

2011 metų sausio – birželio mėnesių ataskaita

SEB pensija 1

2011 m. birželio 30 d.

SEB

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	6
VII. INFORMACIJA APIE PENSIJŲ FONDO DALYVIUS	23
VIII. IŠORINIAI PINIGŲ SRAUTAI.....	23
IX. INFORMACIJA APIE GARANTIJŲ REZERVĄ.....	24
X. INFORMACIJA APIE PENSIJŲ FONDO REIKMĖMS PASISKOLINTAS LĖŠAS.....	24
XI. KITA INFORMACIJA	24
XII. ATSAKINGI ASMENYS.....	25

**PENSIJŲ FONDO *SEB PENSIIJA 1*
2011 M. SAUSIO-BIRŽELIO MĖNESIŲ ATASKAITA**

I. BENDROJI INFORMACIJA

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

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

2. Ataskaitinis laikotarpis, už kurį pateikta ataskaita — 2011 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

interneto 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)
— Ignas Pliuškyš, 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 VERTĘ

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

(Žr. 23.3. punktas, 1 PASTABA)

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

(Žr. 23.3. punktas, 2 PASTABA)

III. ATSKAITYMAI IŠ PENSIJŲ TURTO

7. Atskaitymai iš pensijų turto (pildoma fondo tipą atitinkanti lentelė):

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

Atskaitymai	Taisyklėse nustatyti maksimalūs dydžiai	Faktiškai taikomi atskaitymų dydžiai	Per ataskaitinį laikotarpį priskaičiuota atskaitymų suma (Lt)
Nuo įmokų	2,00 proc.	2,00 proc.	179 037
Nuo turto vertės	1,00 proc.	1,00 proc.	1 021 576
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.	6 579

Atskaitymai	Taisyklėse nustatyti maksimalūs dydžiai	Faktiškai taikomi atskaitymų dydžiai	Per ataskaitinį laikotarpį priskaičiuota atskaitymų suma (Lt)
<i>pensijų kaupimo bendrovės keitimas daugiau kaip kartą per metus</i>	4,00 proc.	-	-
Iš viso			1 207 192
BAR *			-
Sąlyginis BIK ir (arba) tikėtinas sąlyginis BIK *			-
PAR (portfelio apyvartumo rodiklis)*			-

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

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

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

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

(Žr. 23.3. punktas, 8 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 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:

(Žr. 23.3. punktas, 4 PASTABA)

12. (neteko galios)

Punkto pakeitimai:

Nr. 1K-2, 2011-01-06, Žin., 2011, Nr. 3-124 (2011-01-08)

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).

(Žr. 23.3. punktas, 6 PASTABA)

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.

Per ataskaitinį laikotarpį fondas sudarė obligacijų, kurių kainų pokytis priklauso nuo Vokietijos 2, 5, 10 ir 30 metų trukmės obligacijų kainų pokyčio, ateities sandorius (*futures*) ir išankstinius valiutos keitimo sandorius (*forwards*).

Ateities sandorių rizika priklauso nuo 2, 5, 10 ir 30 metų Vokietijos vyriausybės obligacijų eurais palūkanų kitimo rinkoje. Vokietijos 2, 5, 10 ir 30 metų obligacijų ateities sandorių rizika yra apskaičiuojama taikant vidutinės finansinės trukmės rodiklį. Bendra portfelio vidutinė finansinė trukmė yra apskaičiuojama atsižvelgiant į portfelio obligacijų ir minėtų ateities sandorių finansinę trukmę.

Siekiamą fondo finansinę trukmę nustato fondo valdytojas. Šis sprendimas yra priimamas atsižvelgiant į rinkų analizę ir prognozes. Sudarant obligacijų ateities sandorius, fondo valdytojo sprendimai įgyvendinami greitai ir pigiai. Sudarius Vokietijos 2, 5, 10 arba 30 metų trukmės obligacijų ateities sandorius, galima suvienodinti dabartinę ir nustatytą (siekiamą) fondo finansinę trukmę.

Išankstinių valiutos keitimo sandorių rizika priklauso nuo valiutos kurso pokyčių. Sudarydamas išankstinius valiutos keitimo sandorius, fondas prisiima išankstinių sandorių emitento kredito riziką. Tokių išvestinių priemonių kredito rizika lygi jų rinkos vertei, jei rinkos vertė yra teigiama fondo atžvilgiu, arba rizika yra prilyginama nuliui priešingu atveju. Fondo sandorio šalies rizika ir emitento rizika sumuojamos kiekvieno konkretaus asmens (sandorio šalies ir emitento) atžvilgiu ir ta suma negali būti didesnė kaip 20 proc. grynųjų aktyvų vertės. Apskaičiuojant fondui nustatytus investavimo į vieną emitentą apribojimus, yra atsižvelgiama ir į turimas išvestinių finansinių priemonių pozicijas.

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

(Žr. 23.3. punktas, 7 PASTABA)

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

Ataskaitiniu laikotarpiu fondo investicijų portfelis atitiko taisyklėse nustatytą investicijų strategiją.

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

Ataskaitiniu laikotarpiu fondo investicijų portfelio vertės pokyčiams didžiausią įtaką turėjo:

1. Nerimas dėl kai kurių Europos Sąjungos narių ekonomikos būklės. Nestabili Graikijos, Ispanijos, Airijos, Portugalijos ir Italijos ekonomikos būklė lėmė, kad investuotojai investavo į aukščiausio reitingo obligacijas, tokias kaip Vokietijos ir Prancūzijos vyriausybės. Dėl šios priežasties šių obligacijų kaina kilo. Tuo tarpu Pietų Europos šalių vyriausybės obligacijų kaina krito. Kadangi fondo lėšos daugiausia buvo investuojamos į aukštesnio reitingo obligacijas, fondo vieneto vertė kilo.

2. Lietuvos Respublikos Vyriausybės obligacijų priedo už riziką mažėjimas. 2011 metais investuotojai ir toliau gerai vertino Lietuvos ekonomikos būklę, kuri gerėjo bei tapo daug stabilesnė, todėl Lietuvos Respublikos Vyriausybės obligacijų kainos kilo, o pajamingumas mažėjo.

