



2012 metų ataskaita
SEB Pensija 2

2012 m. gruodžio 31 d.

TURINYS

I. BENDROJI INFORMACIJA	3
II. GRYNŲJŲ AKTYVŲ, APSKAITOS VIENETŲ SKAIČIUS IR VERTĖ.....	3
III. ATSKAITYMAI IŠ PENSIJŲ TURTO.....	3
IV. INFORMACIJA APIE PENSIJŲ FONDO INVESTICINIŲ PRIEMONIŲ PORTFELĮ	4
V. PENSIJŲ FONDO LYGINAMASIS INDEKSAS, INVESTICIJŲ GRAŽA IR RIZIKOS RODIKLIAI	5
VI. PENSIJŲ FONDO FINANSINĖ BŪKLĖ	7
VII. INFORMACIJA APIE PENSIJŲ FONDO DALYVIUS	32
VIII. IŠORINIAI PINIGŲ SRAUTAI	32
IX. INFORMACIJA APIE GARANTIJŲ REZERVĄ.....	33
X. INFORMACIJA APIE PENSIJŲ FONDO REIKMĖMS PASISKOLINTAS LĒŠAS.....	33
XI. KITA INFORMACIJA	33
XII. ATSAKINGI ASMENYS.....	34

PENSIJŲ FONDO *SEB PENSIIA 2*

2012 METŲ 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 – 2012 metų dvylika mėnesių.
3. Duomenys apie valdymo įmonę:
 - 3.1. pavadinimas ir įmonės kodas – UAB *SEB investicijų valdymas*, įmonės kodas 125277981;
 - 3.2. buveinė (adresas) – Olimpiečių g. 1, 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 – VJK – 001;
 - 3.5. pensijų fondo valdytojo vardas, pavardė, pareigos (asmuo ar asmenys, priimančys investicinius sprendimus) – Ignas

Pliušksys, portfelijų 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 grynujų aktyvų, apskaitos vienetų skaičių ir vertę:

(Žr. 22.3. punktas, 2 Pastaba)

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

(Žr. 22.3. punktas, 3 Pastaba)

III. ATSKAITYMAI IŠ PENSIJŲ TURTO

7. 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 49.6 punkte:

(Žr. 22.3. punktas, 19 Pastaba)

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

(Žr. 22.3. punktas, 9 Pastaba)

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

-

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

	Po 1 metų	Po 3 metų	Po 5 metų	Po 10 metų
Sumokėta atskaitymų (Lt)	399,43	610,29	838,25	1 492,32
Sukaupta suma, jei nebūtų atskaitymų	10 500,00	11 576,25	12 762,82	16 288,95
Sukaupta suma, esant dabartiniams atskaitymų dydžiai	10 085,58	10 903,31	11 787,36	14 323,89

IV. INFORMACIJA APIE PENSIJŲ FONDO INVESTICINIŲ PRIEMONIŲ PORTFELĮ

11. Ataskaitinio laikotarpio pabaigos investicinių priemonių portfelio sudėtis:

(Žr. 22.3. punktas, 5 Pastaba)

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

Priemonės pavadinimas	Priemonės rūšis	Pelnas/nuostolis valiuta	Valiutos kodas	Priemonės panaudojimo tikslas	Pastabos
CBOE VIX FUTURE	Ateities sandoris (angl. <i>future</i>)	(183 200)	USD	VP pasirinkimo ir kainų kitimo rizikos valdymas	Reguliuojamų rinkų IP
CME USD/EUR CURR FUTURE	Ateities sandoris (angl. <i>future</i>)	(32 525)	USD	Valiutų kursų svyravimo rizikos valdymas	Reguliuojamų rinkų IP
EURO BOBL FUTURE	Ateities sandoris (angl. <i>future</i>)	(194 690)	EUR	Palūkanų normų rizikos valdymas	Reguliuojamų rinkų IP
EURO BUND FUTURE	Ateities sandoris (angl. <i>future</i>)	154 660	EUR	Palūkanų normų rizikos valdymas	Reguliuojamų rinkų IP
EURO BUXL FUTURE	Ateities sandoris (angl. <i>future</i>)	(17 540)	EUR	Palūkanų normų rizikos valdymas	Reguliuojamų rinkų IP
EURO SCHATZ FUTURE	Ateities sandoris (angl. <i>future</i>)	9 170	EUR	Palūkanų normų rizikos valdymas	Reguliuojamų rinkų IP

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

(Žr. 22.3. punktas, 8 Pastaba)

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

-

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

Ataskaitiniu laikotarpiu fondo investicijų portfelis atitiko taisyklėse nustatytą investicijų strategiją.

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

Ataskaitiniu laikotarpiu fondo investicijų portfelio vertės pokyčiams didžiausią įtaką turėjo:

1. Pasaulio centrinių bankų tęsiama žemų palūkanų politika. Pasaulio ekonomika 2012 metais augo vangiai, nedarbas išliko didelis, todėl centriniai bankai tęsė priemonių, skirtų aukštam likvidumui rinkose palaikyti, taikymą. Tai lėmė akcijų, įmonių obligacijų ir besivystančių šalių vyriausybės obligacijų indeksų vertės didėjimą ir turėjo teigiamą įtaką fondo vieneto grąžai.
2. Žaliavų kainų mažėjimas. Metų pradžioje žaliavų kainos kilo dėl optimizmo rinkose, o naftos kaina – ir dėl konflikto tikimybės Artimuosiuose Rytuose. Tačiau padidėjęs neaiškumas dėl pasaulio ekonomikos vystymosi didžiausią neigiamą įtaką darė žaliavoms, todėl jų kainos nukrito.
3. Lietuvos Respublikos Vyriausybės obligacijų priedo už riziką mažėjimas. 2012 metais Lietuva sėkmingai pasiskolino tarptautinėse rinkose, gerėjo Lietuvos ekonominė situacija, todėl Lietuvos Respublikos Vyriausybės obligacijų kainos kilo, o pajamingumas mažėjo.
4. Įmonių obligacijų priedo už riziką mažėjimas. 2011 metų pabaigoje Europos centrinio banko teiktos ilgesnio negu įprasta laikotarpio paskolos bankams pirmiausia lėmė finansų sektoriaus įmonių obligacijų brangimą 2012 metų pradžioje. Kitų sektorių įmonių obligacijų kainų pokyčiai irgi buvo teigiami. Teigiamą įtaką įmonių obligacijoms darė ir vyriausybės obligacijų mažėjantis pajamingumas.

V. PENSIJŲ FONDO LYGINAMASIS INDEKSAS, INVESTICIJŲ GRĄŽA IR RIZIKOS RODIKLIAI

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

(Žr. 22.3. punktas, 18 Pastaba)

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

(Žr. 22.3. punktas, 18 Pastaba)



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

Pensijų kaupimo sutartyje nurodyta, kad tikėtina fondo *SEB pensija 2* ilgojo laikotarpio vidutinė metinė grąža yra 7–8 procentai. Lankstuko „SEB pensija“ skiltyje „Kiek galite sukaupti“ daroma prielaida, kad fondo *SEB pensija 2* vidutinė metinė grąža yra 7 procentai. Faktiškai 2012 metų grąža buvo didesnė (13,2 procento). 2012 metais nepaisant gana lėto pasaulio ekonomikos augimo, daugelio turto klasių kainos kilo daugiau negu įprastai. Tam daug įtakos turėjo agresyvūs centrinių bankų veiksmai, kurie padėjo išlaikyti optimistines investuotojų nuotaikas.

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

(Žr. 22.3. punktas, 18 Pastaba)

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

-

VI. PENSIJŲ FONDO FINANSINĖ BŪKLĖ

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

22.1. grynujų aktyvų ataskaitą;

GRYNUJŲ AKTYVŲ ATASKAITA (LT) 2012 m. gruodžio 31 d.

Eil. nr.	Straipsniai	Pastabos Nr.	2012 12 31	2011 12 31
A.	TURTAS		1 021 146 494	865 467 868
I.	PINIGAI	5	5 371 014	13 021 090
II.	TERMINUOTIEJI INDĖLIAI		-	-
III.	PINIGŲ RINKOS PRIEMONĖS		-	-
III.1.	Valstybės išdo vekseliai		-	-
III.2.	Kitos pinigų rinkos priemonės		-	-
IV.	PERLEIDŽIAMIEJI VERTYBINIAI POPIERIAI	4, 5, 6	1 015 501 189	852 285 381
IV.1.	Ne nuosavybės vertybiniai popieriai		244 094 445	234 299 193
IV.1.1.	Vyriausbių ir centrinių bankų arba jų garantuoti ne nuosavybės vertybiniai popieriai		239 244 820	229 559 553
IV.1.2.	Kiti ne nuosavybės vertybiniai popieriai		4 849 625	4 739 640
IV.2.	Nuosavybės vertybiniai popieriai		-	-
IV.3.	Kitų kolektyvinio investavimo subjektų investiciniai vienetai ir akcijos		771 406 744	617 986 188
V.	GAUTINOS SUMOS	5	20 364	3 932
V.1.	Investicijų pardavimo sandorių gautinos sumos		-	-
V.2.	Kitos gautinos sumos		20 364	3 932
VI.	INVESTICINIS IR KITAS TURTAS	5, 8	253 927	157 465
VI.1.	Investicinis turtas		-	-
VI.2.	Išvestinės finansinės priemonės	8	253 927	157 465
VI.3.	Kitas turtas		-	-
B.	ĮSIPAREIGOJIMAI	5, 8	2 731 551	2 177 868
I.	Finansinio ir investicinio turto pirkimo įsipareigojimai		-	-
II.	Įsipareigojimai kredito įstaigoms		-	-
III.	Įsipareigojimai pagal išvestinių finansinių priemonių sutartis	8	94 676	291 439
IV.	Valdymo įmonei ir depozitoriumui mokėtinos sumos	13	763 193	742 649
V.	Kitos mokėtinos sumos ir įsipareigojimai		1 873 682	1 143 780
C.	GRYNIEJI AKTYVAI		1 018 414 943	863 290 000

9– 31 puslapiuose pateiktas aiškinamasis raštas yra neatskiriama šių finansinių ataskaitų dalis.

22.2. grynųjų aktyvų pokyčių ataskaitą;

GRYNŲJŲ AKTYVŲ POKYČIŲ ATASKAITA (LT)
2012 m. gruodžio 31 d.

