

2009 metų sausio – birželio mėnesių ataskaita

*SEB pensija 2 plus*

2009 m. birželio 30 d.

I. BENDROJI INFORMACIJA .....	3
II. GRYNŲJŲ 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 .	12
VI. PENSIJŲ FONDO FINANSINĖ BŪKLĖ.....	12
VII. INFORMACIJA APIE PENSIJŲ FONDO DALYVIUS .....	20
VIII. IŠORINIAI PINIGŲ SRAUTAI .....	20
IX. INFORMACIJA APIE GARANTIJŲ REZERVĄ .....	20
X. INFORMACIJA APIE PENSIJŲ FONDO REIKMĖMS PASISKOLINTAS LĖŠAS .....	20
XI. KITA INFORMACIJA .....	21
XII. ATSAKINGI ASMENYS .....	22

**PENSIJŲ FONDO SEB PENSIJA 2 PLUS  
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

**Papildomo savanoriško pensijų kaupimo pensijų fondas SEB pensija 2 plus, taisyklių Nr. PF-S02-K001-018(002);**

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 grynujų aktyvų, apskaitos vienetų skaičių ir vertę:

	Ataskaitinio laikotarpio pradžioje	Ataskaitinio laikotarpio pabaigoje	Prieš metus (2008 06 30)	Prieš dvejus metus (2007 06 29)
Grynujų aktyvų vertė, Lt	29 298 724	33 102 276	48 435 286	45 681 821
Apskaitos vieneto vertė, Lt	0,8782	0,9581	1,4573	1,5642
Apskaitos vienetų skaičius	33 362 439	34 550 011	33 235 276	29 203 740

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)	2 267 196	2 003 076
Apskaitos vienetų skaičius (konvertuojant vienetus į pinigines lėšas)	1 073 412	900 977

### III. ATSKAITYMAI IŠ PENSIJŲ TURTO

#### 7. Atskaitymai iš pensijų turto:

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

Atskaitymai	Atskaitymų dydis		Per ataskaitinį laikotarpį priskaičiuotų atskaitymų suma (Lt)	Per ataskaitinį laikotarpį sumokėtų mokesčių suma (Lt)	% nuo ataskaitinio laikotarpio vidutinės grynųjų aktyvų vertės
	maksimalus, nustatytas sudarymo dokumentuose	ataskaitiniu laikotarpiu taikytas			
Už valdymą :					
<i>nekintamas dydis</i>	1,00 proc.	1,00 proc.	142 274	138 201	0,48%
<i>sėkmės mokestis</i>	-	-			
depozitoriumui	0,30 proc.	0,20 proc.	28 568	28 092	0,10%
Už sandorių sudarymą			4 766	4 766	0,02%
Už auditą			4 876	7 140	0,02%
Kitos veiklos išlaidos (nurodyti išlaidų rūšis)	-	-			
Išlaidų, įskaičiuojamų į BIK, suma*					
BIK % nuo GAV *					
Visų išlaidų suma			180 484	178 200	0,61%
PAR (praėjusio analogiško ataskaitinio laikotarpio PAR)*					

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

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

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

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

Tarpininko pavadinimas	Sumokėti mokesčiai Lt	Paslaugos pavadinimas	Ar susijęs su valdymo įmone
<i>Skandinaviska Enskilda Banken AB</i>	4 040	Komisinis mokestis už sandorius	Ne
AB SEB bankas	726	Komisinis mokestis už sandorius	Taip
Iš viso	4 766		

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 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	260 000	260 000	515 973	288 600	<a href="http://market.lt.omxgroup.com">http://market.lt.omxgroup.com</a>	0,0319	0,8718
Baltika	EE	EE3100003609	122 958	271 331	587 563	241 993	<a href="http://market.lt.omxgroup.com">http://market.lt.omxgroup.com</a>	0,6595	0,731
Tallink Grupp	EE	EE310000446E	475 000	1 048 183	933 482	541 226	<a href="http://market.lt.omxgroup.com">http://market.lt.omxgroup.com</a>	0,0705	1,635
Talina Kaubamaja AS	EE	EE0000001105	66 719	147 229	980 067	559 793	<a href="http://market.lt.omxgroup.com">http://market.lt.omxgroup.com</a>	0,1638	1,6911
Olympic Entertainment Group	EE	EE3100084021	247 000	545 055	1 009 661	503 177	<a href="http://market.lt.omxgroup.com">http://market.lt.omxgroup.com</a>	0,1636	1,52
Iš viso:			1 171 677	2 271 798	4 026 745	2 134 789			6,4489
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:				2 271 798	4 026 745	2 134 789			6,4489

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

Iš viso:									
Ne nuosavybės vertybiniai popieriai, kuriais prekiaujama kitose reguliuojamose rinkose									
Iš viso:									
Išleidžiami nauji ne nuosavybės vertybiniai popieriai									
Iš viso:									
Iš viso ne nuosavybės vertybinių popierių:									