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. grynujų aktyvų ataskaitą;

GRYNUJŲ AKTYVŲ ATASKAITA (LT)

2011 m. birželio 30 d.

Eil. nr.	Straipsniai	Pastabos Nr.	Finansiniai metai 2011 06 30	Praėję finansiniai metai 2010 12 31
A.	TURTAS		209 603 363	205 160 033
I.	PINIGAI	4	1 982 958	2 766 356
II.	TERMINUOTIEJI INDĖLIAI		-	-
III.	PINIGŲ RINKOS PRIEMONĖS		-	-
III.1.	Valstybės išdo vekseliai		-	-
III.2.	Kitos pinigų rinkos priemonės		-	-
IV.	PERLEIDŽIAMIEJI VERTYBINIAI POPIERIAI	3, 4	207 518 377	202 357 318
IV.1.	Ne nuosavybės vertybiniai popieriai		207 518 377	202 357 318
IV.1.1.	Vyriausybių ir centrinių bankų arba jų garantuoti ne nuosavybės vertybiniai popieriai		207 518 377	202 357 318
IV.1.2.	Kiti ne nuosavybės vertybiniai popieriai		-	-
IV.2.	Nuosavybės vertybiniai popieriai		-	-
IV.3.	Kitų kolektyvinio investavimo subjektų investiciniai vienetai ir akcijos		-	-
V.	GAUTINOS SUMOS	4	10 844	1 140
V.1.	Investicijų pardavimo sandorių gautinos sumos		-	-
V.2.	Kitos gautinos sumos		10 844	1 140
VI.	INVESTICINIS IR KITAS TURTAS	4	91 184	35 219
VI.1.	Investicinis turtas		-	-
VI.2.	Išvestinės finansinės priemonės		91 184	35 219
VI.3.	Kitas turtas		-	-
B.	ĮSIPAREIGOJIMAI	4	823 287	760 543
I.	Finansinio ir investicinio turto pirkimo įsipareigojimai		-	-
II.	Įsipareigojimai kredito įstaigoms		-	-
III.	Įsipareigojimai pagal išvestinių finansinių priemonių sutartis		106 847	355 215
IV.	Valdymo įmonei ir depozitoriumui mokėtinos sumos		181 732	185 590
V.	Kitos mokėtinos sumos ir įsipareigojimai		534 708	219 738
C.	GRYNIIEJI AKTYVAI		208 780 076	204 399 490

8 – 23 puslapiuose pateiktas aiškinamasis raštas yra neatskiriama šių finansinių ataskaitų dalis.

23.2. grynujų aktyvų pokyčių ataskaitą;

GRYNUJŲ AKTYVŲ POKYČIŲ ATASKAITA (LT)

2011 m. birželio 30 d.

Eil. nr.	Straipsniai	Pastabos Nr.	Finansiniai metai 2011 01 01- 2011 06 30	Praėję finansiniai metai 2010 01 01- 2010 06 30
I.	GRYNUJŲ AKTYVŲ VERTĖ ATASKAITINIO LAIKOTARPIO PRADŽIOJE		204 399 490	195 884 554
II.	GRYNUJŲ AKTYVŲ VERTĖS PADIDĖJIMAS		16 474 058	19 770 773
II.1.	Dalyvių įmokos į fondą		8 951 249	7 779 696
II.2.	Iš kitų fondų gautos sumos		1 450 989	1 879 566
II.3.	Garantinės įmokos		-	-
II.4.	Palūkanų pajamos		4 003 814	3 826 125
II.5.	Dividendai		109 360	-
II.6.	Pelnas dėl investicijų vertės pasikeitimo ir pardavimo		1 487 092	5 999 616
II.7.	Pelnas dėl užsienio valiutos kursų pokyčio		167 220	61 161
II.8.	Išvestinių finansinių priemonių pelnas		304 334	224 609
II.9.	Kitas grynujų aktyvų vertės padidėjimas		-	-
	PADIDĖJO IŠ VISO:		16 474 058	19 770 773
III.	GRYNUJŲ AKTYVŲ VERTĖS SUMAŽĖJIMAS		12 093 472	12 587 440
III.1.	Išmokos fondo dalyviams		2 617 218	1 730 520
III.2.	Išmokos kitiems fondams		4 243 689	5 806 948
III.3.	Nuostoliai dėl investicijų vertės pasikeitimo ir pardavimo		3 834 262	3 301 609
III.4.	Nuostoliai dėl užsienio valiutos kursų pokyčio		191 111	45 556
III.5.	Išvestinių finansinių priemonių sandorių nuostoliai		-	567 825
III.6.	Valdymo sąnaudos:		1 207 192	1 134 982
III.6.1.	Atlyginimas valdymo įmonei		1 207 192	1 134 974
III.6.2.	Atlyginimas depozitoriumui		-	-
III.6.3.	Atlyginimas tarpininkams		-	-
III.6.4.	Audito sąnaudos		-	-
III.6.5.	Kitos sąnaudos		-	8
III.7.	Kitas grynujų aktyvų vertės sumažėjimas		-	-
III.8.	Sąnaudų kompensavimas (-)		-	-
III.9.	Pelno paskirstymas		-	-
	SUMAŽĖJO IŠ VISO:		12 093 472	12 587 440
IV.	GRYNUJŲ AKTYVŲ VERTĖ ATASKAITINIO LAIKOTARPIO PABAIGOJE		208 780 076	203 067 887

8 – 23 puslapiuose pateiktas aiškinamasis raštas yra neatskiriama šių finansinių ataskaitų dalis.

23.3. aiškinamąjį raštą.

AIŠKINAMASIS RAŠTAS

Bendroji informacija

Valstybinio socialinio draudimo įmokos dalies kaupimo konservatyvaus investavimo pensijų fondo *SEB pensija 1* (toliau – Fondas) taisyklės Nr. PF-V01-K001-001(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 1*.

Pensijų fondą *SEB pensija 1* valdo UAB *SEB investicijų valdymas* (toliau – Bendrovė), įsteigta ir įregistruota 2000 m. gegužės 3 d., įmonės kodas 125277981. 2003 m. rugpjūčio 28 d. Lietuvos Respublikos vertybinių popierių komisijos sprendimu bendrovei išduota valdymo įmonės, veikiančios pagal Lietuvos Respublikos kolektyvinio investavimo subjektų įstatymą, veiklos licencija Nr. VĮK – 001.

