

2011 metų sausio – birželio mėnesių ataskaita

SEB pensija 1 plus

2011 m. birželio 30 d.



TURINYS

I. BENDROJI INFORMACIJA	3
II. GRYNŲJŲ AKTYVŲ, APSKAITOS VIENETŲ SKAIČIUS IR VERTĖ	3
III. ATSKAITYMAI IŠ PENSIJŲ TURTO	3
V. PENSIJŲ FONDO LYGINAMASIS INDEKSAS, INVESTICIJŲ GRAŽA IR RIZIKOS RODIKLIAI.....	5
VI. PENSIJŲ FONDO FINANSINĖ BŪKLĖ.....	6
VII. INFORMACIJA APIE PENSIJŲ FONDO DALYVIUS.....	24
VIII. IŠORINIAI PINIGŲ SRAUTAI.....	24
IX. INFORMACIJA APIE GARANTIJŲ REZERVĄ.....	25
X. INFORMACIJA APIE PENSIJŲ FONDO REIKMĖMS PASISKOLINTAS LĖŠAS	25
XI. KITA INFORMACIJA.....	25
XII. ATSAKINGI ASMENYS	26

PENSIJŲ FONDO SEB PENSIJA 1 PLUS
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.

Papildomo savanoriško pensijų kaupimo pensijų fondas *SEB pensija 1 plus*, taisyklių Nr. PF-S01-K001-017(002).

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

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) — Ignas Pliušksys portfelijų valdytojas.

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

AB SEB bankas

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

faks. (8 5) 268 1255

įmonės kodas 112021238.

II. GRYNŲJŲ AKTYVŲ, APSKAITOS VIENETŲ SKAIČIUS IR VERTĖ

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

(Žr. 23.3. punktą, 1 PASTABA)

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

(Žr. 23.3. punktą, 2 PASTABA)

III. ATSKAITYMAI IŠ PENSIJŲ TURTO

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

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)	% nuo ataskaitinio laikotarpio vidutinės grynujų aktyvų vertės
	maksimalus, nustatytas sudarymo dokumentuose	ataskaitiniu laikotarpiu taikytas		
Už valdymą:				
<i>nekintamas dydis</i>	1,00 proc.	1,00 proc.	66 630	0,50%
<i>sėkmės mokesčiai</i>	-	-	-	-
depozitoriumui	0,30 proc.	0,10 proc.	6 693	0,05%
Už sandorių sudarymą			427	0,00%
Už auditą			5 102	0,04%
Kitos veiklos išlaidos (nurodyti išlaidų rūšis)	-	-	-	-
Išlaidų, įskaičiuojamų į BIK, suma*			-	

Atskaitymai	Atskaitymų dydis		Per ataskaitinį laikotarpį priskaičiuotų atskaitymų suma (Lt)	% nuo ataskaitinio laikotarpio vidutinės gryųjų aktyvų vertės
	maksimalus, nustatytas sudarymo dokumentuose	ataskaitiniu laikotarpiu taikytas		
BIK % nuo GAV *			-	
Visų išlaidų suma			78 852	0,59%
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 gryųjų 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.

Ataskaitiniu laikotarpiu fondas sudarė išankstinio valiutos keitimo (*currency forwards*), valiutos ateities (*currency futures*) ir obligacijų ateities (*schatz, bobl ir bund futures*) sandorius.

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 įvertinta rizika ir emitento įvertinta rizika sumuojamos kiekvieno konkretaus asmens (sandorio šalies ir emitento) atžvilgiu ir ta suma negali būti didesnė kaip 20 proc. grynąjų aktyvų vertės. Apskaičiuojant fondui nustatytus investavimo į vieną emitentą apribojimus, yra atsižvelgiama ir į turimas išvestinių finansinių priemonių pozicijas.

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

Per ataskaitinį laikotarpį valiutos ateities sandoriai sudaryti norint apsidrausti nuo valiutos kurso rizikos. Valiutos ateities sandorių rizika priklauso nuo lito ir JAV dolerio valiutos kurso pokyčių. Taikant tokius sandorius draudimo tikslais, portfeliui ar jo daliai nedaro įtakos valiutos kurso pokyčiai ir fondo vieneto vertės svyravimai dėl valiutos kitimo yra sumažinami arba jų visiškai nelieka. Tam tikro fondo sudėtyje esančios investicinės priemonės yra JAV doleriais, todėl sudarius ateities sandorius JAV dolerio kurso svyravimai beveik nedarė įtakos fondo vertei.

