KIS 3	3,3091
JB Europe Stock Fund-C	LU	LU0099389313	11 999	Bank Julius Baer & Co. AG, Zurich	11 079 489	9 735 017	http://jbggroup.jbfundnet.com	KIS 3	1,5826
JB Europe Growth-C	LU	LU0099406851	40 816	Bank Julius Baer & Co. AG, Zurich	9 314 027	8 906 725	http://jbggroup.jbfundnet.com	KIS 3	1,448
JB US Value Stock Fund-C	LU	LU0135057056	50 780	Bank Julius Baer & Co. AG, Zurich	16 687 926	12 771 602	http://www.bourse.lu Elektroninio pašto pranešimas	KIS 3	2,0763
JB Euro Government Bond Fund - C	LU	LU0100842706	57 413	Bank Julius Baer & Co. AG, Zurich	27 739 217	29 014 002	http://jbggroup.jbfundnet.com	KIS 1	4,7169

HSBC GIF-EU CORE BD-IC	LU	LU0165130088	416 752	HSBC Investment Funds Luxembourg	25 797 580	27 114 356	https://www.hsbcinvestments.com	KIS 1	4,4081
HSBC GIF-ASIA X JAPAN EQ-I	LU	LU0165193169	118 134	HSBC Investment Funds Luxembourg	8 191 136	10 878 762	https://www.hsbcinvestments.com	KIS 3	1,7686
HSBC GIF-BRIC MARKET-IC	LU	LU0254983488	550 114	HSBC Investment Funds Luxembourg	13 233 219	16 743 584	https://www.hsbcinvestments.com	KIS 3	2,7221
HSBC GIF-JAPANESE EQUITY-AI	LU	LU0164882242	102 064	HSBC Investment Funds Luxembourg	11 685 760	13 173 033	https://www.hsbcinvestments.com	KIS 3	2,1416
HSBC GIF-EUROLAND EQ-IC	LU	LU0165074823	157 926	HSBC Investment Funds Luxembourg	9 854 672	11 678 386	https://www.hsbcinvestments.com	KIS 3	1,8986
HSBC GIF -US Equity -I\$	LU	LU0164902883	652 048	HSBC Investment Funds Luxembourg	23 477 122	25 148 669	https://www.hsbcinvestments.com	KIS 3	4,0885
Iš viso:			33 109 377		379 355 563	369 529 406			60,0756
Kitų kolektyvinio investavimo subjektų vienetai (akcijos)									
EEREIF	EE	EE3500096500	91 209		4 166 728	4 101 114			0,6667
Iš viso:			91 209		4 166 728	4 101 114			0,6667
Iš viso KIS vienetų (akcijų):					383 522 291	373 630 520			60,7423

* Nurodyti KIS tipą:

KIS 1 – KIS, kurių investavimo strategijoje numatyta iki 100 proc. grynujų aktyvų investuoti į ne nuosavybės vertybinius 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	Valiuta	Investicinis sandoris (pozicija)	Sandorio (pozicijos) vertė	Bendra rinkos vertė	Rinkos pavadinimas (tinklalapio adresas)	Galiojimo terminas	Dalis GA, %
Išvestinės finansinės priemonės, kuriomis prekiaujama reguliuojamose rinkose										
ECU9	Chicago Mercantile Exchange	US	Chicago Mercantile Exchange	USD	CME USD/EUR CURR FUTURE		378 424		2009.09.14	0,0615
RYU9	Chicago Mercantile Exchange	US	Chicago Mercantile Exchange	JPY	CME EUR/JPY FUTURE		- 340 594		2009.09.14	-0,0553
RXU9	EUREX	CH	EUREX	EUR	EUREX BUND FUTURE		903 252		2009.09.08	0,1468
Iš viso:							941 083			0,153
Kitos išvestinės finansinės priemonės										
Iš viso:										
Iš viso išvestinių finansinių priemonių										

Banko pavadinimas	Valiuta	Bendra rinkos vertė	Palūkanų norma	Dalis GA, %
Pinigai				
AB SEB bankas	LTL	3 494 701		0,5681
AB SEB bankas	EUR	1 685 653		0,274
AB SEB bankas	USD	3 656 355		0,5944
AB SEB bankas	JPY	1 278 440		0,2078
AB SEB bankas	SEK	67 598		0,0109
SEB London Futures	EUR	1 901 662		0,3091
SEB London Futures	USD	6 215 140		1,0104
SEB London Futures	JPY	1 357 097		0,2206
Iš viso pinigų:		19 656 645		3,1953

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

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	Rinkos vertė	Dalis aktyvuose (%)	Rinkos vertė ataskaitinio laikotarpio pradžioje	Dalis aktyvuose ataskaitinio laikotarpio pradžioje (%)
Pagal investavimo objektus				
Vyriausybių obligacijos	156 071 354	25,37%	130 737 299	27,06%
Įmonių obligacijos	48 150 944	7,83%	56 125 863	11,62%
Akcijos	17 650 705	2,87%	13 609 496	2,82%
KIS	373 630 520	60,74%	236 834 279	49,01%
Išvestinės priemonės	941 083	0,15%	5 604 954	1,16%
Grynieji pinigai ir pinigų rinkos priemonės	18 651 055	3,03%	40 303 638	8,34%
Iš viso	615 095 661	100,00%	483 215 529	100,00%
Pagal kredito reitingą				
AAA	43 739 863	7,11%	33 095 467	6,85%
AA+	13 193 194	2,14%	5 996 309	1,24%
AA	12 184 838	1,98%	11 910 905	2,46%
A+	35 910 938	5,84%	30 761 812	6,37%
A	16 395 654	2,67%	27 480 764	5,69%
A-	9 599 694	1,56%	12 897 771	2,67%
BBB+	13 520 306	2,20%	-	-
BBB	5 639 393	0,92%	4 354 424	0,90%
BBB-	3 349 146	0,54%	4 730 250	0,98%
BB+	3 751 527	0,61%	6 664 870	1,38%
BB	2 561 823	0,42%	4 844 405	1,00%
BB-	3 878 613	0,63%	13 878 573	2,87%
B+	1 578 403	0,26%	-	0,00%
B	-	0,00%	454 063	0,09%
Nereitinguojami	38 918 906	6,33%	29 793 548	6,17%
Iš viso	204 222 298	33,20%	186 863 162	38,67%
Pagal valiutas				
LTL	46 110 897	7,50%	63 633 666	13,17%
EUR	428 964 383	69,74%	330 554 399	68,41%
Kita valiuta	140 020 380	22,76%	89 027 463	18,42%
Iš viso	615 095 661	100,00%	483 215 529	100,00%
Pagal terminą iki išpirkimo				
Iki 3 mėn.	-	-	15 277 845	3,16%
Nuo 3 mėn. iki 2 m.	14 492 566	2,36%	26 975 398	5,58%
Nuo 2 m. iki 4 m.	34 540 465	5,62%	34 009 904	7,04%
Nuo 4 m. iki 7 m.	56 555 697	9,19%	34 333 812	7,11%
Nuo 7 m. iki 10 m.	29 384 410	4,78%	49 844 944	10,32%
Daugiau 10 m.	69 249 161	11,26%	26 421 259	5,47%
Iš viso	204 222 298	33,20%	186 863 162	38,67%
Pagal geografinę zoną				
Lietuva	78 023 400	12,68%	85 633 187	17,72%
kitos Europos Sąjungos valstybės	528 943 281	85,99%	380 702 651	78,79%