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

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

Apskaitos principai

Finansinės ataskaitos parengtos vadovaujantis Lietuvos Respublikos buhalterinės apskaitos įstatymu, 39-ojo verslo apskaitos standartu „Kolektyvinio investavimo subjektų ir pensijų fondų apskaita, finansinės ataskaitos“, bendraisiais apskaitos principais, nustatytais verslo apskaitos standartuose ir kitais 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) 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 traukimo į apskaitą diena yra perkamo turto gavimo arba parduodamo turto perleidimo diena.

Išvestinės finansinės priemonės grynųjų aktyvų ataskaitoje parodomas kaip turtas, jeigu tikroji vertė yra teigiama, arba kaip išsipareigojimas, 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.

b) Grynųjų aktyvų vertės ir vienetų vertės apskaičiavimo principai

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

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

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

Turtas (ar jo dalis) yra nurašomas tik tada, kai įgyvendinamos teisės į šį turtą (ar jo dalį) arba kai baigiasi teisių galiojimo laikas, arba kai šios teisės perleidžiamos.

Išsipareigojimai skaičiuojami pagal Verslo apskaitos standartų reikalavimus.

Išsipareigojimai (ar jų dalis) turi būti nurašomi tik tada, kai jie išnyksta, t. y. kai sutartyje nustatyti išsipareigojimai įvykdomi, anuliuojami ar nustoja galioti.

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

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

1. priemonės yra kotiruojamos keliuose reguliuojamose rinkose; tuo atveju jų tikrajai vertei nustatyti naudojama tos reguliuojamos rinkos, kurios prekybai šiomis priemonėmis būdingas didesnis likvidumas, reguliarumas ir dažnumas, duomenys;
2. jei neįmanoma pagrįstai pasirinkti rinkos, kurios duomenimis remiantis turi būti nustatoma priemonės tikroji vertė; tuo atveju jai nustatyti naudojama reguliuojamos rinkos, kurioje yra priemonės emitento buveinė, duomenys;
3. per paskutinę prekybos sesiją priemonė nebuvo kotiruojama; tuo atveju tikrajai vertei nustatyti naudojama paskutinė žinoma, tačiau ne daugiau kaip prieš 30 (trisdešimt) kalendorinių dienų buvusi vidutinė rinkos kaina arba uždarymo kaina, jei nuo paskutinės prekybos dienos neįvyko įvykių, dėl kurių dabartinė rinkos kaina yra reikšmingai mažesnė ar didesnė už paskutinę žinomą kainą;
4. priemonė nebuvo kotiruojama daugiau kaip 30 (trisdešimt) kalendorinių dienų iki vertinimo dienos arba buvo kotiruojama rečiau, nei nustatyta skaičiavimo procedūrose; tuo atveju jos vertė nustatoma kaip priemonių, kuriomis reguliuojamose rinkose neprekiuojama, vertė;
5. yra gaunamas tikslesnis priemonių vertinimas, vertinant taip:
 - 5.1. naudojantis *Bloomberg*, *Reuters* ar kitų tarptautinių naujienų agentūrų, informacijos šaltinių teikiamais pelningumo duomenimis ir/arba kainomis;
 - 5.2. pagal tikėtiną pardavimo kainą, nustatytą pagal parinktą vertinimo modelį, kuris finansų rinkoje yra visuotinai taikomas ir pripažintas;
6. yra gaunamas tikslesnis skolos VP vertinimas, vertinant taip:
 - 6.1. naudojantis *Bloomberg*, *Reuters* ar kitų tarptautinių naujienų agentūrų, informacijos šaltinių teikiamais pelningumo duomenimis ir/arba kainomis;
 - 6.2. Lietuvos Respublikos VP pelningumas nustatomas pagal pirminių dilerių AB SEB banko, AB „DnB NORD“ banko ir AB „Swedbank“ skelbiamas konkrečios emisijos tos dienos geriausios pirkimo (mažiausias BID) ir pardavimo (didžiausias ASK) pelningumų vidurkis;
 - 6.3. atsižvelgiant į analogiškos trukmės, reitingo ir panašių išleidimo sąlygų VP vertę;

6.4. pagal tikėtiną pardavimo kainą, nustatytą pagal parinktą vertinimo modelį, kuris finansų rinkoje yra visuotinai taikomas ir pripažintas.

Priemonių, kuriomis daugiašalėse sistemose neprekiuojama, tikroji vertė nustatoma:

1. skolos VP vertinami pagal VPK patvirtintą GA vertės skaičiavimo metodiką;
2. 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 GA skaičiavimo procedūrose), kuris finansų rinkoje yra visuotinai taikomas ir pripažintas;
3. KIS vienetai (akcijos) vertinami pagal paskutinę viešai paskelbtą išpirkimo kainą;
4. terminuoti indėliai bankuose vertinami pagal amortizuotos savikainos vertę;
5. grynieji pinigai ir lėšos kredito įstaigose vertinami pagal nominaliąją vertę;
6. yra gaunamas tikslesnis priemonių vertinimas, vertinant taip:
 - 6.1. naudojantis *Bloomberg*, *Reuters* ar kitų tarptautinių naujienų agentūrų, informacijos šaltinių teikiamais pelningumo duomenimis ir/arba kainomis;
 - 6.2. pagal tikėtiną pardavimo kainą, nustatytą pagal parinktą vertinimo modelį, kuris finansų rinkoje yra visuotinai taikomas ir pripažintas;
7. yra gaunamas tikslesnis skolos VP ir pinigų rinkos priemonių vertinimas, vertinant taip:
 - 7.1. naudojantis *Bloomberg*, *Reuters* ar kitų tarptautinių naujienų agentūrų, informacijos šaltinių teikiamais pelningumo duomenimis ir/arba kainomis;
 - 7.2. Lietuvos Respublikos VP pelningumas nustatomas pagal pirminių dilerių AB SEB banko, AB „DnB NORD“ banko ir AB „Swedbank“ skelbiamas konkrečios emisijos tos dienos geriausios pirkimo (mažiausias BID) ir pardavimo (didžiausias ASK) pelningumų vidurkį;
 - 7.3. atsižvelgiant į analogiškos trukmės, reitingo ir panašių išleidimo sąlygų VP vertę;
 - 7.4. pagal tikėtiną pardavimo kainą, nustatytą pagal parinktą vertinimo modelį, kuris finansų rinkoje yra visuotinai taikomas ir pripažintas.