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	358	SEB Asset Management S.A.	1 512 329	1 049 876	<a href="http://www.bourse.lu">http://www.bourse.lu</a> Elektroninio pašto pranešimas	KIS 3	3,1716
Raiffeisen Euro Bond	AT	AT0000785308	4 532	Raiffeisen Kapitalanlage-Gesellschaft m.b.H.	1 665 200	1 730 399	informacinė sistema Bloomberg	KIS 1	5,2274
Raiffeisen-Eastern European Equities	AT	AT0000785241	926	Raiffeisen Kapitalanlage-Gesellschaft m.b.H.	517 920	589 269	informacinė sistema Bloomberg	KIS 3	1,7801
SEB Fund 1 - SEB Europe 1 Fund	LU	LU0030166507	110 669	SEB Asset Management S.A.	1 080 152	880 899	<a href="http://www.bourse.lu">http://www.bourse.lu</a> Elektroninio pašto pranešimas	KIS 3	2,6611
SEB Fund 1 - SEB North America Fund	LU	LU0030166176	312 967	SEB Asset Management S.A.	3 671 899	2 520 887	<a href="http://www.bourse.lu">http://www.bourse.lu</a> Elektroninio pašto pranešimas	KIS 3	7,6154
SEB Sicav 1-SEB Eastern Europe ex Russia	LU	LU0070133888	167 671	SEB Asset Management S.A.	897 728	1 074 268	<a href="http://www.bourse.lu">http://www.bourse.lu</a> Elektroninio pašto pranešimas	KIS 3	3,2453
SEB NVS akciju fondas	LT	LTIF00000104	1 636 640	UAB SEB investicijų valdymas	3 212 205	2 020 269	<a href="http://www.seb.lt">www.seb.lt</a>	KIS 3	6,1031

Raiffeisen EuroPlus Bond	AT	AT0000689971	51 102	Raiffeisen Kapitalanlage-Gesellschaft m.b.H.	1 819 903	1 845 625	informacine sistema Bloomberg	KIS 1	5,5755
JB Commodity Fund EUR-C	LU	LU0244125398	6 085	Bank Julius Baer & Co. AG, Zurich	2 096 079	1 607 037	<a href="http://jbggroup.jbfundnet.com">http://jbggroup.jbfundnet.com</a>	KIS 5	4,8547
JB US Leading Stock Fund-C	LU	LU0099407586	2 032	Bank Julius Baer & Co. AG, Zurich	2 043 136	1 453 655	<a href="http://jbggroup.jbfundnet.com">http://jbggroup.jbfundnet.com</a>	KIS 3	4,3914
SEB Fund 2-SEB Russia Fund	LU	LU0273119544	82 353	SEB Asset Management S.A.	1 149 975	1 693 868	<a href="http://www.bourse.lu">http://www.bourse.lu</a> Elektroninio pašto pranešimas	KIS 3	5,117
JB Europe Stock Fund-C	LU	LU0099389313	1 224	Bank Julius Baer & Co. AG, Zurich	1 335 257	993 269	<a href="http://jbggroup.jbfundnet.com">http://jbggroup.jbfundnet.com</a>	KIS 3	3,0006
JB Europe Growth-C	LU	LU0099406851	4 517	Bank Julius Baer & Co. AG, Zurich	1 215 222	985 652	<a href="http://jbggroup.jbfundnet.com">http://jbggroup.jbfundnet.com</a>	KIS 3	2,9775
JB US Value Stock Fund-C	LU	LU0135057056	5 160	Bank Julius Baer & Co. AG, Zurich	1 388 879	1 297 692	<a href="http://www.bourse.lu">http://www.bourse.lu</a> Elektroninio pašto pranešimas	KIS 3	3,9202
HSBC GIF-EU CORE BD-IC	LU	LU0165130088	21 422	HSBC Investment Funds Luxembourg	1 308 522	1 393 715	<a href="https://www.hsbcinvestments.com">https://www.hsbcinvestments.com</a>	KIS 1	4,2103
HSBC GIF-ASIA X JAPAN EQ-I	LU	LU0165193169	10 648	HSBC Investment Funds Luxembourg	717 209	980 601	<a href="https://www.hsbcinvestments.com">https://www.hsbcinvestments.com</a>	KIS 3	2,9623
HSBC GIF-BRIC MARKET-IC	LU	LU0254983488	59 140	HSBC Investment Funds Luxembourg	1 464 031	1 800 031	<a href="https://www.hsbcinvestments.com">https://www.hsbcinvestments.com</a>	KIS 3	5,4377
HSBC GIF-JAPANESE EQUITY-AI	LU	LU0164882242	12 538	HSBC Investment Funds Luxembourg	1 490 639	1 618 286	<a href="https://www.hsbcinvestments.com">https://www.hsbcinvestments.com</a>	KIS 3	4,8887

HSBC GIF-EUROLAND EQ-IC	LU	LU0165074823	15 145	HSBC Investment Funds Luxembourg	985 551	1 119 942	<a href="https://www.hsbcinvestments.com">https://www.hsbcinvestments.com</a>	KIS 3	3,3832
HSBC GIF -US Equity -I\$	LU	LU0164902883	68 919	HSBC Investment Funds Luxembourg	2 534 742	2 658 102	<a href="https://www.hsbcinvestments.com">https://www.hsbcinvestments.com</a>	KIS 3	8,0299
Iš viso:			2 574 048		32 106 579	29 313 342			88,553
Kitų kolektyvinio investavimo subjektų vienetai (akcijos)									
EEREIF	EE	EE3500096500	21 936	AS Gild Property Asset Management	1 011 167	986 338	<a href="http://market.lt.mxgroup.com">http://market.lt.mxgroup.com</a>	KIS 5	2,9796
Iš viso:			21 936		1 011 167	986 338			2,9796
Iš viso KIS vienetų (akcijų):					33 117 746	30 299 680			91,5326