kitos Europos ekonominei erdvės valstybės (Islandija, Norvegija Lichtenšteinas)	-	-	-	-
Jungtinės Amerikos Valstijos ir Kanada	37 830	0,01%	5 530 599	1,14%
Japonija	-	-	-	-
kitos šalys	8 091 149	1,32%	11 349 092	2,35%
Iš viso	615 095 661	100,00%	483 215 529	100,00%
Pagal regionus				
Vidurio ir Rytų Europos obligacijos	123 700 703	20,11%	119 914 819	24,82%
Vakarų Europos obligacijos	190 753 262	31,01%	112 883 992	23,36%
NVS obligacijos	26 983 432	4,39%	18 725 677	3,88%
Vidurio ir Rytų Europos akcijos	35 568 869	5,78%	14 983 772	3,10%
Vakarų Europos akcijos	47 711 973	7,76%	44 646 402	9,24%
Japonijos akcijos	13 173 033	2,14%	11 410 967	2,36%
NVS akcijos	35 716 572	5,81%	23 415 728	4,85%
Šiaurės Amerikos akcijos	74 105 701	12,05%	66 753 751	13,81%
Azijos be Japonijos akcijos	10 878 762	1,77%	4 943 726	1,02%
Sektoriniai fondai	16 066 520	2,61%	9 889 226	2,05%
Besivystančios rinkos	16 743 584	2,72%	4 503 866	0,93%
Iš viso	591 402 409	96,15%	432 071 926	89,42%

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	Išpirkimo data	Pelnas/nuostolis valiuta	Valiutos kodas	Priemonės panaudojimo tikslas	Pastabos
CME EUR/JPY FUTURE	Ateities sandoris (angl. future)	-	60 620 000	JPY	Valiutos draudimas	Reguliuojamų rinkų IP
CME S+POOR 500 EMINI_FUTURE	Ateities sandoris (angl. future)	-	454 888	USD	Investicijų į akcijų rinkas rizikos valdymas	Reguliuojamų rinkų IP
CME USD/EUR CURR FUTURE	Ateities sandoris (angl. future)	-	4 025 763	USD	Valiutos draudimas	Reguliuojamų rinkų IP
EUREX BUND FUTURE	Ateities sandoris (angl. future)	-	- 292 600	EUR	Obligacijų rizikos valdymas	Reguliuojamų rinkų IP
EUREX EURO STOXX 50	Ateities sandoris (angl. future)	-	266 690	EUR	Investicijų į akcijų rinkas rizikos valdymas	Reguliuojamų rinkų IP
SIMEX NIKKEI STOCK AVERAGE 225	Ateities sandoris (angl. future)	-	17 230 000	JPY	Investicijų į akcijų rinkas rizikos valdymas	Reguliuojamų rinkų IP
-	Išankstinis sandoris (angl. forward)	-	1 279 738	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 pirkė išvestines finansines priemones (ateities valiutos keitimo sandorius (currency futures)). Buvo perkamos tik tokios priemonės, kurių kainos priklauso nuo euro ir JAV dolerio arba euro ir Japonijos jenos santykio. Tokių sandorių, išvestinių finansinių priemonių, rizika yra vertinama atsižvelgus į jų nominaliąją vertę. Ši rizika yra ribojama stebint, kad vienos valiutos sandorių bendra nominalioji vertė neviršytų tos pačios valiutos fondo investicijų vertės.

Per ataskaitinį laikotarpį fondas pirkė išvestines finansines priemones (obligacijų, kurių kainos priklauso nuo Vokietijos vyriausybės 10 metų trukmės obligacijų kainų pokyčio, ateities sandorius (bund futures)). Perkant šiuos sandorius, yra keičiama bendra fondo palūkanų normų rizika (obligacijų rinkos rizika). Norėdama valdyti šią riziką, valdymo įmonė riboja fondo investicijų į skolos vertybinius popierius vidutinę finansinę trukmę nuo 0,5 iki 11,5 metų.

Ataskaitiniu laikotarpiu fondas pirkė išvestines finansines priemones (akcijų indeksų ateities sandorius (equity index futures)). Buvo perkamos tik tokios priemonės, kurių kaina priklauso ir / arba nuo JAV akcijų indekso S&P500, ir / arba nuo Europos akcijų indekso DJ EuroStoxx 50, ir / arba nuo Japonijos akcijų indekso NIKKEI 225. Tokių priemonių rizikos vertė yra nustatoma atsižvelgus į jų nominaliąją vertę. Ši rizika yra ribojama stebint, kad bendra fondo investicijų į pasaulio akcijų rinkas suma neviršytų ribų, nustatytų fondo taisyklėse.

Ataskaitiniu laikotarpiu sudaryti išvestinių investicinių priemonių sandoriai buvo taikomi norint valdyti valiutos, bendros fondo palūkanų normos ir akcijų kainų kitimo riziką. Palūkanų normų rizika buvo valdoma norint išvengti neigiamos palūkanų normų svyravimų įtakos fondo rezultatams. Akcijų kitimo rizika buvo valdoma norint išvengti neigiamos akcijų kainų svyravimų įtakos fondo rezultatams. Sudarant valiutos ateities sandorius, buvo stengiamasi mažinti valiutos riziką investuojant JAV doleriais, Japonijos jonomis ar į fondus, kurių bazinė valiuta yra JAV doleriai ar Japonijos jenos.

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

Priemonės rūšis	Išpirkimo data	Išsipareigojimų vertė valiuta ataskaitinio laikotarpio pabaigoje	Valiutos kodas	Pastabos
CME EUR/JPY FUTURE	2009 09 14	-13 198 750	JPY	Reguliuojamų rinkų IP

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 veiksniai, per ataskaitinį laikotarpį turėjusius didžiausią įtaką investicinių priemonių portfelio struktūrai ir jo vertės pokyčiams.