Obligacijų ateities sandorių (*schatz, bobl ir bund futures*) 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 finansinę trukmę ir minėtų ateities sandorių finansinę trukmę.

Siekiamą fondo finansinę trukmę nustato fondo valdytojas. Šis sprendimas yra priimamas atsižvelgus 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.

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 – buvo investuojama į vyriausybę ir įmonių skolos vertybinius popierius, taip pat į šias priemones investuojančius fondus.

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:

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 vyriausybę. Dėl šios priežasties šių obligacijų kaina kilo. Tuo tarpu Pietų Europos šalių vyriausybų obligacijos krito. Kadangi daugiausia fondo lėšų investuojama 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 ir tapo daug stabilesnė, todėl Lietuvos Respublikos Vyriausybės obligacijų kainos kilo, o pajamingumas mažėjo.
3. Įmonių obligacijų brangimas. 2011 metų pirmąjį pusmetį, įmonių obligacijos toliau brango, nes įmonių finansinė padėtis gerėjo.

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;

GRYŪŲ 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		13 247 681	13 899 439
I.	PINIGAI	4	88 814	520 854
II.	TERMINUOTIEJI INDĖLIAI		-	-
III.	PINIGŲ RINKOS PRIEMONĖS		-	-
III.1.	Valstybės išdo vekseliai		-	-
III.2.	Kitos pinigų rinkos priemonės		-	-
IV.	PERLEIDŽIAMIEJI VERTYBINIAI POPIERIAI	3,4	13 154 112	13 378 469
IV.1.	Ne nuosavybės vertybiniai popieriai		11 770 962	12 019 742
IV.1.1.	Vyriausybių ir centrinių bankų arba jų garantuoti ne nuosavybės vertybiniai popieriai		10 389 949	10 669 765
IV.1.2.	Kiti ne nuosavybės vertybiniai popieriai		1 381 013	1 349 977
IV.2.	Nuosavybės vertybiniai popieriai		-	-
IV.3.	Kitų kolektyvinio investavimo subjektų investiciniai vienetai ir akcijos		1 383 150	1 358 727
V.	GAUTINOS SUMOS	4	48	116
V.1.	Investicijų pardavimo sandorių gautinos sumos		-	-
V.2.	Kitos gautinos sumos		48	116
VI.	INVESTICINIS IR KITAS TURTAS	4	4 707	-
VI.1.	Investicinis turtas		-	-
VI.2.	Išvestinės finansinės priemonės		4 707	-
VI.3.	Kitas turtas		-	-
B.	ĮSIPAREIGOJIMAI	4	33 375	73 525
I.	Finansinio ir investicinio turto pirkimo įsipareigojimai		-	-
II.	Įsipareigojimai kredito įstaigoms		-	-
III.	Įsipareigojimai pagal išvestinių finansinių priemonių sutartis		5 524	20 744
IV.	Valdymo įmonei ir depozitoriumui mokėtinos sumos		15 860	32 855
V.	Kitos mokėtinos sumos ir įsipareigojimai		11 991	19 926
C.	GRYŪŲ AKTYVAI		13 214 306	13 825 914

8 – 24 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		13 825 914	12 817 166
II.	GRYNUJŲ AKTYVŲ VERTĖS PADIDĖJIMAS		836 299	2 257 668
II.1.	Dalyvių įmokos į fondą		299 601	331 797
II.2.	Iš kitų fondų gautos sumos		135 256	1 109 698
II.3.	Garantinės įmokos		-	-
II.4.	Palūkanų pajamos		196 514	198 067
II.5.	Dividendai		28 669	11 294
II.6.	Pelnas dėl investicijų vertės pasikeitimo ir pardavimo		143 530	583 993
II.7.	Pelnas dėl užsienio valiutos kursų pokyčio		9 736	3 477
II.8.	Išvestinių finansinių priemonių pelnas		19 926	16 298
II.9.	Kitas grynujų aktyvų vertės padidėjimas		3 067	3 044
	PADIDĖJO IŠ VISO:		836 299	2 257 668
III.	GRYNUJŲ AKTYVŲ VERTĖS SUMAŽĖJIMAS		1 447 907	1 580 591
III.1.	Išmokos fondo dalyviams		1 072 752	1 085 188
III.2.	Išmokos kitiems fondams		46 107	267 287
III.3.	Nuostoliai dėl investicijų vertės pasikeitimo ir pardavimo		233 168	108 799
III.4.	Nuostoliai dėl užsienio valiutos kursų pokyčio		11 035	3 015
III.5.	Išvestinių finansinių priemonių sandorių nuostoliai		-	26 417
III.6.	Valdymo sąnaudos:		84 845	89 885
III.6.1.	Atlyginimas valdymo įmonei		72 623	71 613
III.6.2.	Atlyginimas depozitoriumui		6 693	13 047
III.6.3.	Atlyginimas tarpininkams	8	427	196
III.6.4.	Audito sąnaudos		5 102	5 021
III.6.5.	Kitos sąnaudos		-	8
III.7.	Kitas grynujų aktyvų vertės sumažėjimas		-	-
III.8.	Sąnaudų kompensavimas (-)		-	-
III.9.	Pelno paskirstymas		-	-
	SUMAŽĖJO IŠ VISO:		1 447 907	1 580 591
IV.	GRYNUJŲ AKTYVŲ VERTĖ ATASKAITINIO LAIKOTARPIO PABAIGOJE		13 214 306	13 494 243