\* 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 numatyta 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	Valiu-ta	Investicinis sandoris (pozicija)	Sandorio (pozicijos) vertė	Bendra rinkos vertė	Rinkos pavadinimas (tinklalapis o 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		35 039		2009.09.14	0,1058
RYU9	Chicago Mercantile Exchange	US	Chicago Mercantile Exchange	JPY	CME EUR/JPY FUTURE		- 32 127		2009.09.14	-0,097
Iš viso:							2 912			0,0088
Kitos išvestinės finansinės priemonės										
Iš viso:										
Iš viso išvestinių finansinių priemonių							2 912			0,0088

Banko pavadinimas	Valiuta	Bendra rinkos vertė	Palūkanų norma	Dalis GA, %
Pinigai				
AB SEB bankas	LTL	37 782		0,1141
AB SEB bankas	EUR	276		0,0008
AB SEB bankas	JPY	0		0
AB SEB bankas	USD	887		0,0026
AB SEB bankas	SEK	6 927		0,0209
SEB London Futures	EUR	1 906		0,0057
SEB London Futures	USD	549 444		1,6598
SEB London Futures	JPY	131 384		0,3969
Iš viso pinigų:		728 605		2,2008

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	-	-	-	-
Įmonių obligacijos	-	-	-	-
Akcijos	2 134 789	6,45%	2 135 769	7,29%
KIS	30 299 680	91,53%	25 360 798	86,56%
Išvestinės priemonės	2 912	0,01%	662 968	2,26%
Grynieji pinigai ir pinigų rinkos priemonės	664 895	2,01%	1 139 189	3,89%
Iš viso	33 102 276	100,00%	29 298 724	100,00%
Pagal valiutas				
LTL	2 282 875	6,90%	2 371 605	8,09%
EUR	17 798 560	53,77%	17 604 483	60,09%
Kita valiuta	13 020 840	39,34%	9 322 636	31,82%
Iš viso	33 102 276	100,00%	29 298 724	100,00%
Pagal geografinę zoną				
Lietuva	2 291 030	6,92%	2 396 356	8,18%
kitos Europos Sąjungos valstybės	30 808 334	93,07%	26 239 401	89,56%
kitos Europos ekonominei erdvės valstybės (Islandija, Norvegija, Lichtenšteinas)	-	-	-	-
Jungtinės Amerikos Valstijos ir Kanada	2 912	0,01%	667 491	2,28%
kitos šalys	-	-	- 4 523	-0,02%
Iš viso	33 102 276	100,00%	29 298 724	100,00%
Pagal regionus				
Vakarų Europos obligacijos	4 969 738	15,01%	4 477 004	15,28%
Vidurio ir Rytų Europos akcijos	3 798 326	11,47%	2 135 769	7,29%
Vakarų Europos akcijos	5 029 638	15,19%	5 247 023	17,91%
Japonijos akcijos	1 618 286	4,89%	1 244 481	4,25%
NVS akcijos	3 714 137	11,22%	2 846 973	9,72%
Šiaurės Amerikos akcijos	7 930 336	23,96%	8 149 366	27,81%
Azijos be Japonijos akcijos	980 601	2,96%	653 626	2,23%
Sektoriniai fondai	1 607 037	4,85%	830 064	2,83%
Besivystančios rinkos	1 800 031	5,44%	653 215	2,23%
Iš viso	31 448 131	95,00%	26 237 521	89,55%

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 )	-	6 030 000	JPY	Valiutos draudimas	Reguliuojamų rinkų IP
CME S+POOR 500 EMINI_FUTURE	Ateities sandoris (angl. future )	-	12 063	USD	Investicijų į akcijų rinkas rizikos valdymas	Reguliuojamų rinkų IP
CME USD/EUR CURR FUTURE	Ateities sandoris (angl. future )	-	357 319	USD	Valiutos draudimas	Reguliuojamų rinkų IP
EUREX BUND FUTURE	Ateities sandoris (angl. future )	-	- 5 710	EUR	Obligacijų rizikos valdymas	Reguliuojamų rinkų IP
EUREX EURO STOXX 50	Ateities sandoris (angl. future )	-	6 080	EUR	Investicijų į akcijų rinkas rizikos valdymas	Reguliuojamų rinkų IP
SIMEX NIKKEI STOCK AVERAGE 225	Ateities sandoris (angl. future )	-	235 000	JPY	Investicijų į akcijų rinkas rizikos valdymas	Reguliuojamų rinkų IP

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

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 priemonių, rizika yra vertinama atsižvelgus į jų nominaliąją vertę. Ši rizika yra ribojama stebint, kad vienos valiutos sandorių 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 šias priemones, yra keičiama bendra fondo palūkanų normų rizika (obligacijų rinkos rizika). Norėdama valdyti šią riziką, valdymo įmonė riboja fondo investicijų į skolos vertybinių popierių 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 rizika yra nustatoma atsižvelgus į jų nominaliąją vertę. Ši rizika yra ribojama stebint, kad bendra fondo investicijų į pasaulio akcijų 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 svyravimo įtakos fondo rezultatams. Akcijų kitimo rizika buvo valdoma norint išvengti neigiamos akcijų kainų svyravimo įtakos fondo rezultatams. Sudarant valiutos keitimo ateities sandorius, buvo stengiamasi mažinti valiutos riziką investuojant JAV doleriais, Japonijos jenomis ar į fondus, kurių bazinė valiuta yra JAV doleriai ar Japonijos jenos.