Ataskaitiniu laikotarpiu fondo investicijų portfelio vertės pokyčiams didžiausią įtaką turėjo:
 Ataskaitiniu laikotarpiu fondo investicijų portfelio vertės pokyčiams didžiausią įtaką turėjo:
 akcijų rinkų atsigavimas visame pasaulyje;
 pradėję gerėti makroekonomikos duomenys ir ateities tendencijų rodikliai;
 didesnė prisiimama rizika ir dėl to padidėjusios investicijos į rizikingesnes turto klases.

V. PENSIJŲ FONDO LYGINAMASIS INDEKSAS, 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)

2009 m. birželio 30 d.

Eil. nr.	Turtas	Pastabų Nr.	2009 06 30	2008 12 31	2007 12 31
I.	PINIGAI IR PINIGŲ EKVIVALENTAI	2	19 656 645	40 711 266	7 677 749
II.	TERMINUOTIEJI INDEĖLIAI		-	-	-
III.	INVESTICIJOS	1,2	595 503 523	430 014 671	406 336 788
1	Skolos vertybiniai popieriai		204 222 298	186 838 882	157 508 547
1.1.	vyriausybių ir centrinių bankų arba jų garantuoti skolos vertybiniai popieriai		156 071 354	130 710 949	89 801 647
1.2.	kiti skolos vertybiniai popieriai		48 150 944	56 127 933	67 706 900
2	Nuosavybės vertybiniai popieriai		17 650 705	12 825 479	1 363 936
3	Kolektyvinio investavimo subjektų investiciniai vienetai ir akcijos		373 630 520	230 350 310	247 464 305
4	Kitos investicijos		-	-	-
IV.	PRETENZIJOS DĖL IŠVESTINIŲ FINANSINIŲ PRIEMONIŲ	2	1 281 677	6 431 542	1 532 692
V.	GAUTINOS SUMOS	2	26 315	96 972	92 417
1	Investicijų pardavimo sandorių gautinos sumos		-	-	-
2	Kitos gautinos sumos		26 315	96 972	92 417
	IŠ VISO TURTO		616 468 160	477 254 451	415 639 646

Eil. nr.	Įsipareigojimai ir grynieji aktyvai		2009 06 30	2008 12 31	2007 12 31
VI.	ĮSIPAREIGOJIMAI		1 031 905	496 271	316 842
1	Investicijų pirkimo įsipareigojimai		-	-	-
2	Mokėtinos sumos kaupimo bendrovei ir depozitoriumui		494 941	371 540	303 574
3	Kitos mokėtinos sumos ir įsipareigojimai		536 964	124 731	13 268
VII.	ĮSIPAREIGOJIMAI DĖL IŠVESTINIŲ FINANSINIŲ PRIEMONIŲ		340 594	875 742	43 316
VIII.	GRYNIEJI AKTYVAI (I+II+III+IV+V-VI-VII)		615 095 661	475 882 438	415 279 488
	IŠ VISO ĮSIPAREIGOJIMŲ IR GRYNŲJŲ AKTYVŲ		616 468 160	477 254 451	415 639 646

16 – 25 puslapiuose pateiktas aiškinamasis raštas yra neatskiriama šių finansinių ataskaitų dalis.

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

GRYNUJŲ AKTYVŲ POKYČIŲ ATASKAITA (LT)

2009 m. birželio 30 d.

Eil. nr.	Straipsniai	Pastabų Nr.	2009 01 01– 2009 06 30	2008 01 01– 2008 06 30	2007 01 01– 2007 06 30
I.	GRYNIEJI AKTYVAI ATASKAITINIO LAIKOTARPIO PRADŽIOJE		475 882 438	415 279 488	227 082 359
II.	IŠ VISO PADIDĖJIMO		227 617 099	157 088 749	478 816 879
1	Pensijų įmokos		88 758 363	112 585 128	179 518 591
2	Iš kitų pensijų fondų pervestos sumos		6 063 405	4 502 232	6 589 963
3	Kaupimo bendrovės garantinės įmokos		-	-	-
4	Palūkanos ir dividendai		31 051 008	3 795 996	5 504 705
5	Investicijų pardavimo pelnas		278 960	6 134 195	1 194 644
6	Investicijų vertės padidėjusi dalis		81 223 006	10 474 348	188 459 509
7	Turto vertės padidėjimas dėl užsienio valiutų kursų pasikeitimo		1 936 837	199 478	22 119 385
8	Kitos pajamos	3	18 305 520	19 397 372	75 430 082
III.	IŠ VISO SUMAŽĖJIMO		88 403 876	67 701 183	290 619 750
1	Pensijų išmokos		463 421	223 098	233 718
2	Į kitus pensijų fondus pervestos sumos		13 873 670	4 666 653	10 736 811
3	Investicijų pardavimo nuostoliai		1 151 974	8 445 840	2 405 619
4	Investicijų vertės sumažėjusi dalis		48 844 525	36 700 444	174 169 291
5	Turto vertės sumažėjimas dėl užsienio valiutų kursų pasikeitimo		7 820 075	5 772 621	29 636 415
6	Valdymo sąnaudos	4	5 203 994	5 509 333	8 378 891
7	Kitos sąnaudos	5	11 046 217	6 383 194	65 059 005
IV.	GRYNIEJI AKTYVAI ATASKAITINIO LAIKOTARPIO PABAIGOJE		615 095 661	504 667 054	415 279 488
			2009 01 01– 2009 06 30	2008 01 01– 2008 06 30	2007 01 01– 2007 06 30
V.	APSKAITOS VIENETO VERTĖ		1,0963	1,3275	1,3921
VI.	APSKAITOS VIENETŲ SKAIČIUS		561 063 612	380 173 409	298 318 588

16 – 25 puslapiuose pateiktas aiškinamasis raštas yra neatskiriama šių finansinių ataskaitų dalis.

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

AIŠKINAMASIS RAŠTAS

Bendroji informacija

Valstybinio socialinio draudimo įmokos dalies kaupimo pensijų fondo *Pensija 2* (toliau – Fondas) taisyklės Nr. PF-V02-K001-002(001) patvirtino Lietuvos Respublikos vertybinių popierių komisija 2003 m. rugpjūčio 28 d. 2006 m. vasario 23 d. Pensijų fondo pavadinimas pakeistas į *SEB Pensija 2*.