Eil. nr.	Straipsniai	Pastabos Nr.	2012 01 01-2012 12 31	2011 01 01-2011 12 31
I.	GRYNŲJŲ AKTYVŲ VERTĖ ATASKAITINIO LAIKOTARPIO PRADŽIOJE		863 290 000	853 877 362
II.	GRYNŲJŲ AKTYVŲ VERTĖS PADIDĖJIMAS		211 235 843	165 832 570
II.1.	Dalyvių įmokos į fondą	20	59 790 448	77 621 081
II.2.	Iš kitų fondų gautos sumos	20	14 958 749	12 750 736
II.3.	Garantinės įmokos		-	-
II.4.	Palūkanų pajamos		8 611 431	8 512 584
II.5.	Dividendai		1 322 742	136 605
II.6.	Pelnas dėl investicijų vertės pasikeitimo ir pardavimo		122 954 199	62 558 971
II.7.	Pelnas dėl užsienio valiutos kursų pokyčio		912 853	2 013 841
II.8.	Išvestinių finansinių priemonių pelnas		293 225	382 238
II.9.	Kitas grynųjų aktyvų vertės padidėjimas		2 392 196	1 856 514
	PADIDĖJO IŠ VISO:		211 235 843	165 832 570
III.	GRYNŲJŲ AKTYVŲ VERTĖS SUMAŽĖJIMAS		56 110 900	156 419 932
III.1.	Išmokos fondo dalyviams	20	3 765 502	3 241 450
III.2.	Išmokos kitiems fondams	20	28 468 920	32 936 459
III.3.	Nuostoliai dėl investicijų vertės pasikeitimo ir pardavimo		11 595 240	108 231 231
III.4.	Nuostoliai dėl užsienio valiutos kursų pokyčio		921 313	1 096 136
III.5.	Išvestinių finansinių priemonių sandorių nuostoliai		-	-
III.6.	Valdymo sąnaudos:		11 359 925	10 914 656
III.6.1.	Atlyginimas valdymo įmonei	19	11 359 925	10 914 656
III.6.2.	Atlyginimas depozitoriumui		-	-
III.6.3.	Atlyginimas tarpininkams		-	-
III.6.4.	Audito sąnaudos		-	-
III.6.5.	Kitos sąnaudos		-	-
III.7.	Kitas grynųjų aktyvų vertės sumažėjimas		-	-
III.8.	Sąnaudų kompensavimas (-)		-	-
III.9.	Pelno paskirstymas		-	-
	SUMAŽĖJO IŠ VISO:		56 110 900	156 419 932
IV.	GRYNŲJŲ AKTYVŲ VERTĖ ATASKAITINIO LAIKOTARPIO PABAIGOJE		1 018 414 943	863 290 000

9– 31 puslapiuose pateiktas aiškinamasis raštas yra neatskiriama šių finansinių ataskaitų dalis.

AIŠKINAMASIS RAŠTAS

Bendroji informacija

Valstybinio socialinio draudimo įmokos dalies kaupimo pensijų fondo *Pensija 2* (toliau – Fondas) taisyklės Nr. PF-V02-K001-001(007) patvirtino Lietuvos Respublikos vertybinių popierių komisija 2003 m. rugpjūčio 28 d. (paskutiniai pakeitimai įsigaliojo – 2010 m. vasario 21 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. VJK – 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 ataskaitos parengtos vadovaujantis Verslo apskaitos standartais, bei kitais Lietuvos Respublikoje finansinę apskaitą reglamentuojančiais teisės aktais.

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

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

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

Finansiniai Fondo metai sutampa su kalendoriniais metais.

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

Nuo 2010 m. sausio 1 d. investicinių priemonių pardavimo savikainos nurašymo metodas FIFO pakeistas į svertinio vidurkio metodą.

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

(a) Finansinės rizikos valdymo politika

Su Fondo investicijomis yra susijusi ši rizika:

- a) palūkanų normų rizika. Investavimo objektai, kaip ir daugelis skolos VP, susiję su rizika, kad VP vertė gali sumažėti ar padidėti dėl pasikeitusių palūkanų normų, t. y. investicijų vertė mažėja didėjant palūkanų normoms, ir atvirkščiai, investicijų vertė didėja, kai palūkanų normos mažėja. Valdydama šią riziką, bendrovė gali naudoti išvestines finansines priemones ir keisti vidutinę fondo obligacijų finansinę trukmę;
- b) rinkų ir kredito rizika. Nors konkretūs VP gali suteikti galimybę gauti didesnę investicijų grąžą negu visa rinka ar susijęs rinkos segmentas, visos rinkos vertė gali sumažėti ar padidėti dėl besikeičiančių palūkanų normų, naujo priežiūros institucijų nustatyto reglamentavimo, pasikeitusių ekonomikos sąlygų. VP kreditingumo kokybė priklauso nuo emitento sugebėjimo laiku mokėti palūkanas ir suėjus terminui išpirkti emisiją. Kuo mažesnis emitentui suteiktas kredito reitingas, tuo didesnė rizika, kad emitentas neįvykdys savo įsipareigojimų fondo dalyviams. VP kreditingumo rizika taip pat priklauso ir nuo banko, laiduojančio už konkrečius skolos VP, finansinio pajėgumo. Valdydama šią riziką, bendrovė gali naudoti išvestines finansines priemones, kurių vertė kinta kartu su emitento kreditingumo kokybe;

- c) VP pasirinkimo rizika. Nors fondo turtas investuojamas į fiksuoto pajamingumo VP, kurių vertė paprastai kinta nedaug, išlieka rizika, kad įsigytų VP kaina gali skirtis nuo prognozuotos kainos. Bendrovė valdo VP pasirinkimo riziką laikydamosi nustatytų fondo investicijų portfelio diversifikavimo reikalavimų;
- d) 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;
- e) infliacijos / perkamosios galios rizika. Infliacijos tempams spartėjant, skolos VP atkarpų ir pagrindinės sumos perkamoji vertė ir kaina paprastai mažėja. Bendrovė gali valdyti šią riziką naudodama išvestines finansines priemones, kurių vertė kinta kartu su infliacijos augimo pokyčiu, gali investuoti į obligacijas, kurių vertė yra susijusi su infliacijos tempais ir keisti vidutinę fondo obligacijų finansinę trukmę.

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

(b) Turto padidėjimo ir sumažėjimo traukimo į apskaitą principai

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

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

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

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.

(c) Grynųjų aktyvų vertės ir vienetų vertės apskaičiavimo principai

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

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

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

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

Turto ar įsipareigojimų tikroji vertė nustatoma laikantis šių patikimumo lygių:

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

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

Fondo apskaitos vienetai išreiškia dalyviui priklausantią turto dalį fonde.

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

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

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

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

Pradinė fondo vieneto vertė – 1 Lt (vienas litas).

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

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

(d) Pinigų ekvivalentai

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

(e) Finansinis turtas

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

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

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

(f) Finansiniai įsipareigojimai

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

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

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

(g) Išvestinės finansinės priemonės

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

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

Kita informacija

Informacija apie investavimo, finansinės rizikos valdymo politiką, investicijų portfelio struktūrą ir atskaitymų valdymo įmonei ir depozitoriumui taisyklės pateikiamos <http://www.seb.lt/pow/wcp/seblt.asp> → *Pensija* → *Pensijų fondų taisyklės ir ataskaitos*.

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

Reikšmingų finansinių ataskaitų sumų nebuvo.

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

	Ataskaitinio laikotarpio pradžioje (2012 01 02)	Ataskaitinio laikotarpio pabaigoje (2012 12 31)	Prieš metus (2011 12 31)	Prieš dvejus metus (2010 12 31)
Grynujų aktyvų vertė, Lt	862 740 430	1 018 414 943	863 290 000	853 877 362
Apskaitos vieneto vertė, Lt	1,2983	1,4680	1,2989	1,3645
Apskaitos vienetų skaičius	664 502 092	693 736 665	664 636 687	625 794 232

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

2012 m. gruodžio 31 d.

	Apskaitos vienetų skaičius	Vertė, Lt
Apskaitos vienetų skaičius (konvertuojant pinigines lėšas į apskaitos vienetus)	52 153 252	74 861 879
Apskaitos vienetų skaičius (konvertuojant apskaitos vienetus į pinigines lėšas)	23 053 274	32 347 104
Skirtumas	29 099 978	42 514 775

2011 m. gruodžio 31 d.

	Apskaitos vienetų skaičius	Vertė, Lt
Apskaitos vienetų skaičius (konvertuojant pinigines lėšas į apskaitos vienetus)	66 282 018	90 429 596
Apskaitos vienetų skaičius (konvertuojant apskaitos vienetus į pinigines lėšas)	27 439 563	36 235 688
Skirtumas	38 842 455	54 193 908

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

Investicijos	Pokytis					
	praėjusio ataskaitinio laikotarpio pabaigoje	įsigyta	parduota (išpirkta)	vertės padidėjimas	vertės sumažėjimas	ataskaitinio laikotarpio pabaigoje
Ne nuosavybės vertybiniai popieriai	234 299 193	77 070 957	(97 607 067)	84 211 190	(53 879 828)	244 094 445
Vyriausybės ir centrinių bankų arba jų garantuoti ne nuosavybės vertybiniai popieriai	229 559 553	77 070 957	(97 607 809)	84 022 825	(53 800 706)	239 244 820
Kiti ne nuosavybės vertybiniai popieriai	4 739 640	-	742	188 365	(79 122)	4 849 625
Kitų kolektyvinio investavimo subjektų investiciniai vienetai ir akcijos	617 986 188	327 042 100	(270 201 050)	525 028 415	(428 448 909)	771 406 744
Iš viso	852 285 381	404 113 057	(367 808 117)	609 239 605	(482 328 737)	1 015 501 189

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

2012 m. gruodžio 31 d.

Ko- das	Emitento (KIS, kredito įstaigos, banko pavadinimas)	Šalis	ISIN kodas / Priemonės pavadinimas	Valiuta	Kiekis, vnt.	Valdytojas	Bendra nominali vertė, Lt	Investicinis sandoris (pozicija)	Sandorio (pozicijos) vertė	Kita sandorio šalis	Bendra įsigijimo vertė, Lt	Bendra rinkos vertė, Lt	Palū- kanų norma, %	Rinka (šaltinis), pagal kurios duomenis nustatyta rinkos vertė (tinklalapio adresas)	KIS tipas	Išpirkimo / konvertavi- mo data / terminas	Dalis GA / dalis portfely- je, %
1	Akcijos	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
1.1	Nuosavybės vertybiniai popieriai, įtraukti į Oficialųjį ar į atitinkantį prekybos sąrašą	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Iš viso:	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
1.2	Nuosavybės vertybiniai popieriai, įtraukti į Papildomąjį ar į atitinkantį prekybos sąrašą	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Iš viso:	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
1.3	Nuosavybės vertybiniai popieriai, kuriais prekiaujama kitose reguliuojamose rinkose	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Iš viso:	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
1.4	Išleidžiami nauji nuosavybės vertybiniai popieriai	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Iš viso:	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Iš viso Akcijos:	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
2	Obligacijos	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
2.1	Ne nuosavybės vertybiniai popieriai, įtraukti į Oficialųjį ar į atitinkantį prekybos sąrašą	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Iš viso:	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
2.2	Ne nuosavybės vertybiniai popieriai, įtraukti į Papildomąjį ar į atitinkantį prekybos sąrašą	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT0000611014	LTL	79 299	-	7 929 900	-	-	-	8 034 349	8 645 280	1,85	-	-	2016 02 10	0,85