Kitais atvejais vertinama pagal bendrovės patvirtintose GA skaičiavimo procedūrose sąžiningai nustatytą vertinimo modelį, kuris finansų rinkoje yra visuotinai taikomas ir pripažintas ir kuris padeda užtikrinti kuo objektyvesnę vertinamų priemonių vertę.

Fondo fondo apskaitos vienetai išreiškia dalyviui priklausančią turto dalį fonde.

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

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

Apskaitos vieneto (jo dalių) vertė išreiškia 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.

Jei dėl GA vertės skaičiavimo klaidos vieneto vertė buvo apskaičiuota mažesnė arba didesnė, o skirtumas tarp klaidingai apskaičiuotos vieneto vertės ir tikrosios vertės sudaro ne mažiau kaip 0,1 (viena dešimtoji) procento tikrosios vieneto vertės, – skirtumas turi būti atlygintas iš bendrovės nuosavų lėšų. Kai skirtumas mažesnis nei 0,1 (viena dešimtoji) procento – jis gali būti neatlyginamas. Apie pasitraukusių dalyvių galimybę atsiimti priskaičiuoto skirtumo sumą bendrovė privalo informuoti kiekvieną teisę ją gauti turintį asmenį per 30 (trisdešimt) dienų nuo bendros sumos apskaičiavimo datos.

c) Aktualūs fondo atskaitymai Bendrovei

Fondas *SEB pensija 1* per ataskaitinį laikotarpį taikė tris mokesčius:

1. įmokos mokestį – 2 proc., kuris yra vienkartinis ir išskaičiuojamas iš kiekvienos gautos įmokos iš „Sodros“.
Įmokos mokestis neskaičiuojamas nuo gautų įmokų iš kitų pensijų fondų ar kitų pensijų kaupimo bendrovių;
2. turto valdymo mokestį – 1 proc. nuo pensijų sąskaitoje esančių lėšų vidutinės metinės vertės. Turto valdymo mokestis išskaičiuojamas kiekvieną darbo dieną;
3. bendrovės keitimo mokestį – iki 0,2 proc. iš pervedamų į kitą bendrovę dalyvio lėšų išskaičiuojamos išlaidos, susijusios su dalyvio sąskaitos uždarymu ir lėšų pervedimu.

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) 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 nustatomos įsigijimo savikaina. Įsipareigojimai kredito įstaigoms pradinio pripažinimo metu nustatomi įsigijimo savikaina, o vėliau - amortizuota savikaina.

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**GRYNUJŲ AKTYVŲ, APSKAITOS VIENETŲ SKAIČIUS IR VERTĖ**

	Ataskaitinio laikotarpio pradžioje (2011 01 03)	Ataskaitinio laikotarpio pabaigoje (2011 06 30)	Prieš metus (2010 06 30)	Prieš dvejus metus (2009 06 30)
Grynųjų aktyvų vertė (Lt)	204 576 344	208 780 076	203 067 887	181 287 559
Investicinio vieneto (akcijos) vertė (Lt)	1,1862	1,1908	1,1910	1,1132
Investicinių vienetų (akcijų), esančių apyvartoje, skaičius	172 458 113	175 322 571	170 508 289	162 851 223

2 PASTABA**KONVERTUOTŲ APSKAITOS VIENETŲ SKAIČIUS BEI BENDROS KONVERTAVIMO SUMOS**

2011 01 03 – 2011 06 30

	Investicinių vienetų (akcijų) skaičius	Vertė (Lt)
Išplatinta (konvertuojant pinigines lėšas į investicinius vienetus)	8 705 235	10 463 500
Išpirkta (konvertuojant investicinius vienetus į pinigines lėšas)	5 869 152	6 922 169

2010 01 04 – 2010 06 30

	Investicinių vienetų (akcijų) skaičius	Vertė (Lt)
Išplatinta (konvertuojant pinigines lėšas į investicinius vienetus)	8 003 346	9 659 262
Išpirkta (konvertuojant investicinius vienetus į pinigines lėšas)	6 380 386	7 537 468

3 PASTABA**INVESTICIJŲ VERTĖS POKYTIS**

2011 01 03 – 2011 06 30

Investicijos	Pokytis					
	praėjusio ataskaitinio laikotarpio pabaigoje	įsigyta	parduota (išpirkta)	vertės padidėjimas	vertės sumažėjimas	ataskaitinio laikotarpio pabaigoje
Vyriausybių ir centrinių bankų arba jų garantuoti ne nuosavybės vertybiniai popieriai	202 357 318	29 626 325	-25 703 047	18 328 195	-17 090 414	207 518 377
Iš viso:	202 357 318	29 626 325	-25 703 047	18 328 195	-17 090 414	207 518 377

4 PASTABA

INVESTICINIŲ PRIEMONIŲ PORTFELIO SUDĖTIS

2011 06 30

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

Emitento pavadinimas	Šalis	ISIN kodas	Kiekis (vnt.)	Bendra nominalioji vertė	Bendra įsigijimo vertė	Bendra rinkos vertė	Palūkanų norma	Išpirkimo / konvertavimo data	Dalis GA (%)
Ne nuosavybės vertybiniai popieriai, įtraukti į Oficialųjį ar jį atitinkantį prekybos sąrašą									
Iš viso:									
Ne nuosavybės vertybiniai popieriai, įtraukti į Papildomąjį ar jį atitinkantį prekybos sąrašą									
Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT1000600213	3 627	1 252 331	1 176 982	1 252 247	1,23	2011 07 07	0,60
Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT0000603227	110 816	11 081 600	11 950 050	12 377 660	2,50	2012 10 29	5,93
Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT0000605107	51 768	5 176 800	5 286 728	5 320 617	4,35	2015 04 29	2,55
Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT0000603235	17 033	1 703 300	1 770 806	1 811 526	3,23	2013 08 05	0,87
Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT1000600288	3 333	1 150 818	1 113 648	1 131 650	2,10	2012 04 25	0,54
Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT1000600296	39 204	13 536 357	13 081 448	13 221 554	2,25	2012 07 25	6,33
Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT0000600025	29 000	2 900 000	2 841 354	2 868 061	1,90	2012 02 01	1,37

Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT1000600304	21 277	7 346 523	7 092 303	7 115 506	2,48	2012 10 24	3,41
Iš viso:			276 058	44 147 728	44 313 319	45 098 820			21,60
Ne nuosavybės vertybiniai popieriai, kuriais prekiaujama kitose reguliuojamose rinkose									
Slovakijos Respublika	SK	XS0192595873	4 000	13 811 200	13 740 763	14 578 215	2,67	2014 05 20	6,98
Lenkijos Respublika	PL	XS0144238002	630	2 175 264	2 507 318	2 272 132	1,46	2012 03 12	1,09
Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	XS0147459803	918	3 169 670	3 340 299	3 304 188	1,85	2012 05 10	1,58
Čekijos Respublika	CZ	XS0194957527	388	1 339 686	1 480 451	1 413 927	2,71	2014 06 23	0,68
Prancūzijos Respublika	FR	FR0010192997	2 170	7 492 576	6 820 952	7 759 346	3,40	2021 04 25	3,72
Nyderlandų Karalystė	NL	NL0000102283	2 795	9 650 576	9 875 474	10 665 663	2,58	2016 07 15	5,11
Nyderlandų Karalystė	NL	NL0000102242	800	2 762 240	2 504 937	2 949 823	2,30	2015 07 15	1,41
Slovėnijos Respublika	SI	XS0292653994	1 777	6 135 626	5 871 076	6 138 543	4,19	2018 03 22	2,94
Belgijos Karalyste	BE	BE0000298076	1 000	3 452 800	3 766 280	3 715 407	1,87	2012 09 28	1,78
Lenkijos Respublika	PL	XS0371500611	1 200	4 143 360	4 173 151	4 486 659	4,26	2018 06 20	2,15
Vokietijos Federacine Respublika	DE	DE0001135192	4 100	14 156 480	15 319 462	14 772 025	1,25	2012 01 04	7,08
Belgijos Karalyste	BE	BE0000309188	2 350	8 114 080	8 187 350	8 377 542	3,57	2017 03 28	4,01
Prancūzijos Respublika	FR	FR0000188328	1 000	3 452 800	3 751 674	3 585 040	1,40	2012 04 25	1,72
Vokietijos Federacine Respublika	DE	DE0001135374	3 900	13 465 920	14 131 906	14 635 147	2,73	2019 01 04	7,01
Prancūzijos Respublika	FR	FR0010061242	5 558	19 190 662	20 342 940	20 397 555	1,96	2014 04 25	9,77
Belgijos Karalyste	BE	BE0000301102	650	2 244 320	2 387 867	2 406 366	2,40	2013 09 28	1,15
Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	XS0435153068	2 480	8 562 944	9 551 943	9 989 102	3,48	2014 06 22	4,78
Austrijos Respublika	AT	AT0000385992	2 490	8 597 472	9 054 523	9 203 080	1,84	2013 10 20	4,41
Austrijos Respublika	AT	AT0000385356	2 375	8 200 400	8 900 585	8 885 381	1,55	2012 07 15	4,26
Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	XS0485991417	565	1 356 735	1 333 304	1 608 531	5,11	2020 02 11	0,77
Vokietijos Federacine Respublika	DE	DE0001135283	1 250	4 316 000	4 514 148	4 648 586	2,08	2015 07 04	2,23
Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	XS0541528682	2 323	5 578 220	5 538 113	5 832 821	4,57	2017 09 14	2,79
Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	XS0602546136	305	732 397	719 008	794 479	5,26	2021 09 03	0,38
Iš viso:			45 024	152 101 428	157 813 524	162 419 557			77,79
Išleidžiami nauji ne nuosavybės vertybiniai popieriai									
Iš viso:									
Iš viso ne nuosavybės vertybinių popierių:				196 249 156	202 126 843	207 518 377			99,39
KIS pavadinimas	Šalis	ISIN kodas	Kiekis (vnt.)	Valdytojas	Bendra įsigijimo vertė	Bendra rinkos vertė	Rinkos vertės nustatymo šaltinis (tinklalapio adresas)	KIS tipas*	Dalis GA (%)
Kolektyvinio investavimo subjektų įstatymo 61 str. 1 d. reikalavimus atitinkančių kolektyvinio investavimo subjektų (KIS) vienetai (akcijos)									
Iš viso:									

Kitų kolektyvinio investavimo subjektų vienetai (akcijos)									
Iš viso:									
Iš viso KIS vienetų (akcijų):									

* – nurodyti KIS tipą:

KIS 1 – KIS, kurių investavimo strategijoje numatyta iki 100 proc. grynujų aktyvų investuoti į ne nuosavybės vertybinių popierius;
KIS 2 – KIS, kurių investavimo strategijoje numatytas mišrus (subalansuotas) investavimas;
KIS 3 – KIS, kurių investavimo strategijoje numatyta iki 100 proc. grynujų aktyvų investuoti į nuosavybės vertybinius popierius;
KIS 4 – KIS, kurių investavimo strategijoje numatyta iki 100 proc. grynujų aktyvų investuoti į pinigų rinkos priemones;
KIS 5 – visų kitų rūšių KIS (alternatyvaus investavimo, privataus kapitalo, nekilnojamojo turto, žaliavų ir kt.).
Pastaba. Investuojant į fondų fondus, juos priskirti tam tikrai KIS grupei pagal fondų fondų investavimo strategiją.