Pensijų fondą *SEB pensija 2* 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

Lietuvos Respublikos Kolektyvinio investavimo subjektų įstatymą, veiklos licencija Nr. VĮK – 001.

Pensijų fondo *SEB pensija 2* depozitoriumas yra AB SEB bankas, įmonės kodas 112021238, esantis adresu Gedimino 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-01112 Vilnius, veikianti pagal 2005 m. gruodžio 20 d. Lietuvos auditorių rūmų pažymėjimą Nr.001273.

Apskaitos principai

Finansinės atskaitos parengtos vadovaujantis Lietuvos Respublikos buhalterinės apskaitos įstatymu, bendraisiais apskaitos principais, nustatytais Verslo apskaitos standartuose, pensijų fondų buhalterinės apskaitos ir finansinių ataskaitų tvarka ir kitais teisės aktais.

Pateikiamos finansinės atskaitos yra penktųjų veiklos metų finansinės atskaitos. Fondas pirmąsias įmokas ir pajamas gavo 2004 m. birželio 15 d.

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

Pensijų fondo apskaita tvarkoma atskirai nuo Bendrovės bei kitų jos valdomų pensijų fondų apskaitos pagal patvirtintą sąskaitų planą.

Finansiniai pensijų fondo metai sutampa su kalendoriniais metais.

Sumos šiose finansinėse atskaitose pateiktos Lietuvos Respublikos nacionaline valiuta – litais (Lt).

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

Investavimo politika

Fondo *SEB pensija 2* turtas investuojamas taip, kad per ilgą laikotarpį fondo dalyvių investicijų vertė didėtų ir būtų išlaikyta vidutinė rizika.

Bendrovė fondo turtą investuoja pagal tokią politiką ir principus:

Investicijos į akcijų rinkas sudaro nuo 20 iki 60 proc. fondo turto;

Siekdama užtikrinti stabilų fondo turto pelningumą, bendrovė į valstybių vyriausybių ir bendrovių skolos VP, pinigų rinkos priemones, banko indėlius investuoja nuo 40 iki 80 proc. fondo turto;

Likusi dalis investuojama į vyriausybių ir įmonių skolos vertybinius popierius, pinigų rinkos priemones; siekdama išnaudoti kitų turto klasių suteikiamas galimybes, bendrovė į pastarąsias investuoja iki 8 proc. fondo turto;

bendrovė neapsiriboja investicijomis į konkrečių valstybių vyriausybių ir centrinių bankų išleistus ar jų garantuotus skolos VP.

Finansinės rizikos valdymo politika

Su Fondo investicijomis yra susijusi ši rizika:

VP pasirinkimo ir kainų kitimo rizika. Tai yra rizika, kad VP kainos keisis dėl besikeičiančios situacijos rinkoje ar naujos informacijos apie šiuos VP. Įsigytų VP kainos pokytis gali skirtis nuo prognozuoto kainos pokyčio. Jei įsigytų VP kainos pokytis neatitinka prognozuoto kainos pokyčio, sumažinamas VP lyginamasis svoris fondo investicijų portfelyje. Bendrovė valdo VP pasirinkimo ir kainų kitimo riziką laikydamasi taisyklių 9 straipsnyje nustatytų fondo investicijų portfelio diversifikavimo reikalavimų;

turto paskirstymo rizika. Tai yra investicijų paskirstymo tarp nuosavybės ir skolos VP rizika. Bendrovė, įvertinusi pasaulio šalių ekonomikos augimo perspektyvas, priima sprendimą, kokią fondo turto dalį skirti akcijų rinkoms, fiksuoto pajamingumo investicijų priemonėms ir kitoms investicijoms; fondo turtas, investuojamas į akcijas ar kolektyvinius investavimo subjektus, investuojančius į akcijas, paskirstomas įvairiuose pasaulio geografiniuose regionuose ir ekonomikos sektoriuose;

palūkanų normų rizika. Taisyklėse nustatyti 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. Valdydama šią riziką, bendrovė gali naudoti išvestines finansines priemones ir keisti vidutinę fondo obligacijų finansinę trukmę;

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. Valdydama šią riziką, bendrovė gali naudoti išvestines finansines priemones, kurių vertė kinta kartu su emitento kreditingumo kokybe;

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;

infliacijos/perkamosios galios rizika. Infliacijos tempams spartėjant skolos VP atkarpų ir pagrindinės sumos perkamoji vertė ir kaina paprastai mažėja. Valdant šią riziką, bendrovė gali naudotis išvestinėmis finansinėmis priemonėmis, kurių vertė kinta kartu su infliacijos augimo pokyčiu, gali investuoti į obligacijas, kurių vertė yra susijusi su infliacijos tempais arba keisti obligacijų dalį fonde bei keisti vidutinę fondo obligacijų finansinę trukmę;

rizika, susijusi su VPK nereguliuojamų VP įsigijimu, apskaita ir nuosavybės teise į juos. Galima didesnė šių VP rizika, palyginti su VP, reguliuojamais VPK, dėl informacijos apie šiuos VP trūkumo ar vėlavimo, kiekvienos šalies skirtingo teisinio reglamentavimo, skirtingų VP apskaitos standartų ir galimo papildomo apmokestinimo toje valstybėje, kurioje VP buvo išleisti. Bendrovė valdo šių VP riziką vertindama jų reguliavimo, apmokestinimo ir apskaitos ypatumus.

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.

Turto padidėjimo ir sumažėjimo pripažinimo principai

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

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

Išvestinės finansinės priemonės balanse parodomos kaip turtas, jeigu tikroji vertė yra teigiama, arba kaip įsipareigojimas, jeigu tikroji vertė neigiama. Išvestinių finansinių priemonių vertės padidėjusi dalis yra traukiama į kitas pajamas, o vertės sumažėjusi dalis į kitas sąnaudas.

Avanso sumokėjimas traukiamas į apskaitą gautinų sumų sąskaitoje. Šio straipsnio padidėjusi ar sumažėjusi vertės dalis traukiama į apskaitą, jei atsiskaitoma užsienio valiuta dėl oficialaus lito ir Lietuvos banko skelbiamo lito ir užsienio valiutos santykio pasikeitimo. Sumažėjusi vertės dalis traukiama į apskaitą gavus prekes ar pasinaudojus paslaugomis arba nebesitikint atgauti sumokėtų sumų.

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 valdymo įmone per metus yra:

1. turto valdymo mokestis – iki 1 (vieno) proc. per metus nuo dalyvio pensijų sąskaitoje apskaičiuotų lėšų vidutinės metinės vertės;
2. įmokos mokestis - iki 3 (trijų) proc. dalyvio vardu įmokėtų įmokų.