Ko- das	Emitento (KIS, kredito įstaigos, banko pavadinimas)	Šalis	ISIN kodas / Priemonės pavadinimas	Valiuta	Kiekis, vnt.	Valdytojas	Bendra nominali vertė, Lt	Investicinis sandoris (pozicija)	Sandorio (pozicijos) vertė	Kita sandorio šalis	Bendra įsigijimo vertė, Lt	Bendra rinkos vertė, Lt	Palū- kanų norma, %	Rinka (šaltinis), pagal kurios duomenis nustatyta rinkos vertė (tinklalapio adresai)	KIS tipas	Išpirkimo / konvertavi- mo data / terminas	Dalis GA / dalis portfelje, %
-	Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT0000605107	LTL	119 050	-	11 905 000	-	-	-	12 644 543	13 201 443	1,55	-	-	2015 04 29	1,30
-	Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT0000603235	LTL	79 500	-	7 950 000	-	-	-	8 058 117	8 277 675	0,45	-	-	2013 08 05	0,81
-	DnB NORD bankas	LT	LT0000431132	LTL	47 000	-	4 700 000	-	-	-	4 685 464	4 849 625	0,40	-	-	2013 10 07	0,48
-	Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT0000605115	LTL	104 000	-	10 400 000	-	-	-	10 447 926	11 533 766	2,05	-	-	2016 10 20	1,13
-	Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT0000603243	LTL	99 172	-	9 917 200	-	-	-	10 429 572	10 852 154	1,53	-	-	2015 02 27	1,07
-	Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT0000607053	LTL	79 350	-	7 935 000	-	-	-	8 289 813	9 195 027	2,73	-	-	2018 03 28	0,90
	IŠ viso:				607 371	-	60 737 100	-	-	-	62 589 784	66 554 970		-	-		6,53
2.3	Ne nuosavybės vertybiniai popieriai, kuriais prekiaujama kitose reguliuojamose rinkose	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	Slovakijos Respublika	SK	XS0192595873	EUR	2 700	-	9 322 560	-	-	-	9 173 076	10 128 866	0,21	-	-	2014 05 20	0,99
-	Prancūzijos Respublika	FR	FR0010192997	EUR	2 800	-	9 667 840	-	-	-	11 060 233	11 505 067	1,62	-	-	2021 04 25	1,13
-	Nyderlandų Karalystė	NL	NL0000102283	EUR	920	-	3 176 576	-	-	-	3 355 900	3 656 781	0,22	-	-	2016 07 15	0,36
-	Vokietijos Federacine Respublika	DE	DE0001135267	EUR	133	-	459 222	-	-	-	451 219	511 055	(0,04)	-	-	2015 01 04	0,05
-	Prancūzijos Respublika	FR	FR0000571218	EUR	1 320	-	4 557 696	-	-	-	5 697 324	6 502 698	2,55	-	-	2029 04 25	0,64
-	Vokietijos Federacine Respublika	DE	DE0001135317	EUR	200	-	690 560	-	-	-	688 262	815 372	0,15	-	-	2017 01 04	0,08
-	Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	XS0327304001	EUR	3 670	-	12 671 776	-	-	-	5 597 353	14 791 061	2,25	-	-	2018 02 07	1,45
-	Slovakijos Respublika	SK	XS0299989813	EUR	4 000	-	13 811 200	-	-	-	13 781 897	16 125 522	1,07	-	-	2017 05 15	1,58
-	Slovėnijos Respublika	SI	XS0292653994	EUR	2 320	-	8 010 496	-	-	-	7 554 173	8 323 492	3,83	-	-	2018 03 22	0,82
-	Belgijos Karalyste	BE	BE0000306150	EUR	1 320	-	4 557 696	-	-	-	4 599 515	5 039 251	0,22	-	-	2015 09 28	0,49
-	Vokietijos Federacine Respublika	DE	DE0001135374	EUR	600	-	2 071 680	-	-	-	2 201 991	2 541 620	0,53	-	-	2019 01 04	0,25
-	Prancūzijos Respublika	FR	FR0010061242	EUR	575	-	1 985 360	-	-	-	2 165 293	2 142 099	0,05	-	-	2014 04 25	0,21
-	Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	XS0435153068	EUR	2 250	-	7 768 800	-	-	-	8 855 560	9 152 152	0,52	-	-	2014 06 22	0,90
-	Austrijos Respublika	AT	AT0000383864	EUR	625	-	2 158 000	-	-	-	2 709 464	3 319 799	2,13	-	-	2027 07 15	0,33
-	Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	XS0457764339	USD	1 200	-	3 127 200	-	-	-	3 543 194	3 541 452	1,65	-	-	2015 01 15	0,35
-	Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	XS0485991417	USD	709	-	1 847 654	-	-	-	1 745 920	2 464 781	2,63	-	-	2020 02 11	0,24
-	Belgijos Karalyste	BE	BE0000315243	EUR	700	-	2 416 960	-	-	-	2 610 684	2 901 478	1,15	-	-	2019 03 28	0,28
-	Vokietijos Federacine	DE	DE0001135218	EUR	400	-	1 381 120	-	-	-	1 498 617	1 442 591	4,31	-	-	2013 01 04	0,14

Ko- das	Emitento (KIS, kredito įstaigos, banko pavadinimas)	Šalis	ISIN kodas / Priemonės pavadinimas	Valiuta	Kiekis, vnt.	Valdytojas	Bendra nominali vertė, Lt	Investicinis sandoris (pozicija)	Sandorio (pozicijos) vertė	Kita sandorio šalis	Bendra įsigijimo vertė, Lt	Bendra rinkos vertė, Lt	Palū- kanų norma, %	Rinka (šaltinis), pagal kurios duomenis nustatyta rinkos vertė (tinklalapio adresas)	KIS tipas	Išpirkimo / konvertavi- mo data / terminas	Dalis GA / dalis portfely- je, %
-	Respublika																
-	Prancūzijos Respublika	FR	FR0010171975	EUR	2 550	-	8 804 640	-	-	-	8 739 944	10 783 899	3,15	-	-	2055 04 25	1,06
-	Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	XS0541528682	USD	3 025	-	7 883 150	-	-	-	8 088 176	9 028 101	2,19	-	-	2017 09 14	0,89
-	Nyderlandų Karalystė	NL	NL0009086115	EUR	2 800	-	9 667 840	-	-	-	10 940 341	11 738 213	0,90	-	-	2019 07 15	1,15
-	Vokietijos Federacine Respublika	DE	DE0001135366	EUR	1 900	-	6 560 320	-	-	-	7 775 615	10 306 293	2,11	-	-	2040 07 04	1,01
-	Vokietijos Federacine Respublika	DE	DE0001135424	EUR	1 250	-	4 316 000	-	-	-	4 051 332	4 924 801	0,98	-	-	2021 01 04	0,48
-	Vokietijos Federacine Respublika	DE	DE0001141596	EUR	1 750	-	6 042 400	-	-	-	5 923 099	6 522 984	0,01	-	-	2016 02 26	0,64
-	Slovėnijos Respublika	SI	SI0002103149	EUR	1 500	-	5 179 200	-	-	-	5 137 613	5 161 634	5,07	-	-	2021 01 18	0,51
-	Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	XS0602546136	USD	170	-	443 020	-	-	-	436 551	555 350	2,88	-	-	2021 09 03	0,05
-	Slovėnijos Respublika	SI	SI0002102935	EUR	2 000	-	6 905 600	-	-	-	7 143 226	7 275 689	2,64	-	-	2014 04 02	0,71
-	Vokietijos Federacine Respublika	DE	DE0001135085	EUR	200	-	690 560	-	-	-	774 014	974 742	1,85	-	-	2028 07 04	0,10
-	Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	XS0739988086	USD	260	-	677 560	-	-	-	675 701	888 044	3,03	-	-	2022 02 01	0,09
-	Prancūzijos Respublika	FR	FR0011059088	EUR	1 150	-	3 970 720	-	-	-	4 085 474	4 474 588	1,76	-	-	2021 10 25	0,44
	Iš viso:	-	-	-	44 997	-	150 823 406	-	-	-	151 060 761	177 539 475		-	-	-	17,43
2.4	Išleidžiami nauji ne nuosavybės vertybiniai popieriai	-	-	-	-	-		-	-	-				-	-	-	
	Iš viso:	-	-	-	-	-		-	-	-				-	-	-	
	Iš viso Obligacijos:	-	-	-	652 368	-	211 560 506	-	-	-	213 650 545	244 094 445		-	-	-	23,97
3	KIS	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-		-	-	-	
3.1	Kolektyvinių investavimo subjektų, atitinkančių Kolektyvinių investavimo subjektų 61 str. 1d. reikalavimus, vienetai (akcijos)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-		-	-	-	
-	Raiffeisen Eastern European Bond Fund	AT	AT0000A0EYA2	EUR	22 024	Raiffeisen Kapitalanlage- Gesellschaft m.b.H.	-	-	-	-	16 552 096	20 000 455		IS Bloomberg	KIS 1	-	1,96
-	SEB Eastern Europe Bond Fund	EE	EE3600087532	EUR	556 027	AS SEB Varahaldus	-	-	-	-	20 527 733	25 261 945		IS Bloomberg	KIS 1	-	2,48
-	HSBC Euro Govt Bond Fund-C	FR	FR0000971293	EUR	5 691	HSBC Global Asset	-	-	-	-	51 449 974	54 913 961		www.morning star.co.uk	KIS 1	-	5,39

Ko- das	Emitento (KIS, kredito įstaigos, banko pavadinimas)	Šalis	ISIN kodas / Priemonės pavadinimas	Valiuta	Kiekis, vnt.	Valdytojas	Bendra nominali vertė, Lt	Investicinis sandoris (pozicija)	Sandorio (pozicijos) vertė	Kita sandorio šalis	Bendra įsigijimo vertė, Lt	Bendra rinkos vertė, Lt	Palū- kanų norma, %	Rinka (šaltinis), pagal kurios duomenis nustatyta rinkos vertė (tinklalapio adresas)	KIS tipas	Išpirkimo / konvertavi- mo data / terminas	Dalis GA / dalis portfely- je, %
-	Comgest Growth AS X JPN- USD	IE	IE00B16C1G93	USD	602 185	Management (France) Comgest Asset Management International	-	-	-	-	21 422 049	20 510 659		IS Bloomberg	KIS 3	-	2,01
-	JOHCM European Select Val Inst EUR	IE	IE0032904330	EUR	5 083 519	J O Hambro Capital Management Limited	-	-	-	-	33 113 836	38 281 725		IS Bloomberg	KIS 3	-	3,76
-	SEB Sicav 1-SEB Eastern Europe ex Russia	LU	LU0070133888	EUR	5 318 611	SEB Asset Management S.A.	-	-	-	-	45 498 224	52 300 959		IS Bloomberg	KIS 3	-	5,14
-	SEB Fund 5 - SEB Corporate Bond Fund EUR	LU	LU0133008952	EUR	2 569 910	SEB Asset Management S.A.	-	-	-	-	11 432 315	13 354 446		IS Bloomberg	KIS 1	-	1,31
-	JB Euro Government Bond Fund - C	LU	LU0100842706	EUR	22 220	Swiss & Global Asset Management	-	-	-	-	11 875 751	13 238 120		IS Bloomberg	KIS 1	-	1,30
-	HSBC GIF-EUR COR CRD BD-IC	LU	LU0165125831	EUR	320 012	HSBC Investment Funds (Luxembourg) S.A.	-	-	-	-	23 690 123	27 059 904		IS Bloomberg	KIS 1	-	2,66
-	PICTET FUND-EUR CORP BON	LU	LU0128472205	EUR	42 567	Pictet Funds S.A.	-	-	-	-	24 253 719	26 614 083		IS Bloomberg	KIS 1	-	2,61
-	BlueBay Investment Grade Bond Fund I - Base EUR	LU	LU0225310266	EUR	66 013	BlueBay Asset Management PLC	-	-	-	-	29 471 281	34 148 590		IS Bloomberg	KIS 1	-	3,35
-	Schroders Euro Corporate Bond Fund	LU	LU0113258742	EUR	351 386	Schroder Investment Management Luxemburg	-	-	-	-	20 401 682	22 821 553		IS Bloomberg	KIS 1	-	2,24
-	CRM US Equity Opportunities-S	IE	IE00B43N7R95	USD	970 451	Cramer Rosenthal McGlynn LLC ("CRM")	-	-	-	-	28 493 193	30 145 624		IS Bloomberg	KIS 3	-	2,96
-	SEB Fund 2-SEB Russia Fund	LU	LU0273119544	EUR	931 003	SEB Asset Management S.A.	-	-	-	-	28 187 096	31 062 346		IS Bloomberg	KIS 3	-	3,05
-	East Capital Russian Fund	SE	SE0000777708	SEK	32 301	East Capital Asset Management AB/Sweden	-	-	-	-	13 588 464	15 230 451		IS Bloomberg	KIS 3	-	1,50