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

Priemonės rūšis	Išpirkimo data	Įsipareigojimų vertė valiuta ataskaitinio laikotarpio pabaigoje	Valiutos kodas	Pastabos
CME EUR/JPY FUTURE	2009 09 14	-1 245 000	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 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: 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	728 605	1 315 113	5 360 081
II.	TERMINUOTIEJI INDEĖLIAI		-	-	-
III.	INVESTICIJOS	1,2	32 434 469	26 561 657	51 281 817
1	Skolos vertybiniai popieriai		-	-	490 642
1.1.	vyriausybių ir centrinių bankų arba jų garantuoti skolos vertybiniai popieriai		-	-	-
1.2.	kiti skolos vertybiniai popieriai		-	-	490 642
2	Nuosavybės vertybiniai popieriai		2 134 789	2 007 424	-
3	Kolektyvinio investavimo subjektų investiciniai vienetai ir akcijos		30 299 680	24 554 233	50 791 175
4	Kitos investicijos		-	-	-
IV.	PRETENZIJOS DĖL IŠVESTINIŲ FINANSINIŲ PRIEMONIŲ	2	35 039	662 677	127 466
V.	GAUTINOS SUMOS	2	429	4 844	28 618
1	Investicijų pardavimo sandorių gautinos sumos		-	-	-
2	Kitos gautinos sumos		429	4 844	28 618
	IŠ VISO TURTO		33 198 542	28 544 291	56 797 982

Eil. nr.	Įsipareigojimai ir gryniesi aktyvai		2009 06 30	2008 12 31	2007 12 31
VI.	ĮSIPAREIGOJIMAI		64 139	187 510	368 143
1	Investicijų pirkimo įsipareigojimai		-	-	-
2	Mokėtinos sumos kaupimo bendrovei ir depozitoriumui		51 874	66 228	257 353
3	Kitos mokėtinos sumos ir įsipareigojimai		12 265	121 282	110 790
VII.	ĮSIPAREIGOJIMAI DĖL IŠVESTINIŲ FINANSINIŲ PRIEMONIŲ		32 127	5 179	26 135
VIII.	GRYNIEJI AKTYVAI (I+II+III+IV+V-VI-VII)		33 102 276	28 351 602	56 403 704
	IŠ VISO ĮSIPAREIGOJIMŲ IR GRYNŲJŲ AKTYVŲ		33 198 542	28 544 291	56 797 982

15 – 20 puslapiuose pateiktas aiškinamasis raštas yra neatskiriama šių finansinių ataskaitų dalis..

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

### GRYNŲJŲ 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		28 351 602	56 403 704	38 738 170
II.	IŠ VISO PADIDĖJIMO		9 687 297	8 420 642	29 843 700
1	Pensijų įmokos		1 883 808	3 034 187	5 563 708
2	Iš kitų pensijų fondų pervestos sumos		119 268	183 985	940 710
3	Kaupimo bendrovės garantinės įmokos		-	-	-
4	Palūkanos ir dividendai		67 796	11 625	121 123
5	Investicijų pardavimo pelnas		63 202	765 089	216 246
6	Investicijų vertės padidėjusi dalis		5 757 534	1 054 552	18 040 004
7	Turto vertės padidėjimas dėl užsienio valiutų kursų pasikeitimo		663 831	44 040	2 343 952
8	Kitos pajamos	3	1 131 858	3 327 164	2 617 957
III.	IŠ VISO SUMAŽĖJIMO		4 936 623	16 389 060	22 900 049
1	Pensijų išmokos		533 321	5 938 469	1 448 056
2	Į kitus pensijų fondus pervestos sumos		367 656	322 201	268 965
3	Investicijų pardavimo nuostoliai		63 167	1 408 595	131 187
4	Investicijų vertės sumažėjusi dalis		2 182 673	6 589 065	15 601 146
5	Turto vertės sumažėjimas dėl užsienio valiutų kursų pasikeitimo		662 241	1 324 213	2 801 540
6	Valdymo sąnaudos	4	198 789	339 711	370 360
7	Kitos sąnaudos	5	928 776	466 806	2 278 795
IV.	GRYNIEJI AKTYVAI ATASKAITINIO LAIKOTARPIO PABAIGOJE		33 102 276	48 435 286	45 681 821

		2009 01 01– 2009 06 30	2008 01 01– 2008 06 30	2007 01 01– 2007 06 30
V.	APSKAITOS VIENETO VERTĖ	0,9581	1,4573	1,5642
VI.	APSKAITOS VIENETŲ SKAIČIUS	34 550 011	33 235 276	29 203 740

14 – 20 puslapiuose pateiktas aiškinamasis raštas yra neatskiriama šių finansinių ataskaitų dalis.