2009 m. taikomi atitinkamai 1 ir 3 proc. dydžio mokesčiai

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

Atskaitymai depozitoriumui mokami iš valdymo įmonės.

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

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

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

Visi atskaitymai valdymo įmonei, depozitoriumui ir kitos išlaidos vyksta kaupimo principu.

Investicijų įvertinimo metodai, investicijų pervertinimo periodiškumas

Į balansą traukiama investicijų ataskaitinio laikotarpio pabaigos tikroji vertė.

Finansinių priemonių, kuriomis prekiaujama reguliuojamose rinkose, tikroji vertė nustatoma pagal bendrovės patvirtintose GA vertės skaičiavimo procedūrose nurodytą rinkos viešai paskelbtą vertinimo dieną vidutinę rinkos kainą (*mid market price*) arba uždarymo kainą (*closing price*), išskyrus atvejus, kai:

1. priemonės yra kotiruojamos keliose reguliuojamose rinkose; tuo atveju jų tikrajai vertei nustatyti naudojama tos reguliuojamos rinkos, kurios prekybai šiomis priemonėmis būdingas didesnis likvidumas, reguliarumas ir dažnumas, duomenys;

2. pagal šio straipsnio 1 punkte pateiktą kriterijų neįmanoma pagrįstai pasirinkti rinkos, kurios duomenimis remiantis turi būti nustatoma priemonės tikroji vertė; tuo atveju jai nustatyti naudojama reguliuojamos rinkos, kurioje yra priemonės emitento buveinė, duomenys;

3. per paskutinę prekybos sesiją priemonė nebuvo kotiruojama; tuo atveju tikrajai vertei nustatyti naudojama paskutinė žinoma, tačiau ne daugiau kaip prieš 30 (trisdešimt) kalendorinių dienų buvusi vidutinė rinkos kaina arba uždarymo kaina, jei nuo paskutinės prekybos dienos neįvyko įvykių, dėl kurių dabartinė rinkos kaina yra reikšmingai mažesnė ar didesnė už paskutinę žinomą kainą;

4. priemonė nebuvo kotiruojama daugiau kaip 30 (trisdešimt) kalendorinių dienų iki vertinimo dienos arba buvo kotiruojama rečiau, nei nustatyta skaičiavimo procedūrose; tuo atveju jos vertė nustatoma kaip priemonių, kuriomis reguliuojamose rinkose neprekiuojama, vertė;

5. naudojantis *Bloomberg*, *Reuters* ar kitų tarptautinių naujienų agentūrų, informacijos šaltinių teikiamais pelningumo duomenimis ir/arba kainomis yra gaunamas tikslesnis priemonių vertinimas.

Jei gali būti gaunamas tikslesnis įvertinimas, tikroji vertė nustatoma remiantis pirminių dilerių (AB SEB banko, AB DnB NORD banko ir AB *Hansabanko*) skelbiamais pelningumo 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 pokytis priskiriamas investicijų vertės padidėjusiai ar sumažėjusiai daliai. Pardavus investicijas, jų tikrosios vertės ir pardavimo kainos skirtumas parodomas „grynąjų aktyvų pokyčio ataskaitoje“ kaip „investicijų pardavimo pelnas“ arba „investicijų pardavimo nuostolis“.

Skolos vertybinių popierių tikroji vertė apima ir palūkanų pajamas.

Kolektyvinio investavimo subjektų vienetai (akcijos), kuriais reguliuojamose rinkose neprekiuojama, vertinami atsižvelgus į paskutinę viešai paskelbtą išpirkimo kainą.

Į apskaitą traukiama terminuotųjų indėlių amortizuota savikaina. Palūkanų pajamos į palūkanų pajamas traukiamos kaupimo principu.

Į apskaitą yra traukiama grynujų pinigų bankuose ir lėšų kredito įstaigose nominalioji vertė.

Išvestinės finansinės priemonės

Iš išvestinės finansinės priemonės atsirandantį finansinį turtą ir finansinį įsipareigojimą Bendrovė registruoja apskaitoje, kai pagal sutartį įgyja teisę gauti turtą arba prievolę vykdyti įsipareigojimą. Iš išvestinės finansinės priemonės atsirandančio finansinio turto ir finansinio įsipareigojimo vertė pirmą kartą apskaitoje registruojama išsigijimo savikaina. Kiekvieną dieną ir sudarant balansą tam tikrą dieną finansinėse ataskaitose parodoma finansinių priemonių tikroji vertė.

Kiekvienos dienos tikrosios vertės pokytis, nustatytas vertinant iš išvestinės finansinės priemonės atsirandantį finansinį turtą ir finansinį įsipareigojimą, parodomas „grynujų 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.

Išvestinės finansinės priemonės, kuriomis reguliuojamose rinkose neprekiuojama, vertė nustatoma pagal paskutinę analogiško anksčiau sudaryto sandorio rinkos vertę arba pagal tikėtiną pardavimo kainą.

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 yra Lietuvos Respublikos valiuta – litais. Pradinė apskaitos vieneto vertė lygi 1 litui.

Kiekvieno apskaitos vieneto vertė nustatoma padalijus Fondo grynujų aktyvų vertę iš bendro fondo apskaitos vienetų skaičiaus jos skaičiavimo dieną. Bendra visų Fondo apskaitos vienetų vertė visada yra lygi Fondo grynujų aktyvų vertei. Apskaitos vieneto (jo dalių) vertė nustatoma keturių skaičių po kablelio tikslumu ir apvalinama pagal matematinės apvalinimo taisykles.

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

P pinigų ekvivalentai

P pinigų ekvivalentams priskiriamos trumpalaikės (iki trijų mėnesių) likvidžios investicijos, kurios gali būti greitai iškeičiamos į pinigų sumas ir kurių vertės pasikeitimo rizika yra nereikšminga. Investicijos į nuosavybės vertybinius popierius pinigų ekvivalentams nepriskiriamos.