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

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

Priemonės pavadinimas	Emitentas	Šalis	Kita sandorio šalis	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	DE0001135192, FR0000188328, FR0010061242, XS0192595873, AT0000385356, AT0000385992	-67 588 595	-106 847	E. pašto pranešimas	2011 09 08	-0,05

CME USD/EUR CURR FUTURE	Chicago Mercantile Exchange	US	Chicago Mercantile Exchange	USD	XS0541528682, XS0485991417, XS0602546136	8 185 071	22 542	IS Bloomberg (t-1) dienos 10 val.	2011 09 19	0,01	
EURO BOBL FUTURE	EUREX	CH	EUREX	EUR	FR0010061242	14 893 515	35 771	E. pašto pranešimas	2011 09 08	0,02	
EURO BUND FUTURE	EUREX	CH	EUREX	EUR	DE0001135374, FR0010192997	14 730 750	32 871	E. pašto pranešimas	2011 09 08	0,02	
Iš viso:							-15 663			-0,01	
Kitos išvestinės finansinės priemonės											
Iš viso:											
Iš viso išvestinės finansinės priemonės								-15 663			-0,01

Banko pavadinimas	Valiuta	Bendra rinkos vertė	Palūkanų norma	Dalis GA (%)
Pinigai				
AB SEB bankas	USD	301 235		0,14
AB SEB bankas	LTL	384 934		0,18
AB SEB bankas	EUR	89 263		0,04
SEB London Futures	EUR	547 974		0,26
SEB London Futures	USD	376 639		0,18
AB SEB bankas	LTL	282 912		0,14
Iš viso pinigai:		1 982 958		0,95

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

Pavadinimas	Trumpas apibūdinimas	Bendra vertė	Paskirtis	Dalis GA (%)
Gautinos sumos		10 844		0,01
Mokėtinos sumos		-716 440		-0,34
Iš viso:		-705 596		-0,34

2010 12 31

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

Emitento pavadinimas	Šalis	ISIN kodas	Kiekis (vnt.)	Bendra nominalioji vertė	Bendra įsigijimo vertė	Bendra rinkos vertė	Palūkanų norma	Išpirkimo / konvertavimo data	Dalis GA (%)
Ne nuosavybės vertybiniai popieriai, įtraukti į Oficialųjį ar jį atitinkantį prekybos sąrašą									
Iš viso:									
Ne nuosavybės vertybiniai popieriai, įtraukti į Papildomąjį ar jį atitinkantį prekybos sąrašą									
Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT1000600213	7 934	2 739 452	2 574 026	2 721 432	1,33	2011 07 07	1,33
Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT0000603227	100 816	10 081 600	10 851 888	11 085 869	2,70	2012 10 29	5,42
Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT0000605107	19 851	1 985 100	2 103 882	2 109 264	4,15	2015 04 29	1,03
Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT0000601999	60 000	6 000 000	5 851 153	5 976 294	1,20	2011 05 04	2,92
Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT0000601981	4 680	468 000	457 976	466 368	1,20	2011 04 20	0,23
Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT0000603235	10 988	1 098 800	1 105 693	1 147 632	3,33	2013 08 05	0,56
Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT1000600288	3 333	1 150 818	1 113 648	1 116 125	2,38	2012 04 25	0,55
Iš viso:			207 602	23 523 770	24 058 265	24 622 983			12,05
Ne nuosavybės vertybiniai popieriai, kuriais prekiaujama kitose reguliuojamose rinkose									
Slovakijos Respublika	SK	XS0192595873	4 000	13 811 200	13 740 763	15 018 273	2,64	2014 05 20	7,35
Lenkijos Respublika	PL	XS0144238002	630	2 175 264	2 507 318	2 360 237	2,03	2012 03 12	1,15

Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	XS0147459803	918	3 169 670	3 427 031	3 441 112	2,27	2012 05 10	1,68
Čekijos Respublika	CZ	XS0194957527	388	1 339 686	1 480 451	1 455 557	2,73	2014 06 23	0,71
Prancūzijos Respublika	FR	FR0010192997	2 170	7 492 576	6 820 952	7 924 063	3,38	2021 04 25	3,88
Nyderlandų Karalystė	NL	NL0000102283	2 795	9 650 576	9 875 474	10 700 737	2,25	2016 07 15	5,24
Prancūzijos Respublika	FR	FR0000571218	600	2 071 680	2 484 794	2 607 695	3,81	2029 04 25	1,28
Nyderlandų Karalystė	NL	NL0000102242	800	2 762 240	2 504 937	2 963 561	1,91	2015 07 15	1,45
Slovėnijos Respublika	SI	XS0292653994	1 777	6 135 626	5 871 076	6 323 169	4,02	2018 03 22	3,09
Belgijos Karalystė	BE	BE0000298076	1 000	3 452 800	3 766 280	3 676 754	1,95	2012 09 28	1,80
Lenkijos Respublika	PL	XS0371500611	1 200	4 143 360	4 173 151	4 664 006	4,12	2018 06 20	2,28
Belgijos Karalystė	BE	BE0000313222	1 900	6 560 320	6 761 984	6 780 793	0,60	2011 03 28	3,32
Vokietijos Federacinė Respublika	DE	DE0001135192	4 100	14 156 480	15 359 004	15 506 258	0,45	2012 01 04	7,59
Belgijos Karalystė	BE	BE0000309188	2 350	8 114 080	8 187 350	8 581 481	3,52	2017 03 28	4,20
Prancūzijos Respublika	FR	FR0000188328	1 000	3 452 800	3 751 674	3 763 661	0,73	2012 04 25	1,84
Vokietijos Federacinė Respublika	DE	DE0001135374	3 900	13 465 920	14 131 906	14 949 093	2,73	2019 01 04	7,31
Prancūzijos Respublika	FR	FR0010061242	5 558	19 190 662	20 342 940	21 228 043	1,55	2014 04 25	10,39
Belgijos Karalystė	BE	BE0000301102	650	2 244 320	2 387 867	2 378 906	2,39	2013 09 28	1,16
Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	XS0435153068	2 480	8 562 944	9 641 515	10 472 560	3,93	2014 06 22	5,12
Austrijos Respublika	AT	AT0000385992	2 490	8 597 472	9 054 523	9 239 759	1,35	2013 10 20	4,52
Austrijos Respublika	AT	AT0000385356	2 375	8 200 400	8 900 585	8 902 318	0,90	2012 07 15	4,36
Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	XS0485991417	1 175	3 066 633	3 013 672	3 494 293	5,80	2020 02 11	1,71
Vokietijos Federacinė Respublika	DE	DE0001135283	1 250	4 316 000	4 514 148	4 661 464	1,76	2015 07 04	2,28
Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	XS0541528682	2 534	6 613 487	6 565 936	6 640 543	5,33	2017 09 14	3,25
Iš viso:			48 040	162 746 196	169 265 330	177 734 335			86,95
Išleidžiami nauji ne nuosavybės vertybiniai popieriai									
Iš viso:									
Iš viso ne nuosavybės vertybinių popierių:				186 269 966	193 323 595	202 357 318			99,00
KIS pavadinimas	Šalis	ISIN kodas	Kiekis (vnt.)	Valdytojas	Bendra įsigijimo vertė	Bendra rinkos vertė	Rinkos vertės nustatymo šaltinis (tinklalapio adresas)	KIS tipas*	Dalis GA (%)
Kolektyvinio investavimo subjektų įstatymo 61 str. 1 d. reikalavimus atitinkančių kolektyvinio investavimo subjektų (KIS) vienetai (akcijos)									
Iš viso:									
Kitų kolektyvinio investavimo subjektų vienetai (akcijos)									
Iš viso:									
Iš viso KIS vienetai (akciju):									

* – 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 fondų investavimo strategiją.