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

## AIŠKINAMASIS RAŠTAS

### Bendroji informacija

Papildomo savanoriško pensijų kaupimo fondo *Pensija 2 plus* taisyklės Nr. PF-S02-K001-018(001) patvirtino Lietuvos Respublikos vertybinių popierių komisija 2004 m. spalio 21 d. 2006 m. vasario 9 d pensijų fondo pavadinimas pakeistas į *SEB pensija 2 plus*.

Pensijų fondą *SEB pensija 2 plus* (toliau - Fondas) valdo UAB *SEB investicijų valdymas* (toliau - Bendrovė), įsteigta ir įregistruota 2000 m. gegužės mėn. 3 d., įmonės kodas 125277981. 2003 m. rugpjūčio mėn. 28 d. Lietuvos Respublikos vertybinių popierių komisijos sprendimu Bendrovei išduota valdymo įmonės, veikiančios pagal LR Kolektyvinio investavimo subjektų įstatymą, veiklos licencija Nr. VĮK – 001.

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

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

### Apskaitos principai

Finansinės ataskaitos 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 ataskaitos yra penktųjų veiklos metų finansinės ataskaitos. Fondas pirmąsias įmokas ir pajamas gavo 2004 m. lapkričio 3 d.

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

Fondo apskaita tvarkoma atskirai nuo Bendrovės bei 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).

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

### Investavimo politika

Fonde sukauptas turtas investuojamas taip, kad nuosekliai didėtų jo vertė ir išliktų priimtina (vidutinė) rizika. Didžiausia šio fondo lėšų dalis (60–100 proc.) investuojama į išvystytą pasaulio rinkų, Lietuvos ir kitų Baltijos šalių įmonių akcijas. Į valstybių vyriausybių ir bendrovių skolos VP, pinigų rinkos priemones, banko indėlius investuoja nuo 0 iki 40 proc. fondo turto.

Į kitas turto klases investuojama iki 16 proc. fondo turto.

Fondo investicijos gali būti įvairiomis užsienio valiutomis.

### Finansinės rizikos valdymo politika

Su Fondo investicijomis yra susijusi ši rizika:

1. palūkanų normų rizika – siekiant sumažinti šią riziką, ribojama Fondo investicijų vidutinė trukmė iki išpirkimo iki 9 metų. Valdydama šią riziką, Bendrovė gali naudoti išvestines finansines priemones;
2. rinkų ir kredito rizika – laikomasi nustatyto mažiausio VP emitento (valstybės) kredito reitingo reikalavimų. Valdydama šią riziką, Bendrovė gali naudoti išvestines finansines priemones;
3. VP pasirinkimo rizika – vertybinių popierių pasirinkimo rizika valdoma laikantis fondo investicijų portfelio diversifikavimo reikalavimų.

4. infliacijos ir valiutų kursų svyravimų rizika – Bendrovė valdo infliacijos riziką investuodama Fondo pensijų fondo turtą į valstybių, kurių ilgalaikiai infliacijos didėjimo tempai yra mažesni už besivystančių didesnės investavimo rizikos valstybių infliacijos didėjimo tempus, vertybinius popierius. Bendrovė valdo valiutų kursų riziką diversifikuodama investicijų portfelį ne tik pagal regionus, bet ir pagal skirtingas valiutas.

Indėlių draudimo fondas VĮ *Indėlių ir investicijų draudimas* ar kitos valstybinės garantijų ar draudimo agentūros negarantuoja fondo investicijų ir/ar konkrečios jų gražos, todėl dalyviams išlieka laikino pensijų sąskaitose kaupiamo pensijų fondo 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 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 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, kitos išlaidos

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 yra:

1. turto valdymo mokestis – iki 1 proc. per metus nuo dalyvio pensijų sąskaitoje apskaičiuotų lėšų vidutinės metinės vertės;
  2. įmokos mokestis – iki 3 proc. dalyvio vardu įmokėtų įmokų. Įmokos mokestis neimamas, jei dalyvis lėšas į Fondą persiveda iš kito fondo.
- 2009 m. Bendrovė taiko 1 proc. turto valdymo mokestį ir 3 proc. dydžio įmokos mokestį.

Depozitoriumui Fondo lėšomis mokamas iki 0,3 proc. Fondo turto vidutinės vertės dydžio mokestis už su Fondo valdymu susijusias paslaugas, t. y. už Fondo turto apskaitą ir pensijų sąskaitų tvarkymą. 2009 m. šis mokestis yra 0,2 proc.

Iš pensijų fondo turto dengiamos faktinės išlaidos per metus negali viršyti 4 (keturių) proc. valdomo turto vertės.

Komisiniai mokesčiai vertybinių popierių prekybos tarpininkams už atliktus pirkimo, pardavimo ir kitus sandorius, valiutų keitimo ir piniginių lėšų pervedimo išlaidos, audito išlaidos yra dengiami iš Fondo turto.