Investicijų portfelio struktūra

Bendrovė, investuodama fondo turtą, laikosi šių diversifikavimo reikalavimų:

1. į vieno emitento VP ar pinigų rinkos priemones gali būti investuota ne daugiau kaip 5 proc. fondo turto sudarančių grynujų aktyvų;
2. į vieno emitento VP ar pinigų rinkos priemones gali būti investuota daugiau kaip 5 proc., bet ne daugiau kaip 10 proc. grynujų aktyvų, su sąlyga, kad tokių investicijų bendra suma nebus didesnė kaip 40 proc. grynujų aktyvų (šis apribojimas netaikomas indėliams);
3. investicijos į Europos Sąjungos valstybės narės ar jų savivaldybių, kitos valstybės ar tarptautinės organizacijos, kuriai priklauso bent viena Europos Sąjungos valstybė, išleistus arba garantuotus vieno emitento VP ar pinigų rinkos priemones negali būti didesnės kaip 35 proc. fondo turto sudarančių grynujų aktyvų;
4. investicijos į VP ar pinigų rinkos priemones gali sudaryti iki 100 proc. fondo turto sudarančių grynujų

aktyvų, jei:

- 4.1. tokiu atveju dalyvių interesai būtų pakankamai apsaugoti;
- 4.2. investuota į ne mažiau kaip 6 emisijų VP;
- 4.3. į vienos emisijos VP investuota ne daugiau kaip 30 proc. grynujų aktyvų;
- 4.4. gavus VPK leidimą.
5. investicijos į obligacijas, išleistas tokios Europos Sąjungos valstybėje registruotą buveinę turinčios kredito įstaigos negali būti didesnės kaip 25 proc. grynujų aktyvų;
6. bendra investicijų į VP suma gali sudaryti iki 80 proc. fondo turta sudarančių grynujų aktyvų, jei į tokias vieno emitento obligacijas investuojama daugiau kaip 5 proc., bet ne daugiau kaip 25 proc. grynujų aktyvų;
7. ne daugiau kaip 20 proc. fondo grynujų aktyvų gali būti investuota į kolektyvinio investavimo subjekto investicinius vienetus ar akcijas;
8. investicijos į indėlius vienoje kredito įstaigoje negali sudaryti daugiau kaip 20 proc. fondo turta sudarančių grynujų aktyvų.

1 PASTABA

INVESTICIJŲ VERTĖS POKYTIS

(Lt)

Balanso straipsniai	Pokytis					
	praėjusio ataskaitinio laikotarpio pabaigoje	įsigyta	parduota (išpirkta)	vertės padidėjimas	vertės sumažėjimas	ataskaitinio laikotarpio pabaigoje
Skolos vertybiniai popieriai	186 838 882	55 275 468	-54 541 639	49 408 576	-32 758 989	204 222 298
Vyriausybės ir centrinių bankų arba jų garantuoti skolos vertybiniai popieriai	130 710 949	50 090 778	-28 114 618	24 398 647	-21 014 402	156 071 354
Kiti skolos vertybiniai popieriai	56 127 933	5 184 690	-26 427 021	25 009 929	-11 744 587	48 150 944
Kolektyvinio investavimo subjektų investiciniai vienetai ir akcijos	230 350 310	172 455 016	-71 444 735	61 478 316	-19 208 387	373 630 520
Nuosavybės vertybiniai popieriai	12 825 479	6 902 289	-212 169	2 551 361	-4 416 255	17 650 705
Iš viso	430 014 671	234 632 773	-126 198 543	113 438 253	-56 383 631	595 503 523

2 PASTABA TURTO STRUKTŪRA ATASKAITINIO LAIKOTARPIO PABAIGOJE

Turto arba emitento pavadinimas	Valstybės, į kurios vertybiniuose popierius investuota, pavadinimas	Valiutos, kuria yra turtas, pavadinimas	Nominalioji vertė (jeigu ji yra)	Metų palūkanų norma (jeigu ji yra)	Indėlio, investicijos pabaigos terminas (jeigu ji terminuota)	Tikroji vertė (Lt)	Turto, investicijos lyginamoji dalis (proc.)
Pinigai ir pinigų ekvivalentai						19 656 645	3,19
Sąskaita AB SEB banke (LTL)	-	LTL	3 494 701	2,89	-	3 494 701	0,57
Sąskaita AB SEB banke (EUR)		EUR	488 199	0,65		1 685 653	0,27
Sąskaita AB SEB banke (USD)	-	USD	1 483 730	0,22	-	3 656 355	0,59
Sąskaita AB SEB banke (SEK)	-	SEK	214 692	-	-	67 598	0,01
Sąskaita AB SEB banke (JPY)	-	JPY	49 542 330	-	-	1 278 440	0,21
SEB London Futures	-	EUR	550 759	-	-	1 901 662	0,31
SEB London Futures		USD	2 522 071			6 215 139	1,01
SEB London Futures		JPY	52 590 467			1 357 097	0,22
Investicijos						595 503 523	96,60
AB Sanitas	LT	LTL	-	-	-	100 764	0,02
Baltika	EE	EUR	-	-	-	2 034 848	0,33
HSBS GIF -US Equity	LU	USD	-	-	-	25 148 670	4,07
HSBC GIF-Asia X	LU	USD	-	-	-	10 878 762	1,75
HSBC GIF-BRIC MRKT-IC	LU	USD	-	-	-	16 743 584	2,72
HSBC GIF- Euroland EQ-IC	LU	EUR	-	-	-	11 678 386	1,89
HSBC GIF-Japanese Equity-AI	LU	JPY	-	-	-	13 173 033	2,14