Ko- das	Emitento (KIS, kredito įstaigos, banko pavadinimas)	Šalis	ISIN kodas / Priemonės pavadinimas	Valiuta	Kiekis, vnt.	Valdytojas	Bendra nominali vertė, Lt	Investicinis sandoris (pozicija)	Sandorio (pozicijos) vertė	Kita sandorio šalis	Bendra įsigijimo vertė, Lt	Bendra rinkos vertė, Lt	Palū- kanų norma, %	Rinka (šaltinis), pagal kurios duomenis nustatyta rinkos vertė (tinklalapio adresas)	KIS tipas	Išpirkimo / konvertavi- mo data / terminas	Dalis GA / dalis portfelje, %
-	FAST JAPAN FUND -Y	LU	LU0348530451	JPY	103 923	FIL Fund Management Limited	-	-	-	-	22 177 135	22 765 321		IS Bloomberg	KIS 3	-	2,24
-	T ROWE PRICE-ASIAN EX JAPAN JPN-I	LU	LU0266341725	USD	716 925	T. Rowe Price Global Inv. Services Ltd	-	-	-	-	27 837 166	31 873 309		IS Bloomberg	KIS 3	-	3,13
-	Investec GS Asian Equity-A A	LU	LU0345775950	USD	610 708	Investec Asset Management Guernsey L	-	-	-	-	30 305 257	32 514 434		IS Bloomberg	KIS 3	-	3,19
-	BGF-Latin American Fund- SD2	LU	LU0252970081	USD	103 971	Black Rock Luxembourg	-	-	-	-	24 147 263	23 144 504		IS Bloomberg	KIS 3	-	2,27
-	William Blair US All Cap Growth D	LU	LU0534978027	USD	80 413	William Blair & Company L.L.C.	-	-	-	-	25 618 627	27 718 065		IS Bloomberg	KIS 3	-	2,72
-	JPMorgan Funds - Emerging Markets Local Currency	LU	LU0332400661	USD	457 000	JPMorgan Asset Management Europe SAR	-	-	-	-	19 653 120	21 341 681		IS Bloomberg	KIS 1	-	2,10
-	DB X-Trackers MSCI USA TRN	LU	LU0274210672	USD	646 276	DB Platinum Advisors	-	-	-	-	51 330 292	57 414 216		IS Bloomberg	KIS 3	-	5,64
-	East Capital Balkan Fund	SE	SE0001244328	SEK	2 992 486	East Capital Asset Management AB/Swe	-	-	-	-	13 529 324	13 204 728		IS Bloomberg	KIS 3	-	1,30
-	ING L Renta EMK DBT LOC- ICAP	LU	LU0555021707	USD	1 102	ING Investment Management	-	-	-	-	12 944 339	18 767 349		IS Bloomberg	KIS 1	-	1,84
-	ING (L) Renta Fund Emerging Markets Debt (Hard Cur	LU	LU0555020725	EUR	2 361	ING Investment Management	-	-	-	-	10 650 235	39 026 034		IS Bloomberg	KIS 1	-	3,83
-	OYSTER European Opportunities I	LU	LU0507009925	EUR	8 555	Oyster Asset Management S.A.	-	-	-	-	34 081 208	36 960 277		IS Bloomberg	KIS 3	-	3,63
	Iš viso:				22 617 640		-	-	-	-	652 231 502	749 674 739				-	73,61
3.2	Kitų kolektyvinių investavimo subjektų vienetai	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-				-	-
-	EEREIF	EE	EE3500096500	EUR	91 209	AS Gild Property Asset Management	-	-	-	-	2 371 272	1 623 547		UAB "SEB Investicijų valdymas" Valdybos nutarimas Nr.15 2012.11.19	KIS 5	-	0,16
-	SEB Fund 2- KEY SELECT-IC	LU	LU0273118736	EUR	587 908	Key Asset	-	-	-	-	19 853 600	20 108 458		IS Bloomberg	KIS 5	-	1,97

Ko- das	Emitento (KIS, kredito įstaigos, banko pavadinimas)	Šalis	ISIN kodas / Priemonės pavadinimas	Valiuta	Kiekis, vnt.	Valdytojas	Bendra nominali vertė, Lt	Investicinis sandoris (pozicija)	Sandorio (pozicijos) vertė	Kita sandorio šalis	Bendra įsigijimo vertė, Lt	Bendra rinkos vertė, Lt	Palū- kanų norma, %	Rinka (šaltinis), pagal kurios duomenis nustatyta rinkos vertė (tinklalapio adresas)	KIS tipas	Išpirkimo / konvertavi- mo data / terminas	Dalis GA / dalis portfelje, %
	EUR					Management (UK) Limited											
	Iš viso:	-	-	-	679 117		-	-	-	-	22 224 872	21 732 005	-	-	-	-	2,13
	Iš viso KIS:	-	-	-	23 296 755		-	-	-	-	674 456 375	771 406 744	-	-	-	-	75,74
4	P pinigų rinkos priemonės	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
4.1	P pinigų rinkos priemonės, kuriomis prekiaujama reguliuojamose rinkose	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Iš viso:	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
4.2	Kitos pinigų rinkos priemonės	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Iš viso:	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Iš viso Pinigų rinkos priemonės:	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
5	Indėliai kredito įstaigose	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Iš viso:	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Iš viso Indėliai kredito įstaigose:	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
6	Išvestinės investicinės priemonės	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
6.1	Išvestinės investicinės priemonės, kuriomis prekiaujama reguliuojamose rinkose	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	EUREX	CH	DUH3	EUR	-	-	-	-	-	-	-	10 358	-	SEB Futures ataskaita, IS Bloomberg	-	2013 03 07	0,00
-	Chicago Mercantile Exchange	US	ECH3	USD	-	-	-	XS0541528682, XS0457764339, XS0485991417, XS0602546136, XS0739988086	16 415 129	Chicago Mercantile Exchange	-	213 530	-	IS Bloomberg (t-1) dienos 10 val.	-	2013 03 18	0,02
-	EUREX	CH	OEH3	EUR	-	-	-	NL0009086115, DE0001141596, DE0001135374, BE0000315243	(7 944 064)	EUREX	-	(40 398)	-	SEB Futures ataskaita, IS Bloomberg	-	2013 03 07	0,00
-	EUREX	CH	RXH3	EUR	-	-	-	DE0001135424, FR0010192997	5 028 658	EUREX	-	30 039	-	SEB Futures ataskaita, IS Bloomberg	-	2013 03 07	0,00
-	EUREX	CH	UBH3	EUR	-	-	-	FR0000571218, DE0001135366	(2 836 959)	EUREX	-	(54 278)	-	SEB Futures ataskaita, IS	-	2013 03 07	(0,01)

Ko- das	Emitento (KIS, kredito įstaigos, banko pavadinimas)	Šalis	ISIN kodas / Priemonės pavadinimas	Valiuta	Kiekis, vnt.	Valdytojas	Bendra nominali vertė, Lt	Investicinis sandoris (pozicija)	Sandorio (pozicijos) vertė	Kita sandorio šalis	Bendra įsigijimo vertė, Lt	Bendra rinkos vertė, Lt	Palū- kanų norma, %	Rinka (šaltinis), pagal kurios duomenis nustatyta rinkos vertė (tinklalapio adresai)	KIS tipas	Išpirkimo / konvertavi- mo data / terminas	Dalis GA / dalis portfelje, %
														Bloomberg			
	Iš viso:	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	159 251	-	-	-	-	0,02
6.2	Kitos išvestinės investicinės priemonės	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Iš viso:	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Iš viso Išvestinės investicinės priemonės:	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	159 251	-	-	-	-	0,02
7	Pinigai	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	AB SEB bankas	LT	-	LTL	-	-	-	-	-	-	-	172 421	-	-	-	-	0,02
-	AB SEB bankas	LT	-	EUR	-	-	-	-	-	-	-	3 182 190	-	-	-	-	0,31
-	AB SEB bankas	LT	-	USD	-	-	-	-	-	-	-	6	-	-	-	-	0,00
-	SEB LONDON	GB	-	EUR	-	-	-	-	-	-	-	358 964	-	-	-	-	0,04
-	SEB LONDON	GB	-	USD	-	-	-	-	-	-	-	441 352	-	-	-	-	0,04
-	SEB LONDON	GB	-	JPY	-	-	-	-	-	-	-	4	-	-	-	-	0,00
-	SEB Liuksemburgas	LU	-	EUR	-	-	-	-	-	-	-	86 053	-	-	-	-	0,01
-	AB SEB bankas	LT	-	LTL	-	-	-	-	-	-	-	1 130 024	-	-	-	-	0,11
	Iš viso:	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	5 371 014	-	-	-	-	0,53
	Iš viso Pinigai:	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	5 371 014	-	-	-	-	0,53
8	Kitos priemonės, nenumatytos Kolektyvinio investavimo subjektų įstatymo 57 str. 1 d.	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	Gautinos sumos	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	20 364	-	-	-	-	0,00
-	Mokėtinos sumos	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	(2 636 875)	-	-	-	-	(0,26)
	Iš viso:	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	(2 616 513)	-	-	-	-	(0,26)
	Iš viso Kitos priemonės, nenumatytos Kolektyvinio investavimo subjektų įstatymo 57 str. 1 d.:	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
9	IŠ VISO:	-	-	-	-	-	-	-	-	-	888 106 917	1 018 414 943	-	-	-	-	100,00

2011 m. gruodžio 31 d.