Komisiniai mokesčiai vertybinių popierių prekybos tarpininkams už atliktus pirkimo, pardavimo ir kitus sandorius, valiutų pirkimo ir pardavimo sandorių sąnaudos, depozitoriumo mokesčiai priskiriami kitoms sąnaudoms.

Dalyviui pereinant į kitą Bendrovės valdomą fondą dažniau nei vieną kartą per kalendorinius metus, Bendrovė iš pervedamų lėšų gali išskaičiuoti išlaidas, susijusias su perėjimu į kitą pensijų fondą.

Dalyvis gali pereiti į kitos valdymo bendrovės valdomą pensijų fondą ar išstoti iš Fondo padengdamas tik Bendrovės išlaidas, susijusias su perėjimu į kitą fondą ar išstojimu.

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

Investicijų įvertinimo metodai, investicijų vertinimo periodiškumas

Investicijos į balansą įtraukiamos pagal ataskaitinio laikotarpio pabaigos tikrąją vertę.

Finansinių priemonių, kuriomis prekiaujama reguliuojamose rinkose, tikroji vertė nustatoma: nuosavybės VP, skolos VP ir pinigų rinkos priemonės vertinami pagal VPK patvirtintą GA vertės skaičiavimo metodiką;

išvestinės finansinės priemonės vertinamos pagal paskutinę analogiško anksčiau sudaryto sandorio rinkos vertę, jei per laikotarpį nuo sandorio sudarymo dienos iki vertinimo dienos nebuvo didelio ekonominių aplinkybių pasikeitimo. Jei minėta sąlyga netenkinama, vertinama pagal tikėtiną pardavimo kainą, nustatytą pagal parinktą vertinimo modelį (nurodytą bendrovės patvirtintose;

KIS vienetai (akcijos) vertinami pagal paskutinę viešai paskelbtą išpirkimo kainą; terminuoti indėliai bankuose vertinami pagal amortizuotos savikainos vertę.

Jei finansinės priemonės kotiruojamos keliose reguliuojamose rinkose, jų tikrajai vertei nustatyti yra naudojama tos reguliuojamos rinkos, kurios prekybai šiomis finansinėmis priemonėmis būdingas didesnis likvidumas, reguliarumas ir dažnumas, duomenys arba rinkos, kurioje yra emitento buveinė, duomenys. Jei finansinė priemonė nebuvo kotiruojama per paskutinę prekybos sesiją, tikrajai vertei nustatyti naudojama paskutinė žinoma, bet ne vėlesnė negu 30 dienų, vidutinė rinkos kaina arba uždarymo kaina. Jei priemonė nebuvo kotiruojama daugiau negu 30 dienų ar kotiruojama rečiau, negu nustatyta apskaičiavimo procedūrose, jos vertė nustatoma kaip priemonių, kuriomis reguliuojamose rinkose neprekiuojama.

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 „grynųjų aktyvų pokyčio ataskaitoje“ kaip „investicijų pardavimo pelnas“ arba „investicijų pardavimo nuostolis“.

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

Į apskaitą yra traukiama grynųjų 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 įsigijimo 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 „grynųjų aktyvų pokyčio ataskaitoje“ kaip „kitos pajamos“ arba „kitos sąnaudos“. Pasibaigus iš išvestinės finansinės priemonės kylančioms teisėms ir įsipareigojimams, apskaitoje yra registruojamas gautas (gautinas) ar sumokėtas (mokėtinas) atlygis.

Apskaitos vieneto vertės nustatymo taisyklės

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

Fondo apskaitos vienetai (jų dalys) neturi nominaliosios vertės.

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

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



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

#### 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. Investicijos į nuosavybės vertybinius popierius pinigų ekvivalentams nepriskiriamos.

#### Investicijų portfelio struktūra

Bendrovė, investuodama fondo turtą, laikosi šių diversifikavimo reikalavimų:

į vieno emitento VP ar pinigų rinkos priemones gali būti investuota ne daugiau kaip 5 proc. fondo turtą sudarančių grynujų aktyvų;

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);

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 turtą sudarančių grynujų aktyvų;

investicijos į obligacijas, išleistas tokios Europos Sąjungos valstybėje registruotą buveinę turinčios kredito įstaigos, negali būti didesnės kaip 25 proc. grynujų aktyvų;

bendra investicijų į VP suma gali sudaryti iki 80 proc. fondo turtą sudarančių grynujų aktyvų, jei į tokias vieno emitento obligacijas investuojama daugiau kaip 5 proc., bet ne daugiau kaip 25 proc. grynujų aktyvų;

investicijos į indėlius vienoje kredito įstaigoje negali sudaryti daugiau kaip 20 proc. fondo turtą sudarančių grynujų aktyvų.

Bendra investicijų į vieno emitento išleistus VP, pinigų rinkos priemones ar indėlius suma negali būti didesnė kaip 20 proc. fondo turtą sudarančių GA.