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

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

Priemonės pavadinimas	Emitentas	Šalis	Kita sandorio šalis	Valiuta	Investicinis sandoris (pozicija)	Sandorio (pozicijos) vertė	Bendra rinkos vertė	Rinkos pavadinimas (tinklalapio adresas)	Galiojimo terminas	Dalis GA (%)
Išvestinės finansinės priemonės, kuriomis prekiaujama reguliuojamose rinkose										
EURO-SCHATZ FUTURE	EUREX	CH	EUREX	EUR	DE0001135192, FR0000188328, AT0000385356	20 700 486	- 18 041	e. pašto pranešimas	2011 03 11	-0,01
CME USD/EUR CURR FUTURE	Chicago Mercantile Exchange	US	Chicago Mercantile Exchange	USD	XS0541528682	6 472 715	- 99 829	IS Bloomberg	2011 03 14	-0,05
EURO-BOBL FUTURE	EUREX	CH	EUREX	EUR	FR0010061242	-4 101 236	9 323	e. pašto pranešimas	2011 03 11	0,00

EURO-BUND FUTURE	EUREX	CH	EUREX	EUR	DE0001135374	7 355 396	- 18 196	e. pašto pranešimas IS Bloomberg	2011 03 11	-0,01
EURO BUXL 30Y BND FUTURE	EUREX	CH	EUREX	EUR	FR0010192997	-5 588 357	25 896	e. pašto pranešimas IS Bloomberg	2011 03 11	0,01
Iš viso:							- 100 847			-0,06
Kitos išvestinės finansinės priemonės										
NDF9010	AB SEB bankas	LT	AB SEB bankas	LTL	XS0485991417, XS0541528682	3 653 860	- 219 149	e. pašto pranešimas	2011 01 14	-0,11
Iš viso:							- 219 149			-0,11
Iš viso išvestinės finansinės priemonės										
							- 319 997			-0,16

Banko pavadinimas	Valiuta	Bendra rinkos vertė	Palūkanų norma	Dalis GA (%)
Pinigai				
AB SEB bankas	USD	135	0,20	0,00
AB SEB bankas	LTL	1 315 253	0,51	0,64
AB SEB bankas	EUR	711 989	0,36	0,35
SEB London Futures	EUR	425 926		0,21
SEB London Futures	USD	313 053		0,15
Iš viso pinigai:		2 766 356		1,35

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

Pavadinimas	Trumpas apibūdinimas	Bendra vertė	Paskirtis	Dalis GA (%)
Mokėtinos sumos		- 405 328		-0,20
Gautinos sumos		1 140		0,00
Iš viso:		- 404 188		-0,20

5 PASTABA INVESTICIJŲ PASKIRSTYMAS PAGAL INVESTAVIMO STRATEGIJĄ ATITINKANČIUS KRITERIJUS

Investicijų pasiskirstymas	Rinkos vertė ataskaitinio laikotarpio pabaigoje (2011 06 30)	Dalis aktyvuose (%)	Rinkos vertė ataskaitinio laikotarpio pradžioje (2010 12 31)	Dalis aktyvuose ataskaitinio laikotarpio pradžioje (%)
Pagal investavimo objektus				
Vyriausybinių obligacijų	207 518 377	99,40	202 357 318	99,00
Pinigų rinkos priemonės	1 277 362	0,61	2 362 168	1,16
Išvestinės priemonės	- 15 663	-0,01	- 319 997	-0,16
Iš viso:	208 780 076	100,00	204 399 490	100,00
Pagal regionus				
Vakarų Europos obligacijos	112 000 960	53,65	123 864 586	60,60
Vidurio ir Rytų Europos obligacijos	95 517 417	45,75	78 492 732	38,40
Iš viso:	207 518 377	99,40	202 357 318	99,00

6 PASTABA IŠVESTINIŲ FINANSINIŲ PRIEMONIŲ SANDORIAI, IŠSKYRUS TUOS, KURIE NURODYTI 4 PASTABOJE

2011 01 03 – 2011 06 30

Priemonės pavadinimas	Priemonės rūšis	Pelnas/nuostolis valiuta	Valiutos kodas	Priemonės panaudojimo tikslas	Pastabos
CME USD/EUR CURR FUTURE	Ateities sandoris (angl. future)	134 950	USD	Valiutų kursų svyravimo rizikos valdymas	Reguliuojamų rinkų IP
CME USD/EUR CURR FUTURE	Ateities sandoris (angl. future)	111 863	USD	Valiutų kursų svyravimo rizikos valdymas	Reguliuojamų rinkų IP
EURO BUXL FUTURE	Ateities sandoris (angl. future)	30 520	EUR	Palūkanų normų rizikos valdymas	Reguliuojamų rinkų IP
EURO BOBL FUTURE	Ateities sandoris (angl. future)	-26 270	EUR	Palūkanų normų rizikos valdymas	Reguliuojamų rinkų IP
EURO BOBL FUTURE	Ateities sandoris (angl. future)	46 480	EUR	Palūkanų normų rizikos valdymas	Reguliuojamų rinkų IP
EURO BUND FUTURE	Ateities sandoris (angl. future)	-86 270	EUR	Palūkanų normų rizikos valdymas	Reguliuojamų rinkų IP
EURO BUND FUTURE	Ateities sandoris (angl. future)	98 200	EUR	Palūkanų normų rizikos valdymas	Reguliuojamų rinkų IP
EURO SCHATZ FUTURE	Ateities sandoris (angl. future)	2 685	EUR	Palūkanų normų rizikos valdymas	Reguliuojamų rinkų IP
EURO SCHATZ FUTURE	Ateities sandoris (angl. future)	-62 430	EUR	Palūkanų normų rizikos valdymas	Reguliuojamų rinkų IP
Išankstiniai valiutos keitimo sandoriai	Išankstinis sandoris (angl. forward)	-53 256	EUR	Valiutų kursų svyravimo rizikos valdymas	Kitų rinkų investicinė priemonė