Emitento pavadinimas	Šalis	ISIN kodas	Kiekis (vnt.)	Bendra nominalioji vertė	Bendra įsigijimo vertė	Bendra rinkos vertė	Palūkanų norma	Išpirkimo / konvertavimo data	Dalis GA (%)
Ne nuosavybės vertybiniai popieriai, įtraukti į Oficialųjį ar įj atitinkantį prekybos sąrašą									
Iš viso:									
Ne nuosavybės vertybiniai popieriai, įtraukti į Papildomąjį ar įj atitinkantį prekybos sąrašą									

Emitento pavadinimas	Šalis	ISIN kodas	Kiekis (vnt.)	Bendra nominalioji vertė	Bendra įsigijimo vertė	Bendra rinkos vertė	Palūkanų norma	Išpirkimo / konvertavimo data	Dalis GA (%)
Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT0000603227	92 142	9 214 200	9 609 697	9 693 578	2,75	2012 10 29	1,12
Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT0000605107	19 850	1 985 000	2 049 680	2 058 586	4,75	2015 04 29	0,24
Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT0000603235	30 000	3 000 000	3 070 371	3 075 225	3,9	2013 08 05	0,36
DnB NORD bankas	LT	LT0000431132	47 000	4 700 000	4 686 817	4 739 640	3,47	2013 10 07	0,55
Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT1000600288	5 556	1 918 376	1 856 414	1 905 040	2,2	2012 04 25	0,22
Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT1000600296	43 804	15 124 645	14 615 174	14 909 166	2,55	2012 07 25	1,73
Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT0000600025	34 200	3 420 000	3 352 245	3 414 835	1,65	2012 02 01	0,40
Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT1000600304	27 969	9 657 136	9 320 560	9 437 368	2,85	2012 10 24	1,09
Iš viso:			300 521	49 019 357	48 560 958	49 233 438			5,70
Ne nuosavybės vertybiniai popieriai, kuriais prekiaujama kitose reguliuojamose rinkose									
Slovakijos Respublika	SK	XS0192595873	2 700	9 322 560	9 110 627	9 862 532	3,15	2014 05 20	1,14
Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	XS0147459803	306	1 056 557	1 113 433	1 107 865	2,58	2012 05 10	0,13
Nyderlandų Karalystė	NL	NL0000102283	920	3 176 576	3 357 641	3 630 384	1,16	2016 07 15	0,42
Vokietijos Federacine Respublika	DE	DE0001135267	133	459 222	449 285	522 520	0,36	2015 01 04	0,06
Prancūzijos Respublika	FR	FR0000571218	1 320	4 557 696	5 472 061	5 820 397	3,61	2029 04 25	0,67
Nyderlandų Karalystė	NL	NL0000102242	1 550	5 351 840	4 858 347	5 865 981	0,90	2015 07 15	0,68
Vokietijos Federacine Respublika	DE	DE0001135317	200	690 560	666 197	815 355	0,81	2017 01 04	0,09
Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	XS0327304001	3 670	12 671 776	12 417 080	12 745 878	5,59	2018 02 07	1,48
Slovakijos Respublika	SK	XS0299989813	4 000	13 811 200	13 420 343	14 171 999	4,40	2017 05 15	1,64
Slovėnijos Respublika	SI	XS0292653994	2 580	8 908 224	8 221 391	8 221 391	6,14	2018 03 22	0,95
Belgijos Karalyste	BE	BE0000298076	700	2 416 960	2 634 390	2 533 107	0,16	2012 09 28	0,29
Belgijos Karalyste	BE	BE0000306150	1 320	4 557 696	4 433 271	4 755 175	2,78	2015 09 28	0,55
Vokietijos Federacine Respublika	DE	DE0001135374	600	2 071 680	2 175 202	2 482 051	1,33	2019 01 04	0,29
Prancūzijos Respublika	FR	FR0010061242	575	1 985 360	2 117 724	2 174 829	0,99	2014 04 25	0,25
Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	XS0435153068	2 250	7 768 800	8 983 598	8 935 473	4,89	2014 06 22	1,04
Austrijos Respublika	AT	AT0000383864	2 000	6 905 600	8 589 876	9 505 686	3,34	2027 07 15	1,10
Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	XS0457764339	1 200	3 203 280	3 337 818	3 465 108	4,92	2015 01 15	0,40
Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	XS0485991417	709	1 892 605	1 859 919	2 115 034	5,97	2020 02 11	0,24
Belgijos Karalyste	BE	BE0000315243	700	2 416 960	2 612 009	2 541 079	3,66	2019 03 28	0,29
Vokietijos Federacine Respublika	DE	DE0001135218	400	1 381 120	1 499 468	1 504 915	(0,02)	2013 01 04	0,17
Prancūzijos Respublika	FR	FR0010171975	2 550	8 804 640	8 744 768	9 548 924	3,73	2055 04 25	1,11
Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	XS0541528682	3 025	8 074 935	8 016 876	8 081 478	5,42	2017 09 14	0,94
Slovėnijos Respublika	SI	SI0002102919	1 700	5 869 760	6 113 296	6 105 207	1,93	2012 02 05	0,71
Nyderlandų Karalystė	NL	NL0009086115	2 800	9 667 840	10 945 638	11 239 934	1,92	2019 07 15	1,30
Vokietijos Federacine Respublika	DE	DE0001135366	1 900	6 560 320	7 779 883	9 861 544	2,40	2040 07 04	1,14
Vokietijos Federacine Respublika	DE	DE0001135424	1 250	4 316 000	4 075 573	4 729 813	1,67	2021 01 04	0,55
Vokietijos Federacine Respublika	DE	DE0001137321	1 000	3 452 800	3 431 393	3 489 528	(0,08)	2012 12 14	0,40
Vokietijos Federacine Respublika	DE	DE0001141596	3 400	11 739 520	11 528 963	12 646 728	0,58	2016 02 26	1,46
Slovėnijos Respublika	SI	SI0002103149	1 500	5 179 200	5 161 203	4 617 477	6,63	2021 01 18	0,53
Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	XS0602546136	170	453 798	464 639	463 730	6,08	2021 09 03	0,05
Slovėnijos Respublika	SI	SI0002102935	2 000	6 905 600	7 147 365	7 120 666	4,44	2014 04 02	0,82
Vokietijos Federacine Respublika	DE	DE0001135085	950	3 280 160	3 678 699	4 383 970	2,42	2028 07 04	0,51
Iš viso:			50 078	168 910 845	174 596 158	185 065 755			21,44
Išleidžiami nauji ne nuosavybės vertybiniai popieriai									
Iš viso:									
Iš viso ne nuosavybės vertybinių popierių:				217 930 202	223 157 117	234 299 193			27,14

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)									
Raiffeisen Eastern European Bond Fund	AT	AT0000A0EYA2	23 299	Raiffeisen Kapitalanlage-Gesellschaft m.b.H.	17 585 158	17 462 584	IS Bloomberg	KIS 1	2,02
SEB Eastern Europe Bond Fund	EE	EE3600087532	575 478	AS SEB Varahaldus	20 616 347	21 852 346	IS Bloomberg	KIS 1	2,53
HSBC Euro Govt Bond Fund-C	FR	FR0000971293	2 191	HSBC Global Asset Management (France)	18 783 920	19 011 588	IS Bloomberg	KIS 1	2,20
TT European Equity A	IE	IE0030893295	379 887	TT International	15 809 624	14 846 824	IS Bloomberg	KIS 3	1,72
JOHCM European Select Val Inst EUR	IE	IE0032904330	2 339 418	J O Hambro Capital Management Limited	14 648 661	14 701 127	IS Bloomberg	KIS 3	1,70
SEB Sicav 1-SEB Eastern Europe ex Russia	LU	LU0070133888	5 082 785	SEB Asset Management S.A.	46 177 378	39 638 069	E. pašto pranešimas	KIS 3	4,59
JB Euro Government Bond Fund - C	LU	LU0100842706	24 795	Swiss & Global Asset Management	13 199 641	13 371 651	IS Bloomberg	KIS 1	1,55
PICTET FUND-EUR CORP BON	LU	LU0128472205	40 825	Pictet Funds S.A.	22 521 338	22 228 080	IS Bloomberg	KIS 1	2,57
Schroders Euro Corporate Bond Fund	LU	LU0113258742	355 567	Schroder Investment Management Luxemburg	20 409 697	20 379 857	IS Bloomberg	KIS 1	2,36
Comgest Growth AS X JPN-USD	IE	IE00B16C1G93	707 825	Comgest Asset Management International	25 856 853	22 484 666	IS Bloomberg	KIS 3	2,60
Odey Allegra European Fund	IE	IE00B04YBL58	31200	Odey Asset Management LLP	14 979 199	14 591 881	IS Bloomberg	KIS 3	1,69
GLG European Equity S	IE	IE00B29Z0J87	60 200	GLG Partners Asset management Ltd.	15 611 777	14 327 610	IS Bloomberg	KIS 3	1,66
CRM US Equity Opportunities-S	IE	IE00B43N7R95	882 299	Cramer Rosenthal McGlynn LLC ("CRM")	27 215 680	24 023 131	IS Bloomberg	KIS 3	2,78
SEB Fund 5 - SEB Corporate Bond Fund EUR	LU	LU0133008952	2 712 482	SEB Asset Management S.A.	11 739 520	12 533 122	e. pašto pranešimas	KIS 1	1,45
SEB Fund 2-SEB Russia Fund	LU	LU0273119544	793 824	SEB Asset Management S.A.	26 569 404	24 117 855	e. pašto pranešimas	KIS 3	2,79
East Capital Russian Fund	SE	SE0000777708	27 151	East Capital Asset Management AB/Sweden	12 649 013	11 443 614	IS Bloomberg	KIS 3	1,33
HSBC GIF-EUR COR CRD BD-IC	LU	LU0165125831	315 074	HSBC Investment Funds (Luxembourg) S.A.	22 250 590	22 425 720	IS Bloomberg	KIS 1	2,60
BlueBay Investment Grade Bond Fund I - Base EUR	LU	LU0225310266	67 810	BlueBay Asset Management PLC	29 753 240	30 304 022	IS Bloomberg	KIS 1	3,51
FAST JAPAN FUND -Y	LU	LU0348530451	87 283	FIL Fund Management Limited	22 105 218	18 035 387	IS Bloomberg	KIS 3	2,09
T ROWE PRICE-ASIAN EX JAPAN JPN-I	LU	LU0266341725	602 752	T. Rowe Price Global Inv. Services Ltd	23 533 430	22 381 004	IS Bloomberg	KIS 3	2,59
Investec GS Asian Equity-A A	LU	LU0345775950	495 99	Investec Asset Management Guernsey L	25 740 772	22 049 036	IS Bloomberg	KIS 3	2,55
BGF-Latin American Fund-\$D2	LU	LU0252970081	80 748	Black Rock Luxembourg	20 116 356	17 306 324	IS Bloomberg	KIS 3	2,00
William Blair US All Cap Growth D	LU	LU0534978027	76 803	William Blair & Company L.L.C.	24 674 231	24 114 260	IS Bloomberg	KIS 3	2,79
Vontobel Fund-Belvista Commodity I	LU	LU0415415800	33 737	Vontobel Management SA/Luxembourg	12 206 352	11 073 476	IS Bloomberg	KIS 5	1,28
JPMorgan Funds - Emerging Markets Local Currency	LU	LU0332400661	420 250	JPMorgan Asset Management Europe SAR	17 936 272	17 332 047	IS Bloomberg	KIS 1	2,01
DB X-Trackers MSCI USA TRN	LU	LU0274210672	575 176	DB Platinum Advisors	46 639 270	46 767 517	IS Bloomberg	KIS 3	5,42
East Capital Balkan Fund	SE	SE0001244328	2 712 279	East Capital Asset Management AB/Swe	12 678 850	9 359 642	IS Bloomberg	KIS 3	1,08
ING L Renta EMK DBT LOC-ICAP	LU	LU0555021707	1 167	ING Investment Management	17 796 038	17 346 623	IS Bloomberg	KIS 1	2,01