Į įmonių, priklausančių grupei, kuri turi sudaryti konsoliduotas finansines ataskaitas, išleistus VP ir pinigų rinkos priemones gali būti investuojama ne daugiau kaip 20 proc. 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
Nuosavybės vertybiniai popieriai	2 007 424	420 566	-64 032	324 306	-553 475	2 134 789
Kolektyvinio investavimo subjektų investiciniai vienetai ir akcijos	24 554 233	9 882 930	-7 917 752	6 061 359	-2 281 090	30 299 680
Iš viso	26 561 657	10 303 496	-7 981 784	6 385 665	-2 834 565	32 434 469

2 PASTABA TURTO STRUKTŪRA ATASKAITINIO LAIKOTARPIO PABAIGOJE

Turto arba emitento pavadinimas	Valstybės, į kurios vertybinius 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						728 605	2,19
Sąskaita AB SEB banke (LTL)	-	LTL	37 782	2,89	-	37 782	0,11
Sąskaita AB SEB banke (EUR)	-	EUR	80	0,65	-	276	-
Sąskaita AB SEB banke (SEK)	-	SEK	69 27	-	-	6 927	0,02
Sąskaita AB SEB banke (USD)	-	USD	360	0,22	-	887	-
SEB London Futures	-	EUR	552	-	-	1 906	0,01
SEB London Futures		USD	222 961			549 444	1,65
SEB London Futures		JPY	5 091 378			131 383	0,40
Investicijos						32 434 469	97,70
Baltika	EE	EUR	82 187	-	-	241 993	0,73
HSBS GIF -US Equity	LU	USD	-	-	-	2 658 102	8,02
HSBC GIF-ASIA X JAPAN EQ-I	LU	USD	-	-	-	980 601	2,95
HSBC GIF-BRIC MRKT-IC	LU	USD	-	-	-	1 800 031	5,42
HSBC GIF-EUROLAND	LU	EUR	-	-	-	1 119 942	3,37
HSBC GIF-JAPANESE EQUITY	LU	JPY	-	-	-	1 618 286	4,87
JB Europe Growth	LU	EUR	-	-	-	985 652	2,97
JB Europe Stock Fund	LU	EUR	-	-	-	993 269	2,99
JB US Leading Stock Fund	LU	USD	-	-	-	1 453 655	4,38
JB US Value Stock Fund	JAV	USD	-	-	-	1 297 692	3,91
AB TEO	LT	LTL	260 000	-	-	288 600	0,87
Olympic Entertainment Group	EE	EUR	93 933	-	-	503 177	1,52
Raffaisen-Eastern European Equities	AT	EUR				589 269	1,77
SEB Fund 1 - SEB Choice North America	LU	USD	-	-	-	2 520 887	7,59
SEB Fund 1 - SEB Europe 1 Fund	LU	EUR	-	-	-	880 899	2,65
SEB Fund 2-SEB Russia Fund	LU	EUR	-	-	-	1 693 868	5,10
NVS akcijų fondas	LT	LTL	-	-	-	2 020 269	6,09
SEB Sicav 1-SEB Eastern Europe ex Russia	LU	EUR				1 074 268	3,24
SEB Sicav 2 - SEB Europe Chance/Risk Fund	LU	EUR	-	-	-	1 049 876	3,16
Tallink Grupp	EE	EUR	303 525	-	-	541 226	1,63
Talina Kaubamaja AS	EE	EUR	28 755	-	-	559 793	1,69
AS Eastern Europe Real Estate Investment Trust	EE	EUR	-	-	-	986 338	2,97

Turto arba emitento pavadinimas	Valstybės, į kurios vertybinius 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.)
JB Commodity Fund EUR-C	LU	EUR		-	-	1 607 037	4,84
HSBC GIF-EU CORE BD-IC	LU	EUR	-	-	-	1 393 715	4,20
Raiffeisen Euro Bond	AT	EUR	-	-	-	1 730 399	5,21
Raiffeisen EuroPlus Bond	AT	EUR	-	-	-	1 845 625	5,56
Pretenzijos dėl išvestinių finansinių priemonių :	-	-	-	-	-	35 039	0,11
CME USD/EUR CURR FUT_2009.09.14		USD	-	-	2009 09 14	35 039	0,11
Kitos gautinos sumos						429	-
Iš viso	-	-	-	-	-	33 198 542	100,00

3 PASTABA KITOS PAJAMOS

Straipsnis	2009 01 01 – 2009 06 30	2008 01 01 – 2008 06 30
Valiutos pirkimo ir pardavimo pajamos	26 192	12 791
Gauta retrocesija	56 734	144 043
Išvestinių finansinių priemonių pajamos	1 048 932	3 170 321
Kitos pajamos		9
Iš viso	1 131 858	3 327 164

4 PASTABA VALDYMO SĄNAUDOS

Straipsnis	2009 01 01 – 2009 06 30	2008 01 01 – 2008 06 30
Turto valdymo mokestis	142 275	248 684
Pardavimo mokestis	56 514	91 027
Iš viso	198 789	339 711

5 PASTABA KITOS SĄNAUDOS

Straipsnis	2009 01 01 – 2009 06 30	2008 01 01 – 2008 06 30
Kitos sąnaudos		1
Valiutos pirkimo ir pardavimo sąnaudos	11 832	62 413
Palūkanų sąnaudos	140	4 507
Mokesčiai depozitoriumui	28 568	49 934
Audito sąnaudos	4 876	4 625
Maklerio mokesčio sąnaudos	4 766	3 225
Išvestinių finansinių priemonių sąnaudos	878 594	342 101
Iš viso	928 776	466 806