8 – 24 puslapiuose pateiktas aiškinamasis raštas yra neatskiriama šių finansinių ataskaitų dalis.

AIŠKINAMASIS RAŠTAS

Bendroji informacija

Papildomo savanoriško pensijų kaupimo fondo *Pensija 1 plus* taisyklės Nr. PF-S01-K001-017(001) patvirtino Lietuvos Respublikos vertybinių popierių komisija 2004 m. spalio 21 d. (paskutiniai pakeitimai įsigaliojo – 2010 m. gegužės 15 d.). 2006 m. vasario 9 d pensijų fondo pavadinimas pakeistas į *SEB pensija 1 plus*.

Pensijų fondą *SEB pensija 1 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 1 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, 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. spalio 27 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).

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

a) 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 grynujų aktyvų ataskaitoje parodomos kaip turtas, jeigu tikroji vertė yra teigiama, arba kaip įsipareigojimas, jeigu tikroji vertė neigiama. Išvestinių finansinių priemonių vertės padidėjusi dalis yra traukiama į 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.

b) Grynujų aktyvų vertės ir vienetų vertės apskaičiavimo principai

Apskaičiuojant fondo grynujų aktyvų vertę, atskirai apskaičiuojama fondo turto vertė ir įsipareigojimų vertė.

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

Turto ir įsipareigojimų tikroji vertė lygi grynujų 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.

Įsipareigojimai skaičiuojami pagal Verslo apskaitos standartų reikalavimus.

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

Apskaičiuojant grynujų aktyvų užsienio valiuta vertę, turto ir įsipareigojimų 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 keliose reguliuojamose rinkose; tuo atveju jų tikrajai vertei nustatyti naudojama tos reguliuojamos rinkos, kurios prekybai šiomis priemonėmis būdingas didesnis likvidumas, reguliarumas ir dažnumas, duomenys;
2. pagal 1 punkte pateiktą kriterijų neįmanoma pagrįstai pasirinkti rinkos, kurios duomenimis remiantis turi būti nustatoma priemonės tikroji vertė; tuo atveju jai nustatyti naudojama reguliuojamos rinkos, kurioje yra priemonės emitento buveinė, duomenys;
3. per paskutinę prekybos sesiją priemonė nebuvo kotiruojama; tuo atveju tikrajai vertei nustatyti naudojama paskutinė žinoma, tačiau ne daugiau kaip prieš 30 (trisdešimt) kalendorinių dienų buvusi vidutinė rinkos kaina arba uždarymo kaina, jei nuo paskutinės prekybos dienos neįvyko įvykių, dėl kurių dabartinė rinkos kaina yra reikšmingai mažesnė ar didesnė už paskutinę žinomą kainą;
4. priemonė nebuvo kotiruojama daugiau kaip 30 (trisdešimt) kalendorinių dienų iki vertinimo dienos arba buvo kotiruojama rečiau, nei nustatyta skaičiavimo procedūrose; tuo atveju jos vertė nustatoma kaip priemonių, kuriomis reguliuojamose rinkose neprekiaujama, 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 ir pinigų rinkos priemonių 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 vidurkį;
 - 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 reguliuojamose daugiašalėse sistemose neprekiaujama, tikroji vertė nustatoma:

1. nuosavybės VP vertinami pagal VPK patvirtintą GA vertės skaičiavimo metodiką;
2. skolos VP ir pinigų rinkos priemonės vertinami pagal VPK patvirtintą GA vertės skaičiavimo metodiką;
3. 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;

4. KIS vienetai (akcijos) vertinami pagal paskutinę viešai paskelbtą išpirkimo kainą;

5. terminuoti indėliai bankuose vertinami pagal amortizuotos savikainos vertę;

6. grynieji pinigai ir lėšos kredito įstaigose vertinami pagal nominaliąją vertę;

7. pinigų rinkos priemonės, kurių išpirkimo terminas arba iki jo likęs laikas ne ilgesnis kaip 397 kalendorinės dienos arba kurių pajamingumas reguliariai tikslinamas pagal pinigų rinkos sąlygas ne rečiau kaip kartą per 397 kalendorines dienas, arba kurių rizika, įskaitant kredito ir palūkanų normos rizikas, yra labai panaši į riziką finansinių priemonių, kurių išpirkimo terminas ir pajamingumas atitinka anksčiau nurodytus požymius, gali būti vertinamos amortizuotos savikainos metodu;

8. yra gaunamas tikslesnis priemonių vertinimas, vertinant taip:

8.1. naudojantis *Bloomberg*, *Reuters* ar kitų tarptautinių naujienų agentūrų, informacijos šaltinių teikiamais pelningumo duomenimis ir/arba kainomis;

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

9. yra gaunamas tikslesnis skolos VP ir pinigų rinkos priemonių vertinimas, vertinant taip:

9.1. naudojantis *Bloomberg*, *Reuters* ar kitų tarptautinių naujienų agentūrų, informacijos šaltinių teikiamais pelningumo duomenimis ir/arba kainomis;

9.2. 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;

9.3. atsižvelgiant į analogiškos trukmės, reitingo ir panašių išleidimo sąlygų VP vertę;

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

Kitais atvejais, jei taip tiksliau įvertinamos priemonės, 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 apskaitos vienetai išreiškia dalyviui priklausančią turto dalį fonde.

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

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

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

Bendra visų fondo apskaitos vienetų vertė visada yra lygi fondo grynujų aktyvų 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 plus* per ataskaitinį laikotarpį taikė du mokesčius:

1. įmokos mokesčių – 2 proc., kuris yra vienkartinis ir išskaičiuojamas iš kiekvienos gautos įmokos.
2. turto valdymo mokesčių – 1 proc. nuo pensijų sąskaitoje esančių lėšų vidutinės metinės vertės. Turto valdymo mokesčiai išskaičiuojamas kiekvieną darbo dieną;

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. Investicijos į nuosavybės vertybinius popierius pinigų ekvivalentams nepriskiriamos.

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**GRYŪŲ 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)
Gryųjų aktyvų vertė (Lt)	13 832 793	13 214 306	13 494 243	12 428 428
Investicinio vieneto (akcijos) vertė (Lt)	1,2319	1,2384	1,2300	1,1259
Investicinių vienetų (akcijų), esančių apyvartoje, skaičius	11 228 851	10 670 782	10 970 515	11 038 733

2 PASTABA KONVERTUOTŲ APSKAITOS VIENETŲ SKAIČIUS BEI BENDROS KONVERTAVIMO SUMOS

2011 01 03 – 2011 06 30

	Apskaitos vienetų skaičius	Vertė (Lt)
Išplatinta (konvertuojant pinigines lėšas į investicinius vienetus)	348 862	434 857
Išpirkta (konvertuojant investicinius vienetus į pinigines lėšas)	911 331	1 118 859

2010 01 04 – 2010 06 30

	Apskaitos vienetų skaičius	Vertė (Lt)
Išplatinta (konvertuojant pinigines lėšas į investicinius vienetus)	1 186 302	1 441 495
Išpirkta (konvertuojant investicinius vienetus į pinigines lėšas)	1 121 129	1 352 475

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
Ne nuosavybės vertybiniai popieriai	12 019 742	1 264 476	-924 119	443 508	-1 032 645	11 770 962
Vyriausybių ir centrinių bankų arba jų garantuoti ne nuosavybės vertybiniai popieriai	10 669 765	1 264 476	-912 207	379 513	-1 011 598	10 389 949
Kiti ne nuosavybės vertybiniai popieriai	1 349 977	-	-11 912	63 995	-21 047	1 381 013
Kitų kolektyvinio investavimo subjektų investiciniai vienetai ir akcijos	1 358 727	-	-	95 913	-71 490	1 383 150
Iš viso:	13 378 469	1 264 476	-924 119	539 421	-1 104 135	13 154 112