Turto arba emitento pavadinimas	Valstybės, į kurios vertybiniuose popieriuose investuota, pavadinimas	Valiutos, kuria yra turtas, pavadinimas	Nominalioji vertė (jeigu ji yra)	Metų palūkanų norma (jeigu ji yra)	Indėlio, investicijos pabaigos terminas (jeigu ji terminuota)	Tikroji vertė (Lt)	Turto, investicijos lyginamoji dalis (proc.)
<i>JB Europe Growth-C</i>	LU	EUR	-	-	-	8 906 725	1,44
<i>JB Europe Stock Fund-C</i>	LU	EUR	-	-	-	9 735 017	1,58
<i>JB US Leading Stock Fund</i>	LU	USD	-	-	-	11 449 278	1,86
<i>JB US Value Stock Fund</i>	JAV	USD	-	-	-	12 771 602	2,07
<i>AB TEO LT</i>	LT	LTL	-	-	-	2 382 730	0,39
<i>Olympic Entertainment Group</i>	EE	EUR	-	-	-	4 172 008	0,68
<i>Raiffeisen-Eastern European Equities</i>	AT	EUR	-	-	-	9 623 959	1,56
<i>SEB Fund 1 - SEB Europe 1 Fund</i>	LU	EUR	-	-	-	9 109 644	1,48
<i>SEB Fund 1 - SEB Choice North America</i>	LU	USD	-	-	-	24 736 153	4,01
<i>SEB Fund 2-SEB Russia Fund</i>	LU	EUR	-	-	-	20 354 581	3,30
<i>NVS akcijų fondas</i>	LT	LTL	-	-	-	15 361 991	2,49
<i>SEB Sicav 1-SEB Eastern Europe ex Russia</i>	LU	EUR	-	-	-	8 294 204	1,35
<i>SEB Sicav 2 - SEB Europe</i>	LU	EUR	-	-	-	8 282 199	1,34
<i>Tallink Grupp</i>	EE	EUR	-	-	-	4 494 129	0,73
<i>Talina Kaubamaja AS</i>	EE	EUR	-	-	-	4 466 226	0,72
<i>AS Eastern Europe Real Estate Investment Trust</i>	EE	EUR	-	-	-	4 101 114	0,67
<i>JB Commodity Fund</i>	LU	EUR	-	-	-	16 066 520	2,61
<i>AK Bars Bank</i>	RU	USD	1 300 000	9,25	2011 06 20	2 875 706	0,47
<i>ATF Bank</i>	KZ	USD	1 200 000	9,25	2012 04 12	2 536 750	0,41
<i>EVRAZ Group SA</i>	RU	USD	300 000	8,88	2013 04 24	639 953	0,10
<i>Gaz Capital</i>	RU	EUR	900 000	4,56	2012 12 09	1 303 617	0,21
<i>AB Lietuvos energija</i>	LT	EUR	750 000	4,06	2009 09 29	2 670 305	0,43
<i>Mobile telesystems -CLS</i>	RU	USD	1 000 000	8,38	2010 10 14	1 274 938	0,21
<i>AB bankas NORD Lietuva</i>	LT	LTL	5 000 000		2010 06 07	4 553 357	0,74
<i>AB bankas NORD Lietuva</i>	LT	LTL	4 223 300	4,33	2009 09 26	4 320 102	0,70
<i>Parex Banka</i>	LV	EUR	1 500 000	5,63	2011 05 05	3 404 938	0,55
<i>AB Pieno žvaigždės</i>	LT	LTL	2 000 000	4,96	2009 10 02	2 025 122	0,33
<i>Steel Capital</i>	RU	USD	500 000	9,75	2013 07 29	1 098 290	0,18
<i>Bankas Snoras</i>	LT	EUR	3 501 000	7,00	2010 05 21	7 957 051	1,29
<i>OAD TMK</i>	LU	USD	700 000	10,00	2011 07 29	1 578 403	0,26
<i>Transcreditbank</i>	RU	USD	1 000 000	9,00	2011 06 25	1 214 777	0,20
<i>Transneft-Pref</i>	RU	EUR	800 000	5,38	2012 06 27	991 033	0,16
<i>Ursabk</i>	RU	EUR	820 000	7,00	2010 05 21	2 780 323	0,45
<i>VIMPELCOM</i>	RU	USD	1 000 000	8,00	2010 02 11	1 286 885	0,21
<i>Belgijos Karalystė</i>	BE	EUR	1 700 000	3,75	2015 09 28	6 175 878	1,00
<i>Čekijos Respublika</i>	CZ	EUR	2 000 000	5,00	2018 06 11	6 867 721	1,11
<i>Prancūzijos Respublika</i>	FR	EUR	2 075 000	3,75	2021 04 25	7 072 202	1,15
<i>Prancūzijos Respublika</i>	FR	EUR	2 750 000	4,00	2014 04 25	10 126 741	1,64
<i>Prancūzijos Respublika</i>	FR	EUR	4 380 000	5,50	2029 04 25	17 558 975	2,85
<i>Vokietijos Federacinė Respublika</i>	DE	EUR	133 000	3,75	2015 01 04	491 930	0,08
<i>Vokietijos Respublika</i>	DE	EUR	200 000	3,75	2017 01 04	730 988	0,12

Vokietijos Federacinė Respublika	DE	EUR	600 000	3,75	2019 01 04	2 191 607	0,36
Graikijos Respublika	GR	EUR	1 500 000	7,50	2013 05 20	6 007 863	0,97
Vengrijos Respublika	HU	EUR	1 000 000	3,50	2016 07 18	2 943 114	0,48
Vengrijos Respublika	HU	EUR	761 000	3,63	2011 10 28	2 618 752	0,42
Vengrijos Respublika	HU	EUR	1 714 000	4,50	2014 01 29	5 663 790	0,92
Airijos Respublika	IE	EUR	2 100 000	4,50	2018 10 18	7 017 316	1,14
Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	EUR	3 670 000	4,85	2018 02 07	9 599 694	1,56
Nyderlandų Karalystė	NL	EUR	1 550 000	3,25	2015 07 15	5 567 420	0,90
Lenkijos Respublika	PL	EUR	1 300 000	4,50	2013 02 05	4 575 300	0,74
Lenkijos Respublika	PL	EUR	1 388 000	5,50	2012 03 12	5 063 547	0,82
Lenkijos Respublika	PL	EUR	2 000 000	5,63	2018 06 20	6 756 808	1,10
Rumunijos Respublika	RO	EUR	900 000	8,50	2012 05 08	3 349 146	0,54
Slovakijos Respublika	SK	EUR	2 700 000	4,50	2014 05 20	9 560 273	1,55
Slovakijos Respublika	SK	EUR	4 000 000	4,38	2017 05 15	13 475 081	2,19
Slovėnijos Respublika	SI	EUR	2 000 000	4,00	2018 03 22	12 184 838	1,98
Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	EUR	1 505 900		2010 02 22	4 995 335	0,81
Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LTL	5 000 000		2009 09 02	4 942 424	0,80
Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LTL	515 300	3,90	2009 07 16	534 613	0,09
<i>Mortgage Bank of Latvia</i>	LV	EUR	1 748 500	5,44	2012 02 15	5 639 393	0,91
<i>HSBC GIF-EU Core BD-IC</i>	LU	EUR	-	-	-	27 114 356	4,40
<i>JB Euro Government Bond Fund-C</i>	LU	EUR	-	-	-	29 014 002	4,71
<i>Raiffeisen Euro Bond</i>	AT	EUR	-	-	-	35 273 102	5,72
<i>Raiffeisen EuroPlus Bond</i>	AT	EUR	-	-	-	36 410 881	5,91
NVS obligacijų fondas	LT	LTL	-	-	-	9 402 756	1,53
Pretenzijos dėl išvestinių finansinių priemonių :	-	-	-	-	-	1 281 677	0,21
CME USD/EUR CURR FUT		USD			2009 09 14	378 424	0,06
EUREX BUND FUTURE		EUR			2009 09 08	903 253	0,15
Kitos gautinos sumos						26 315	-
Iš viso	-	-	-	-	-	616 468 160	100,00