KIS pavadinimas	Šalis	ISIN kodas	Kiekis (vnt)	Valdytojas	Bendra įsigijimo vertė	Bendra rinkos vertė	Rinkos vertės nustatymo šaltinis (tinklalapio adresas)	KIS tipas*	Dalis GA (%)
ING (L) Renta Fund Emerging Markets Debt (Hard Cur	LU	LU0555020725	2 481	ING Investment Management	32 567 202	33 797 776	IS Bloomberg	KIS 1	3,91
Iš viso:			19 509 984		632 371 031	599 306 840			69,42
Kitų kolektyvinio investavimo subjektų vienetai (akcijos)									
EEREIF	EE	EE3500096500	91 209	AS Gild Property Asset Mamangement	4 166 728	2 842 222	www.gildbankers.com	KIS 5	0,33
KEY HEDGE Fund INC-B EUR	BM	VGG5250A1553	38 293	Key Capital Management Inc	16 454 006	15 837 126	IS Bloomberg www.keyhedge.com	KIS 5	1,83
Iš viso:			129 502		18 825 278	18 679 348			2,16
Iš viso KIS vienetų (akcijų):					651 196 309	617 986 188			71,58

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										
EURO-SCHATZ FUTURE	EUREX	CH	EUREX	EUR	DE0001137321	2 666 874	6 163	e. pašto pranešimas	2012 03 08	0,00
CME USD/EUR CURR FUTURE	Chicago Mercantile Exchange	US	Chicago Mercantile Exchange	USD	XS0541528682, XS0457764339, XS0485991417, IE00B43N7R95	13 388 142	(48 983)	IS Bloomberg (t-1) dienos 10 val.	2012 03 19	(0,01)
EURO-BOBL FUTURE	EUREX	CH	EUREX	EUR	NL0000102242, DE0001141596, BE0000306150	(17 711 172)	(223 672)	e. pašto pranešimas	2012 03 08	(0,03)
EURO-BUND FUTURE	EUREX	CH	EUREX	EUR	DE0001135374, NL0009086115, BE0000315243, DE0001135424, SI0002103149, XS0292653994	6 721 082	151 302	e. pašto pranešimas	2012 03 08	0,02
EURO BUXL 30Y BND FUTURE	EUREX	CH	EUREX	EUR	FR0000571218, DE0001135085	(441 751)	(18 783)	e. pašto pranešimas	2012 03 08	0,00
Iš viso:							(133 974)			(0,02)
Kitos išvestinės finansinės priemonės										
Iš viso:							(133 974)			(0,02)

Banko pavadinimas	Valiuta	Bendra rinkos vertė	Palūkanų norma	Dalis GA (%)
Pinigai				
AB SEB bankas	LTL	6 937 442	0,81	0,80
AB SEB bankas	EUR	4 450 151	0,57	0,52
AB SEB bankas	USD	638	0,11	0,00
SEB London Futures	EUR	423 018		0,05
SEB London Futures	USD	377 132		0,04
SEB London Futures	JPY	5		0,00
AB SEB bankas	LTL	832 705		0,10
Iš viso pinigai:			13 021 090	1,51

Pavadinimas	Trumpas apibūdinimas	Bendra vertė	Paskirtis	Dalis GA (%)
Kitos priemonės (aiškiai įvardyti), nenurodytos Kolektyvinio investavimo subjektų įstatymo 57 str. 1 d.				
Iš viso:				
Gautinos sumos		3 932		0,00
Mokėtinos sumos		(1 886 429)		(0,22)
Iš viso:		(1 882 497)		(0,22)

* – nurodyti KIS tipą:

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

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

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

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

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

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

6 Pastaba. Investicijų paskirstymas pagal investavimo strategiją atitinkančius kriterijus.

Investicijų pasiskirstymas	Ataskaitinio laikotarpio pabaigoje 2012 12 31		Ataskaitinio laikotarpio pradžioje 2011 12 31	
	Rinkos vertė, Lt	Dalis aktyvuose, %	Rinkos vertė, Lt	Dalis aktyvuose, %
Pagal investavimo objektus				
Akcijos	433 126 619	42,53%	340 187 946	39,41%
Obligacijos	560 642 567	55,05%	482 344 610	55,87%
Žaliavos	-	0,00%	11 073 476	1,28%
Kitos alternatyvios investicijos	21 732 006	2,13%	18 679 348	2,16%
Išvestinės priemonės	159 251	0,02%	(133 974)	(0,02)%
Pinigių rinkos priemonės	2 754 500	0,27%	11 138 593	1,29%
Iš viso:	1 018 414 943	100,00%	863 290 000	100,00%
Pagal regionus				
Obligacijos				
Lietuva	106 975 910	10,50%	86 148 004	9,98%
Išsivysčiusios rinkos	302 254 443	29,68%	255 768 543	29,63%
Besivystančios rinkos	151 412 214	14,87%	140 428 063	16,27%
Iš viso:	560 642 567	55,05%	482 344 610	55,87%
Akcijos				
Šiaurės Amerika	115 277 905	11,32%	94 904 908	10,99%
Azija be Japonijos	84 898 402	8,34%	66 914 706	7,75%
Vakarų Europa	75 242 003	7,39%	58 467 442	6,77%
Vidurio ir Rytų Europa	65 505 687	6,43%	48 997 710	5,68%
NVS	46 292 798	4,55%	35 561 469	4,12%
Japonija	22 765 321	2,24%	18 035 387	2,09%
Besivystančios rinkos	23 144 503	2,27%	17 306 324	2,00%
Iš viso:	433 126 619	42,53%	340 187 946	39,41%

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

Investicijų, kurios apskaitoje nebuvo įvertintos tikrąja verte, nebuvo.

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

Ataskaitiniu laikotarpiu valiutos ateities sandoriai buvo sudaromi tik norint apsidrausti nuo užsienio valiutos nuvertėjimo lito atžvilgiu rizikos. Sudarant valiutos ateities sandorius, yra įvertinama, kokia fondo turto dalis yra investuota užsienio valiuta. Sudarant tokius sandorius draudimo tikslais, valiutos kurso pokyčiai neturi įtakos portfeliui ar jo daliai, o fondo vieneto vertės svyravimai dėl valiutos kitimo yra sumažinami arba jų visiškai nelieta. Per ataskaitinį laikotarpį yra sudaryti euro ir JAV dolerio išankstiniai sandoriai norint apsaugoti nuo galimo dalies iš fondo investicijų JAV doleriais nuvertėjimo.

Per ataskaitinį laikotarpį fondas sudarė obligacijų, kurių kainų pokytis priklauso nuo Vokietijos 2, 5, 10 arba 30 metų trukmės obligacijų kainų pokyčio, ateities sandorius (*schatz, bobl, bund ir buxl futures*). Sudarant 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 metų. Ši nuostata yra įtvirtinta fondo taisyklėse.

Ataskaitiniu laikotarpiu fondas sudarė ateities akcijų svyravimo indekso sandorius (*VIX index futures*). Buvo sudaromi ateities sandoriai, kurių kaina priklauso nuo VIX indekso, kurio vertę lemia investuotojų nuomonė apie JAV akcijų indekso S&P 500 svyravimus artimiausią mėnesį. VIX indekso vertė paprastai kyla arba beveik nekinta, jei S&P 500 indekso vertė krenta; jei S&P 500 indekso vertė kyla, VIX indekso vertė paprastai krenta. Sudarant ateities akcijų svyravimo indekso sandorius, apsidraudžiama nuo galimo akcijų indekso kritimo rizikos. Tokių išvestinių finansinių priemonių rizika yra nustatoma atsižvelgiant 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.

2012 m. gruodžio 31 d.

Priemonės pavadinimas	Valiutos kodas	Išpirkimo data	Priemonės panaudojimo tikslas
EURO-SCHATZ FUTURE_EUX_EUR	EUR	2013 03 07	Palūkanų normų rizikos valdymas
CME USD/EUR CURR FUT	EUR	2013 03 18	Valiutų kursų svyravimo rizikos valdymas
EURO-BOBL FUTURE_EUX_EUR	EUR	2013 03 07	Palūkanų normų rizikos valdymas
EURO-BUND FUTURE_EUX_EUR	EUR	2013 03 07	Palūkanų normų rizikos valdymas
EURO BUXL 30Y BND_EUX_EUR	USD	2013 03 07	Palūkanų normų rizikos valdymas

2011 m. gruodžio 31 d.

Priemonės pavadinimas	Valiutos kodas	Išpirkimo data	Priemonės panaudojimo tikslas
CME USD/EUR CURR FUT	USD	2012 03 19	Valiutų kursų svyravimo rizikos valdymas
EURO BUXL 30Y BND_EUX_EUR	EUR	2012 03 08	Palūkanų normų rizikos valdymas
EURO-BOBL FUTURE_EUX_EUR	EUR	2012 03 08	Palūkanų normų rizikos valdymas
EURO-BUND FUTURE_EUX_EUR	EUR	2012 03 08	Palūkanų normų rizikos valdymas
EURO-SCHATZ FUTURE_EUX_EUR	EUR	2012 03 08	Palūkanų normų rizikos valdymas

9 Pastaba. Atlyginimo tarpininkams sąnaudos.

2012 m. gruodžio 31 d.

Tarpininko pavadinimas	Sumokėti mokesčiai Lt	Ar susijęs su valdymo įmone
<i>Skandinaviska Enskilda Banken AB</i>	8 744	Taip
AB SEB bankas	2 809	Taip
<i>Skandinaviska Enskilda Banken S.A.</i>	1 207	Taip
<i>HSBC Trinkaus</i>	15 126	Ne
Iš viso*	27 886	

2011 m. gruodžio 31 d.

Tarpininko pavadinimas	Sumokėti mokesčiai Lt	Ar susijęs su valdymo įmone
AB SEB bankas	3 269	Taip
<i>Skandinaviska Enskilda Banken AB</i>	15 624	Taip
<i>DB Platinum Advisors</i>	15 071	Ne
<i>HSBC Trinkaus</i>	58 509	Ne
Iš viso*	92 473	

* nurodyti mokesčiai nemažina pensijų fondo grynujų aktyvų vertės. Bendrovė perveda nurodytus mokesčius į fondo sąskaitą

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

Pensijų fondas dividendų nemoka.

11 Pastaba. Pasiskolintos ir paskolintos lėšos.

2012 m. gruodžio 31 d. ir 2011 m. gruodžio 31 d. fondas skolintų lėšų neturėjo.

12 Pastaba. Trečiosios šalies įsipareigojimai garantuoti subjekto pajamingumo dydį.

Įsipareigojimų nebuvo.