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 emite te (%)	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									
Paritate Bank	LV	LV0000800381	2 400	828 672	828 672	808 718	5,71	2011 12 15	6,12
Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT0000603227	6 061	606 100	647 312	676 987	2,50	2012 10 29	5,12
Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT0000605107	3 374	337 400	348 430	346 773	4,35	2015 04 29	2,62

Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT0000603235	755	75 500	77 878	80 297	3,23	2013 08 05	0,61
DnB NORD bankas	LT	LT0000431132	5 500	550 000	548 457	572 296	2,83	2013 10 07	4,33
Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT1000600296	2 433	840 066	812 872	820 530	2,25	2012 07 25	6,21
Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT0000600025	1 900	190 000	186 157	187 907	1,90	2012 02 01	1,42
Iš viso:			22 423	3 427 738	3 449 779	3 493 508			26,44

Ne nuosavybės vertybiniai popieriai, kuriais prekiaujama kitose reguliuojamose rinkose									
Nyderlandų Karalystė	NL	NL0000102283	140	483 392	490 754	534 237	2,58	2016 07 15	4,04
Slovėnijos Respublika	SI	XS0292653994	225	776 880	798 283	777 249	4,19	2018 03 22	5,88
Belgijos Karalyste	BE	BE0000298076	200	690 560	750 438	743 081	1,87	2012 09 28	5,62
Prancūzijos Respublika	FR	FR0010061242	117	403 978	427 441	429 384	1,96	2014 04 25	3,25
Prancūzijos Respublika	FR	FR0000187361	215	742 352	824 308	849 910	2,74	2016 10 25	6,43
Vokietijos Federacine Respublika	DE	DE0001135382	155	535 184	540 295	580 603	2,80	2019 07 04	4,39
Vokietijos Federacine Respublika	DE	DE0001141547	100	345 280	343 043	351 935	1,73	2014 04 11	2,66
Austrijos Respublika	AT	AT0000385992	250	863 200	910 736	924 004	1,84	2013 10 20	6,99
Vokietijos Federacine Respublika	DE	DE0001135200	60	207 168	224 332	224 781	1,45	2012 07 04	1,70
Vokietijos Federacine Respublika	DE	DE0001141513	140	483 392	516 267	515 041	1,49	2012 10 12	3,90
Austrijos Respublika	AT	AT0000385356	200	690 560	746 647	748 243	1,55	2012 07 15	5,66
Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	XS0485991417	35	84 046	82 594	99 644	5,11	2020 02 11	0,75
Belgijos Karalyste	BE	BE0000315243	110	379 808	394 522	388 430	3,82	2019 03 28	2,94
Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	XS0541528682	152	364 998	362 373	381 657	4,57	2017 09 14	2,89
Slovėnijos Respublika	SI	SI0002103065	200	690 560	696 830	677 160	3,56	2015 03 17	5,12
Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	XS0602546136	20	48 026	47 148	52 097	5,26	2021 09 03	0,39
Iš viso:			2 319	7 789 383	8 156 012	8 277 454			62,64
Išleidžiami nauji ne nuosavybės vertybiniai popieriai									
Iš viso:									

Iš viso ne nuosavybės vertybinių popierių:	11 217 121	11 605 790	11 770 962			89,08
--	------------	------------	------------	--	--	-------

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)									
<i>SEB Fund 5 - SEB Corporate Bond Fund EUR</i>	LU	LU0133008952	180 320	<i>SEB Asset Management S.A.</i>	759 616	835 292	E. pašto pranešimas	KIS 1	6,32
<i>HSBC GIF-EUR COR CRD BD-IC</i>	LU	LU0165125831	3 851	<i>HSBC Investment Funds (Luxembourg) S.A.</i>	258 960	276 219	IS Bloomberg	KIS 1	2,09
<i>PICTET FUND-EUR CORP BON</i>	LU	LU0128472205	484	<i>Pictet Funds S.A.</i>	258 960	271 640	IS Bloomberg	KIS 1	2,06
Iš viso:			184 655		1 277 536	1 383 150			10,47
Kitų kolektyvinio investavimo subjektų vienetai (akcijos)									
Iš viso:									
Iš viso KIS vienetų (akcijų):					1 277 536	1 383 150			10,47