3 PASTABA KITOS PAJAMOS

(Lt)

Straipsnis	2009 01 01 – 2009 06 30	2008 01 01 – 2008 06 30
Valiutos pirkimo ir pardavimo pajamos	262 288	190 679
Gauta retrocesija	531 171	698 792
Išvestinių finansinių priemonių pajamos	17 512 061	18 507 893
Kitos pajamos		8
Iš viso	18 305 520	19 397 372

4 PASTABA VALDYMO SĄNAUDOS

(Lt)

Straipsnis	2009 01 01 – 2009 06 30	2008 01 01 – 2008 06 30
Turto valdymo mokestis	2 541 212	2 131 709
Pardavimo mokestis	2 662 782	3 377 624
Iš viso	5 203 994	5 509 333

5 PASTABA

KITOS SĄNAUDOS

(Lt)

Straipsnis	2009 01 01 – 2009 06 30	2008 01 01 – 2008 06 30
Kitos sąnaudos		24
Valiutos pirkimo ir pardavimo sąnaudos	107 874	466 184
Išvestinių finansinių priemonių sąnaudos	10 938 343	5 916 986
Iš viso	11 046 217	6 383 194

VII. INFORMACIJA APIE PENSIJŲ FONDO DALYVIUS

-

VIII. IŠORINIAI PINIGŲ SRAUTAI

28. Per ataskaitinį laikotarpį faktiškai gautos lėšos:

Bendra gautų lėšų suma		94 821 767
Periodinės įmokos į pensijų fondą	iš Valstybinio socialinio draudimo fondo	88 757 983
	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	332 696
	iš kitos pensijų kaupimo bendrovės	5 731 088
Kitos gautos lėšos (nurodyti šaltinį ir gautų lėšų sumą), iš viso		

29. Išmokėtos lėšos:

Bendra išmokėtų lėšų suma		14 337 091
Pensijų išmokos	vienkartinės išmokos dalyviams	201 173
	periodinės išmokos dalyviams	
	išmokos anuiteto įsigijimui	
Į kitus pensijų fondus pervestos lėšos	valdomus tos pačios pensijų kaupimo bendrovės	3 117 846
	valdomus kitos pensijų kaupimo bendrovės	10 755 824
Išstojusiems dalyviams išmokėtos lėšos (pildoma tik papildomo savanoriško kaupimo pensijų fondų atveju)		
Paveldėtojams išmokėtos lėšos		262 248
Kitais pagrindais išmokėtos lėšos (nurodyti šaltinį ir išmokėtų lėšų sumą), iš viso		

IX. INFORMACIJA APIE GARANTIJŲ REZERVĄ

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

-

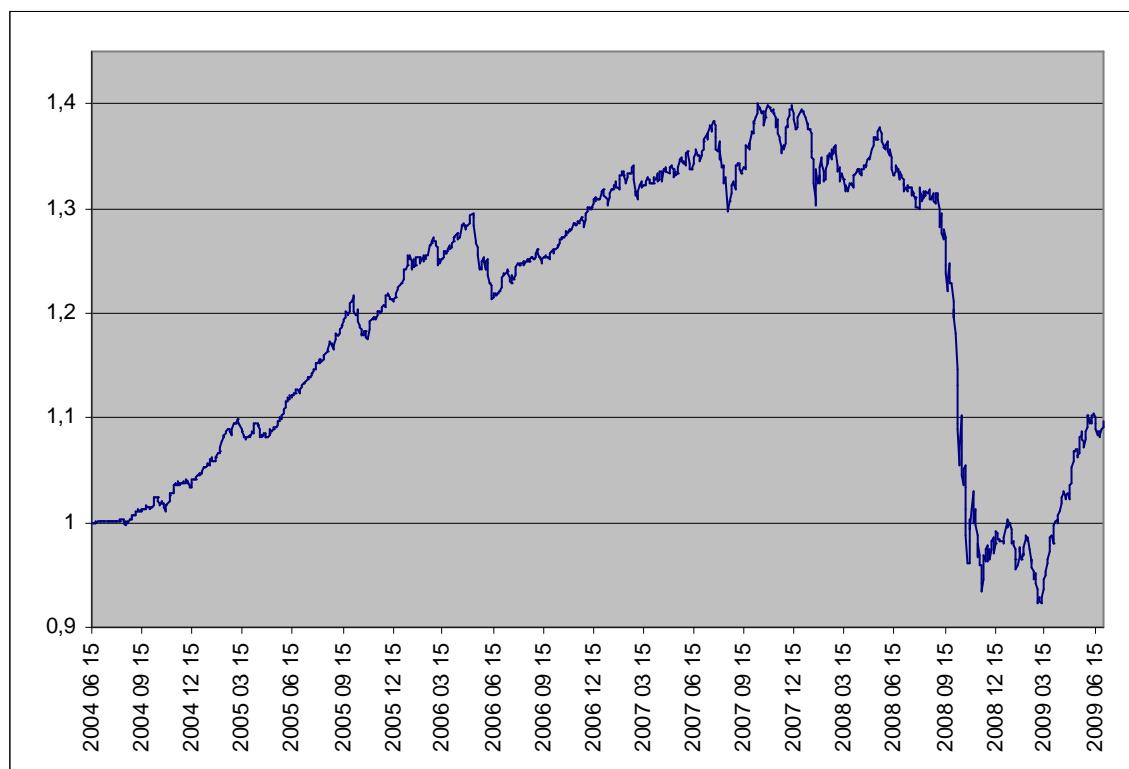
X. INFORMACIJA APIE PENSIJŲ FONDO REIKMĖMS PASISKOLINTAS LĖŠAS

31. Pensijų fondo reikmėms pasiskolintos lėšos ataskaitinio laikotarpio pabaigoje:

Eil. Nr.	Paskolos suma	Paskolos valiuta	Paskolos paėmimo data	Paskolos gražinimo terminas	Palūkanų dydis	Skolinimosi tikslas	Kreditorius	Skolintų lėšų dalis, lyginant 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.



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) 268 1594, faks. (8 5) 268 1575, e. paštas info.invest@seb .lt

Tvirtinu _____ Inga Riabovaitė, Operacijų departamento vadovė,
tel. (8 5) 268 1594, faks. (8 5) 268 1575, e. paštas info.invest@seb .lt

Tvirtinu _____ Vida Markelionienė, vyriausioji buhalterė,
tel. (8 5) 268 1594, faks. (8 5) 268 1575, e. paštas info.invest@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.

-