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

Rodikliai	2012 12 31	2011 12 31	Likutis 2012 12 31
<i>AB SEB bankas</i>			
Pinigai laikomi banke	Žr. 5 pastaba	Žr. 5 pastaba	Žr. 5 pastaba
Komisinis mokestis už sandorius	Žr. 9 pastaba	Žr. 9 pastaba	-
<i>UAB SEB Investicijų valdymas</i>			
Atskaitymai nuo įmokų	Žr. 20 pastaba	Žr. 20 pastaba	1 485
Atskaitymai nuo turto vertės	Žr. 20 pastaba	Žr. 20 pastaba	761 708
Už pensijų kaupimo bendrovės keitimą	Žr. 20 pastaba	Žr. 20 pastaba	-
<i>Skandinaviska Enskilda Banken AB</i>			
Komisinis mokestis už sandorius	Žr. 9 pastaba	Žr. 9 pastaba	-
Valdymo mokesčio į investuojamus fondus nuolaida	1 290 641	986 187	-
Investicijos į SEB grupės valdomus fondus	Žr. 5 pastaba	Žr. 5 pastaba	-
Pinigai laikomi banke	Žr. 5 pastaba	Žr. 5 pastaba	Žr. 5 pastaba
<i>SEB Europe Eastern Bond Fund</i>			
Valdymo mokesčio į investuojamus fondus nuolaida	128 362	83 789	-

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

Apskaitinių įvertinimų pakeitimų nebuvo.

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

Nuo 2013 m. sausio 1 d. įsigaliojo Pensijų sistemos reformos ir Pensijų kaupimo įstatymų pataisos.

Pagrindiniai įsigalioję pakeitimai:

1. Atsiranda galimybė antros pakopos pensijų fonduose kaupti pensiją skiriant šiam tikslui įstatymo nustatytą dalį savo darbo užmokesčio. Šiuo atveju valstybė savo lėšomis moka papildomas pensijų įmokas, apskaičiuojamas nuo vidutinio šalies darbo užmokesčio.
2. Suteikiama galimybė keisti pensijų kaupimo bendrovę nelaukiant, kol nuo pirmosios pensijų kaupimo sutarties sudarymo praeis treji metai, jei antros pensijų pakopos sąskaitoje yra lėšų.
3. Mažėja pensijų kaupimo antros pakopos fonduose sutarčių administravimo mokesčiai.
4. Suteikiama galimybė iš pensijų fondų išmoką gauti anksčiau, jei dalyviui paskiriama išankstinė valstybinio socialinio draudimo senatvės pensija.
5. Nuo 2014 m. vienam iš tėvų, auginančių vaiką iki trejų metų ir gaunančių motinystės (tėvystės) pašalpą arba draudžiamų socialiniu draudimu valstybės lėšomis, į pensijų fondą iš valstybės biudžeto bus pervedamos 2 proc. vidutinio šalies darbo užmokesčio pensijų įmokos (skaičiuojamos nuo užpraeitų metų keturių ketvirčių šalies ūkio darbuotojų vidutinio bruto darbo užmokesčio vidurkio). Pensijų įmokos pervedamos už kiekvieną vaiką iki trejų metų.

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

Turto ir įsipareigojimų pokyčių, neįtrauktų į grynųjų aktyvų vertę, nebuvo.

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

Nebuvo.

18 Pastaba. Investicijų grąža ir investicijų grąžos lyginamoji informacija.

Lyginamasis indeksas – valdymo įmonės pasirenkamas rodiklis, su kurio reikšmės kitimu lyginama kolektyvinio investavimo subjekto investicijų grąža.

Fondo *SEB pensija 2* lyginamojo indekso sudėtis

23 proc.	indeksas <i>J. P. Morgan Global Bond EMU*</i> (apskaičiuotas litais)
12 proc.	indeksas <i>Barclays Investment Grade Euro Credit*</i> (apskaičiuotas litais)
11 proc.	indeksas, apskaičiuotas atsižvelgiant į 6 mėnesių VILIBOR (indeksuotas) -50 bazinių punktų*
4 proc.	indeksas <i>J. P. Morgan GBI-EM Global Diversified Composite Unhedged EUR*</i> (apskaičiuotas litais)
4 proc.	indeksas <i>J. P. Morgan EMBI Global Diversified*</i> (apskaičiuotas litais)
4 proc.	indeksas <i>Merrill Lynch Eastern Europe Government Bond Index*</i> (apskaičiuotas litais)
10,5 proc.	indeksas <i>MSCI USA, NR*</i> (apskaičiuotas litais)
7,5 proc.	indeksas <i>MSCI AC Asia ex Japan, NR*</i> (apskaičiuotas litais)
6,5 proc.	indeksas <i>MSCI Europe, NR*</i> (apskaičiuotas litais)
5,5 proc.	indeksas <i>MSCI Converging Europe 10/40 Custom, NR*</i> (apskaičiuotas litais)
4 proc.	indeksas <i>MSCI Russia 10/40, NR*</i> (apskaičiuotas litais)
2 proc.	indeksas <i>MSCI Japan, NR*</i> (apskaičiuotas litais)
2 proc.	indeksas <i>MSCI Latin America 10/40, NR*</i> (apskaičiuotas litais)
2 proc.	indeksas <i>Dow Jones UBS Commodity, TR*</i> (apskaičiuotas litais)
2 proc.	indeksas <i>HFRX Global Hedge Fund*</i> (apskaičiuotas litais)

Lyginamasis indeksas taikomas nuo 2011 m. sausio 3 d.

* Lyginamųjų indeksų sudėtinių dalių aprašymas:

J. P. Morgan Global Bond EMU (apskaičiuotas litais) – sudėtinis Vakarų Europos vyriausybės obligacijų indeksas. Rodo tikėtiną investicijų grąžą įsigijus euro zonos vyriausybės ilgalaikių obligacijų.

Barclays Investment Grade Euro Credit (apskaičiuotas litais) – sudėtinis Vakarų Europos investicinio reitingo įmonių obligacijų indeksas. Rodo tikėtiną investicijų grąžą įsigijus Vakarų Europos investicinio reitingo įmonių obligacijų.

Bendrovės sudarytas indeksas, apskaičiuotas atsižvelgiant į 6 mėnesių indeksuotą palūkanų normą VILIBOR (atėmus 50 bazinių punktų metinę normą). Indeksas rodo tikėtiną grąžą už Lietuvos Respublikos Vyriausybės vertybinius popierius, indėlius ir grynųjų pinigų likučius sąskaitose. Šis bendrovės sudarytas indeksas apskaičiuojamas kiekvieną kalendorinę dieną, taikant 6 mėnesių indeksuotą palūkanų normą VILIBOR, iš kurios atimama 50 bazinių punktų metinė norma, ir perskaičiuojant gautą dydį vienai kalendorinei dienai.

J. P. Morgan GBI-EM Global Diversified Composite Unhedged EUR (apskaičiuotas litais) – besivystančių rinkų skolos vertybinių popierių indeksas, rodantis investicijų grąžą įsigijus besivystančių rinkų skolos vertybinių popierių tų šalių vietine valiuta.

J. P. Morgan EMBI Global Diversified (apskaičiuotas litais) – besivystančių rinkų skolos vertybinių popierių indeksas, rodantis investicijų grąžą įsigijus besivystančių rinkų skolos vertybinių popierių pasaulio valiutomis.

Merrill Lynch Eastern Europe Government Bond (apskaičiuotas litais) – Rytų Europos vyriausybės obligacijų indeksas. Rodo tikėtiną investicijų grąžą įsigijus Lenkijos, Vengrijos, Čekijos vyriausybės ir nedidelę dalį Rusijos vyriausybės obligacijų.

MSCI USA, NR (apskaičiuotas litais) – JAV akcijų rinkų indeksas.

MSCI AC Asia ex Japan, NR (apskaičiuotas litais) – Azijos (be Japonijos) akcijų rinkų indeksas.

MSCI Europe, NR (apskaičiuotas litais) – Europos akcijų rinkų indeksas.

MSCI Converging Europe 10/40 Custom, NR (apskaičiuotas litais) – Vidurio Europos akcijų rinkų indeksas, į kurio sudėtį įtraukta ir Turkijos akcijų rinka (tačiau jos dalis sudaro ne daugiau kaip 10 proc. indekso sudėties).

MSCI Russia 10/40, NR (apskaičiuotas litais) – Rusijos akcijų rinkų indeksas.

MSCI Japan, NR (apskaičiuotas litais) – Japonijos akcijų rinkų indeksas.

MSCI Latin America 10/40, NR (apskaičiuotas litais) – Lotynų Amerikos akcijų rinkų indeksas Dow Jones UBS Commodity, TR (apskaičiuotas litais) – žaliavų rinkų tendencijas rodantis indeksas.

HFRX Global Hedge Fund (apskaičiuotas litais) – apribotos rizikos fondų indeksas, kuris sudaromas norint parodyti visų apribotos rizikos fondų rezultatus. Rodo tikėtiną investicijų grąžą investavus į visus į indekso sudėtį įtrauktus apribotos rizikos fondų kainų pokyčius.

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

	Per atskaitinį laikotarpį	Prieš metus	Prieš 2 metus	Prieš 10 metų
Apskaitos vieneto vertės pokytis*	13,02%	(4,81)%	11,01%	-
Lyginamojo indekso reikšmės pokytis	12,87%	(2,67)%	11,91%	-
Metinė bendroji investicijų grąža**	-	-	-	-
Metinė grynoji investicijų grąža**	12,80%	(5,07)%	10,71%	-
Apskaitos vieneto (akcijos) vertės pokyčio standartinis nuokrypis**	4,75%	7,48%	6,22%	-
Lyginamojo indekso reikšmės pokyčio standartinis nuokrypis**	5,16%	8,21%	6,15%	-
Apskaitos vieneto vertės ir lyginamojo indekso reikšmės koreliacijos koeficientas**	98,62%	98,94%	97,73%	-
Indekso sekimo paklaida**	0,99%	1,07%	1,22%	-
Alfa rodiklis**	0,30%	(2,09)%	0,07%	-
Beta rodiklis**	0,99	1,03	0,92	-

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

** Rodiklių paaiškinimai:

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

Apskaitos vieneto vertės pokyčio standartinis nuokrypis (angl. *standard deviation*) – statistinis rizikos rodiklis, rodantis, kaip kinta visi vieneto vertės pokyčiai, palyginus su jų vidutiniu pokyčiu.

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

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

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

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

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

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

	Per paskutinius 3 metus	Per paskutinius 5 metus	Per paskutinius 10 metų	Nuo veiklos pradžios
Vidutinis apskaitos vieneto vertės pokytis*	6,10%	1,07%	-	4,59%
Vidutinis pensijų fondo lyginamojo indekso reikšmės pokytis*	7,13%	5,05%	-	5,13%
Vidutinė grynoji investicijų grąža*	5,84%	0,45%	-	2,31%
Vidutinė bendroji investicijų grąža*	-	-	-	-
Vidutinis apskaitos vieneto vertės pokyčio standartinis nuokrypis*	6,25%	8,63%	-	7,21%

*Rodiklių paaiškinimai:

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

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

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

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

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

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

2012 m. gruodžio 31 d.