2010 01 04 – 2010 06 30

Priemonės pavadinimas	Priemonės rūšis	Pelnas/nuostolis valiuta	Valiutos kodas	Priemonės panaudojimo tikslas	Pastabos
EUREX BUND FUTURE	Ateities sandoris (angl. future)	51 920	EUR	Obligacijų rizikos valdymas	Reguliuojamų rinkų IP
EURO BOBL FUTURE	Ateities sandoris (angl. future)	- 78 770	EUR	Obligacijų rizikos valdymas	Reguliuojamų rinkų IP
EURO SCHATZ FUTURE	Ateities sandoris (angl. future)	138 455	EUR	Obligacijų rizikos valdymas	Reguliuojamų rinkų IP
EURO BUXL FUTURE	Ateities sandoris (angl. future)	- 232 020	EUR	Obligacijų rizikos valdymas	Reguliuojamų rinkų IP
Išankstiniai valiutos keitimo sandoriai	Išankstinis sandoris (angl. forward)	- 40 299	LTL	Valiutų kursų svyravimo rizikos valdymas	Kitų rinkų investicinė priemonė

7 PASTABA IŠ IŠVESTINIŲ FINANSINIŲ PRIEMONIŲ SANDORIŲ KYLANČIŲ ĮSIPAREIGOJIMŲ BENDRA VERTĖ

2011 06 30

Priemonės rūšis	Išpirkimo data	Įsipareigojimų vertė valiuta ataskaitinio laikotarpio pabaigoje	Valiutos kodas	Pastabos
Ateities sandoris (angl. future)	2011 09 08	30 945	EUR	Reguliuojamų rinkų investicinė priemonė

2010 12 31

Priemonės rūšis	Išpirkimo data	Įsipareigojimų vertė valiuta ataskaitinio laikotarpio pabaigoje	Valiutos kodas	Pastabos
Ateities sandoris (angl. future)	2011 03 11	5 225	EUR	Reguliuojamų rinkų investicinė priemonė
Ateities sandoris (angl. future)	2011 03 11	5 270	EUR	Reguliuojamų rinkų investicinė priemonė
Ateities sandoris (angl. future)	2011 03 14	38 250	USD	Reguliuojamų rinkų investicinė priemonė
Išankstinis sandoris (angl. forward)	2011 01 14	219 149	LTL	Kitų rinkų investicinė priemonė

8 PASTABA MOKĖJIMAS TARPININKAMS

2011 01 03 – 2011 06 30

Tarpininko pavadinimas	Sumokėti mokesčiai Lt	Paslaugos pavadinimas	Ar susijęs su valdymo įmone
<i>Skandinaviska Enskilda Banken AB</i>	7 384	Komisinis mokestis už sandorius	Ne
AB SEB bankas	2 179	Komisinis mokestis už sandorius	Taip
Iš viso:*	9 562		

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

2010 01 04 – 2010 06 30

Tarpininko pavadinimas	Sumokėti mokesčiai (Lt)	Paslaugos pavadinimas	Ar susijęs su valdymo įmone
<i>Skandinaviska Enskilda Banken AB</i>	3 128	Komisinis mokestis už sandorius	Ne
AB SEB bankas	1 372	Komisinis mokestis už sandorius	Taip
Iš viso:*	4 500		

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

9 PASTABA

PENSIJŲ FONDO REIKMĖMS PASISKOLINTOS LĖŠOS

2011 06 30

Eil. Nr.	Paskolos suma	Paskolos valiuta	Paskolos paėmimo data	Paskolos gražinimo terminas	Palūkanų dydis	Skolinimosi tikslas	Kreditorius	Skolintų lėšų dalis, lyginant su fondo GA (%)
-	-	-	-	-	-	-	-	-
Iš viso:	-	-	-	-	-	-	-	-

2010 12 31

Eil. Nr.	Paskolos suma	Paskolos valiuta	Paskolos paėmimo data	Paskolos gražinimo terminas	Palūkanų dydis	Skolinimosi tikslas	Kreditorius	Skolintų lėšų dalis, lyginant su fondo GA (%)
-	-	-	-	-	-	-	-	-
Iš viso:	-	-	-	-	-	-	-	-

VII. INFORMACIJA APIE PENSIJŲ FONDO DALYVIUS

-

VIII. IŠORINIAI PINIGŲ SRAUTAI

28. Per ataskaitinį laikotarpį faktiškai gautos lėšos:

Bendra gautų lėšų suma		10 402 238
Periodinės įmokos į pensijų fondą	iš Valstybinio socialinio draudimo fondo	8 951 238
	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	1 040 620
	iš kitos pensijų kaupimo bendrovės	410 370
Kitos gautos lėšos (nurodyti šaltinį ir gautų lėšų sumą), iš viso		10

29. Išmokėtos lėšos:

Bendra išmokėtų lėšų suma		6 860 907
Pensijų išmokos	vienkartinės išmokos dalyviams	2 101 186

	periodinės išmokos dalyviams	-
	išmokos anuiteto įsigijimui	-
Į kitus pensijų fondus pervestos lėšos	valdomus tos pačios pensijų kaupimo bendrovės	960 769
	valdomus kitos pensijų kaupimo bendrovės	3 282 920
Išstojusiems dalyviams išmokėtos lėšos (pildoma tik papildomo savanoriško kaupimo pensijų fondų atveju)		-
Paveldėtojams išmokėtos lėšos		516 032
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:

(Žr. 23.3. punktas, 9 PASTABA)

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.



Vieneto vertė litais nuo fondo veiklos pradžios

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 _____ 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;

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.