## VII. INFORMACIJA APIE PENSIJŲ FONDO DALYVIUS

### VIII. IŠORINIAI PINIGŲ SRAUTAI

28. Per ataskaitinį laikotarpį faktiškai gautos lėšos:

Bendra gautų lėšų suma		2 003 076
Periodinės įmokos į pensijų fondą	iš Valstybinio socialinio draudimo fondo	
	pačio dalyvio įmokėtos lėšos (pildoma tik papildomo savanoriško pensijų kaupimo pensijų fondo atveju)	1 241 634
	darbdavių ir kitų trečiųjų asmenų įmokėtos lėšos (pildoma tik papildomo savanoriško pensijų kaupimo pensijų fondo atveju)	642 174
Valstybinio socialinio draudimo fondo sumokėti delpinigiaai		
Iš garantijų rezervo sumokėtos lėšos		
Iš kitų pensijų fondų pervestos lėšos	iš tos pačios pensijų kaupimo bendrovės	119 172
	iš kitos pensijų kaupimo bendrovės	96
Kitos gautos lėšos (nurodyti šaltinį ir gautų lėšų sumą), iš viso		

29. Išmokėtos lėšos:

Bendra išmokėtų lėšų suma		900 977
Pensijų išmokos	vienartinės išmokos dalyviams	322 438
	periodinės išmokos dalyviams	
	išmokos anuiteto įsigijimui	
Į kitus pensijų fondus pervestos lėšos	valdomus tos pačios pensijų kaupimo bendrovės	360 325
	valdomus kitos pensijų kaupimo bendrovės	7 332
Išstojusiems dalyviams išmokėtos lėšos (pildoma tik papildomo savanoriško kaupimo pensijų fondų atveju)		188 037
Paveldėtojams išmokėtos lėšos		22 846
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.

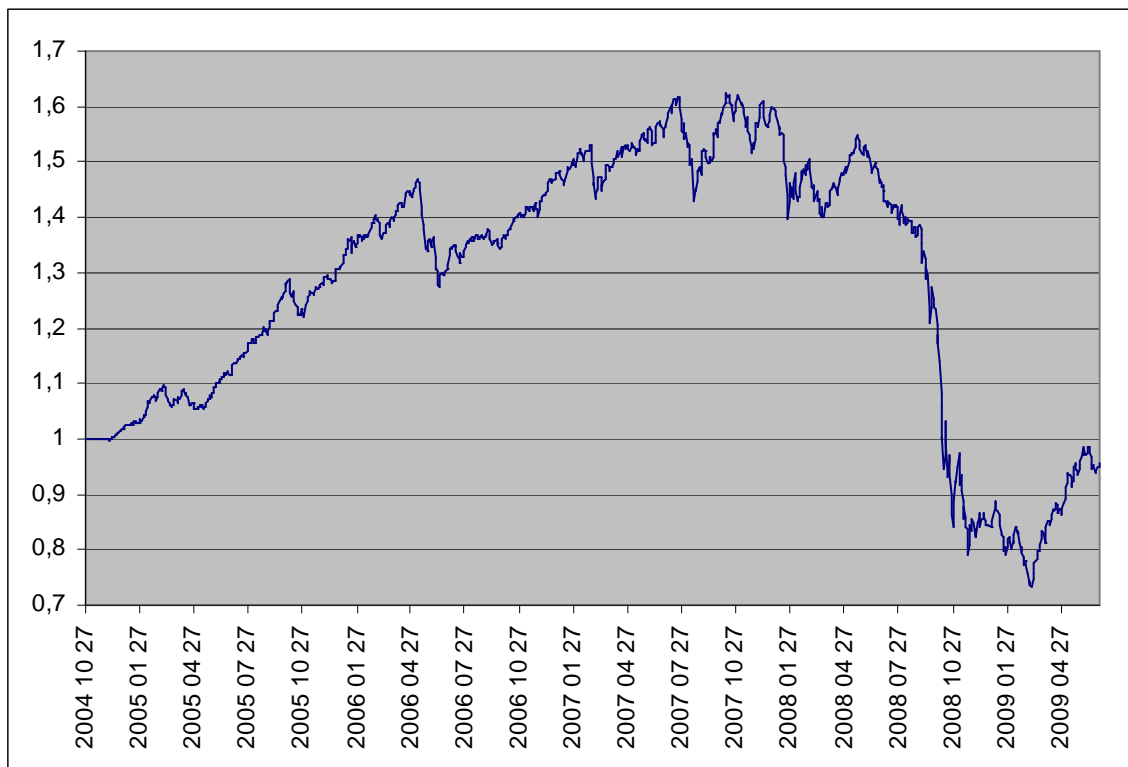
### X. INFORMACIJA APIE PENSIJŲ FONDO REIKMĖMS PASISKOLINTAS LĖŠAS

31. Pensijų fondo reikmėms pasiskolintos lėšos ataskaitinio laikotarpio pabaigoje:

Eil. Nr.	Paskolos suma	Paskolos valiuta	Paskolos paėmimo data	Paskolos grąžinimo 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.

-

\_\_\_\_\_