Atskaitymai	Taisyklėse numatyti maksimalūs dydžiai	Faktiškai taikomi atskaitymų dydžiai	Per ataskaitinį laikotarpį priskaičiuota atskaitymų suma, Lt
Nuo įmokų	3,00 proc.	3,00 proc.	1 793 975
Nuo turto vertės	1,00 proc.	1,00 proc.	9 518 810
Už keitimą			
<i>fondo keitimas toje pačioje bendrovėje daugiau kaip kartą per metus</i>	0,05 proc.**	-	
<i>pensijų kaupimo bendrovės keitimas kartą per metus</i>	0,20 proc.	0,20 proc.	45 488
	0,05 proc.**	0,05 proc.**	1 652
<i>pensijų kaupimo bendrovės keitimas daugiau kaip kartą per metus</i>	0,05 proc.**	-	
Iš viso			11 359 925
BAR*			1,18%
Sąlyginis BIK ir (arba) tikėtinas sąlyginis BIK*			1,84 %
PAR (portfelio apyvartumo rodiklis)*			68,38

2011 m. gruodžio 31 d.

Atskaitymai	Taisyklėse numatyti maksimalūs dydžiai	Faktiškai taikomi atskaitymų dydžiai	Per ataskaitinį laikotarpį priskaičiuota atskaitymų suma, Lt
Nuo įmokų	3,00 proc.	3,00 proc.	2 328 702
Nuo turto vertės	1,00 proc.	1,00 proc.	8 527 047
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.	0,20 proc.	58 907
<i>pensijų kaupimo bendrovės keitimas daugiau kaip kartą per metus</i>	4,00 proc.	-	
Iš viso			10 914 656
BAR*			1,27%

Sąlyginis BIK ir (arba) tikėtinas sąlyginis BIK*	1,91 %
PAR (portfelio apyvartumo rodiklis)*	122,73

** sumažintas atskaitymų dydis pradėtas taikyti nuo 2012 11 24.

* Rodiklių paaiškinimai:

Valstybinio socialinio draudimo įmokos dalies kaupimo pensijų fondo bendrasis atskaitymų rodiklis (BAR) – procentinis dydis, apskaičiuojamas bendrąsias veiklos išlaidas, kurias sudaro atskaitymai nuo pensijų įmokų ir nuo pensijų turto, dalijant iš vidutinės atitinkamo laikotarpio grynųjų aktyvų vertės.

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.

20 Pastaba. Gautos ir išmokėtos lėšos.

2012 m. gruodžio 31 d.

Bendra gautų lėšų suma		74 749 197
Periodinės įmokos į pensijų fondą	iš Valstybinio socialinio draudimo fondo	59 790 387
	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	1 206 114
	iš kitos pensijų kaupimo bendrovės	13 752 635
Kitos gautos lėšos (nurodyti šaltinį ir gautų lėšų sumą)		61
	Kompensavimas klientams	61
	Nesudaryta PIS	112 682
Bendra išmokėtų lėšų suma		32 234 422
Pensijų išmokos	vienkartinės išmokos dalyviams	1 659 231
	periodinės išmokos dalyviams	
	išmokos anuiteto įsigijimui	637 778
Į kitus pensijų fondus pervestos lėšos	valdomus tos pačios pensijų kaupimo bendrovės	2 442 877
	valdomus kitos pensijų kaupimo bendrovės	25 999 924
Išstojusiems dalyviams išmokėtos lėšos (pildoma tik papildomo savanoriško kaupimo pensijų fondų atveju)		
Paveldėtojams išmokėtos lėšos		1 467 188
Kitais pagrindais išmokėtos lėšos (nurodyti šaltinį ir išmokėtų lėšų sumą), iš viso		27 424
Pervedimas į ES		26 120

2011 m. gruodžio 31 d.

Bendra gautų lėšų suma		90 371 817
Periodinės įmokos į pensijų fondą	iš Valstybinio socialinio draudimo fondo	77 621 081
	paties 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	949 713
	iš kitos pensijų kaupimo bendrovės	11 801 023
Kitos gautos lėšos (nurodyti šaltinį ir gautų lėšų sumą), iš viso		-
Bendra išmokėtų lėšų suma		36 177 909
Pensijų išmokos	vienkartinės išmokos dalyviams	1 563 647
	periodinės išmokos dalyviams	-
	išmokos anuiteto įsigijimui	-
Į kitus pensijų fondus pervestos lėšos	valdomus tos pačios pensijų kaupimo bendrovės	3 520 435
	valdomus kitos pensijų kaupimo bendrovės	29 394 317
Išstojusiems dalyviams išmokėtos lėšos (pildoma tik papildomo savanoriško kaupimo pensijų fondų atveju)		-
Paveldėtojams išmokėtos lėšos		1 677 803
Kitais pagrindais išmokėtos lėšos (nurodyti šaltinį ir išmokėtų lėšų sumą), iš viso:		21 707
	Iš jų pervedimas į ES:	13 283

VII. INFORMACIJA APIE PENSIJŲ FONDO DALYVIUS

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

Dalyvių skaičius ataskaitinio laikotarpio pradžioje		174 686
Dalyvių skaičius ataskaitinio laikotarpio pabaigoje	dalyviai, pasinaudoję teise nukelti pensijų išmokos mokėjimą	571
	dalyviai, gaunantys periodines pensijų išmokas	-
	kiti dalyviai	174 231
	Iš viso	174 802
Dalyvių skaičiaus pokytis		116

24. Per ataskaitinį laikotarpį prisijungusių dalyvių skaičius:

Bendras prisijungusių dalyvių skaičius		5 437
Dalyviai, pensijų kaupimo sutartis sudarę pirmą kartą		2 227
Iš kitų pensijų fondų atėję dalyviai	iš tos pačios pensijų kaupimo bendrovės	111
	iš kitos pensijų kaupimo bendrovės	3 099

25. Per ataskaitinį laikotarpį pasitraukusių dalyvių skaičius:

Bendras pasitraukusių dalyvių skaičius		5 321
Į kitus pensijų fondus išėjusių dalyvių skaičius	valdomus tos pačios pensijų kaupimo bendrovės	239
	valdomus kitos pensijų kaupimo bendrovės	4 406
Baigusį dalyvavimą dalyvių skaičius	išstojusį (pildoma tik papildomo savanoriško pensijų kaupimo pensijų fondo atveju)	-
	sulaukusį nustatyto pensijos amžiaus ir pasinaudojusį teise į pensijų išmoką (vienkartinę išmoką, anuitetą ir jų derinį)	254
	dalyvių, pasinaudojusį Pensijų kaupimo įstatymo suteikta galimybe vienašališkai nutraukti pirmą kartą sudarytą sutartį	13
	mirusių dalyvių	409

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

		Dalyviai pagal amžių				
		iki 30	nuo 30 iki 45	nuo 45 iki 60	nuo 60	iš viso
Dalyvių skaičius	iš viso	28 804	89 384	55 177	1 437	174 802
	vyrų	15 186	45 528	26 413	1 098	88 225
	moterys	13 618	43 856	28 764	339	86 577
Dalyvių dalis (%)	iš viso	100%	100%	100%	100%	100%
	vyrų	53,00%	51,00%	48,00%	76,00%	50,00%
	moterys	47,00%	49,00%	52,00%	24,00%	50,00%

VIII. IŠORINIAI PINIGŲ SRAUTAI

27. Per ataskaitinį laikotarpį faktiškai gautos lėšos:

(Žr. 22.3. punktas, 20 Pastaba)

28. Išmokėtos lėšos:

(Žr. 22.3. punktas, 20 Pastaba)

IX. INFORMACIJA APIE GARANTIJŲ REZERVĄ

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

-

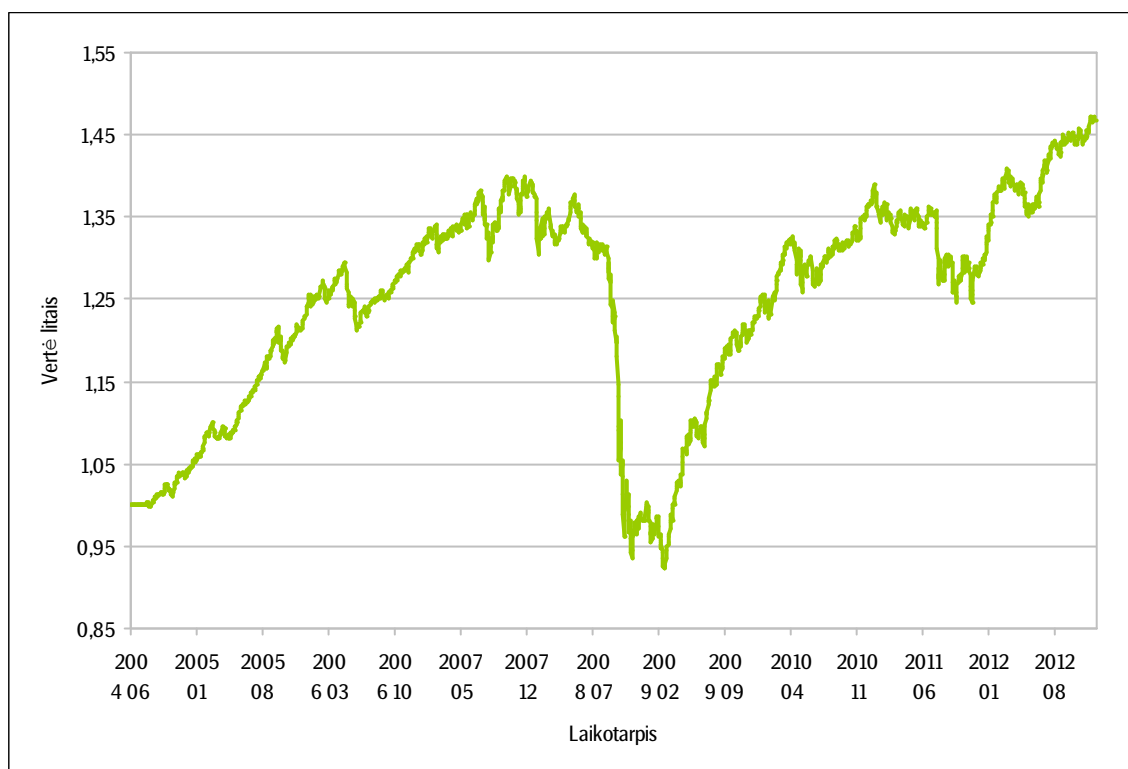
X. INFORMACIJA APIE PENSIJŲ FONDO REIKMĖMS PASISKOLINTAS LĖŠAS

30. Pensijų fondo reikmėms pasiskolintos lėšos ataskaitinio laikotarpio pabaigoje:

(Žr. 22.3. punktas, 11 Pastaba)

XI. KITA INFORMACIJA

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



Vieneto vertė litais nuo fondo veiklos pradžios

XII. ATSAKINGI ASMENYS

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

-

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

-

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

-

35. Asmenys, atsakingi už ataskaitoje pateiktą informaciją:

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

Tvirtinu _____ Gediminas Milieška, 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 _____ Sonata Šablinskaitė-Braškienė, vyriausioji buhalterė,
tel. (8 5) 268 1594, faks. (8 5) 268 1575, e. paštas info.invest@seb .lt;

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

-