* – 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	Chicago Mercantile Exchange	EUR	DE0001141513, AT0000385356, DE0001135200, BE0000298076, AT0000385992	-2 970 927	-4 558	E. pašto pranešimas	2011 09 08	-0,03
CME USD/EUR CURR FUTURE	Chicago Mercantile Exchange	US	Chicago Mercantile Exchange	USD	XS0541528682, XS0485991417	430 793	1 186	IS Bloomberg (t-1) dienos 10 val.	2011 09 19	0,01
EURO BOBL FUTURE	EUREX	CH	Chicago Mercantile Exchange	EUR	FR0000187361	-402 527	-967	E. pašto pranešimas	2011 09 08	-0,01
EURO BUND FUTURE	EUREX	CH	Chicago Mercantile Exchange	EUR	DE0001135382, XS0292653994	1 299 772	3 522	E. pašto pranešimas	2011 09 08	0,03
Iš viso:							-817			-0,01
Kitos išvestinės finansinės priemonės										
Iš viso:										
Iš viso išvestinės finansinės priemonės										
							-817			-0,01

Banko pavadinimas	Valiuta	Bendra rinkos vertė	Palūkanų norma	Dalis GA (%)
Pinigai				
AB SEB bankas	LTL	7 866		0,06
AB SEB bankas	EUR	17 466		0,13
SEB London Futures	EUR	28 803		0,22
AB SEB bankas	USD	14 640		0,11

SEB London Futures	USD	20 039		0,15
Iš viso pinigai:		88 814		0,67

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		48		0,00
Mokėtinos sumos		-27 850		-0,21
Iš viso:		-27 802		-0,21

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									
Paritate Bank	LV	LV0000800381	2 400	828 672	828 672	784 963	9,02	2011 12 15	5,68
Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT0000603227	4 561	456 100	482 588	501 534	2,70	2012 10 29	3,63
Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT0000605107	3 374	337 400	357 625	358 504	4,15	2015 04 29	2,59
Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT0000601999	4 000	400 000	390 110	398 420	1,20	2011 05 04	2,88
Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT0000603235	732	73 200	73 667	76 453	3,33	2013 08 05	0,55
DnB NORD bankas	LT	LT0000431132	5 500	550 000	548 457	565 014	2,79	2013 10 07	4,09
Iš viso:			20 567	2 645 372	2 681 119	2 684 888			19,42

Ne nuosavybės vertybiniai popieriai, kuriais prekiaujama kitose reguliuojamose rinkose									
Nyderlandų Karalystė	NL	NL0000102283	140	483 392	490 754	535 994	2,25	2016 07 15	3,88
Slovėnijos Respublika	SI	XS0292653994	225	776 880	798 283	800 626	4,02	2018 03 22	5,79
Belgijos Karalyste	BE	BE0000298076	200	690 560	750 438	735 351	1,95	2012 09 28	5,32
Prancūzijos Respublika	FR	FR0010061242	117	403 978	427 441	446 866	1,55	2014 04 25	3,23
Prancūzijos Respublika	FR	FR0000187361	300	1 035 840	1 150 197	1 184 341	2,50	2016 10 25	8,57
Vokietijos Federacine Respublika	DE	DE0001135382	155	535 184	540 295	571 897	2,82	2019 07 04	4,14
Vokietijos Federacine Respublika	DE	DE0001141547	100	345 280	343 043	362 068	1,24	2014 04 11	2,62
Austrijos Respublika	AT	AT0000385992	250	863 200	910 736	927 687	1,35	2013 10 20	6,71
Vokietijos Federacine Respublika	DE	DE0001135200	150	517 920	560 830	564 109	0,69	2012 07 04	4,08
Vokietijos Federacine Respublika	DE	DE0001141513	190	656 032	700 649	702 405	0,77	2012 10 12	5,08
Austrijos Respublika	AT	AT0000385356	200	690 560	746 647	749 669	0,90	2012 07 15	5,42
Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	XS0485991417	75	195 743	192 362	223 040	5,80	2020 02 11	1,61
Belgijos Karalyste	BE	BE0000315243	110	379 808	394 522	396 954	3,80	2019 03 28	2,87

Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	XS0541528682	166	433 243	430 128	435 016	5,33	2017 09 14	3,15
Slovėnijos Respublika	SI	SI0002103065	200	690 560	709 629	698 831	3,01	2015 03 17	5,05
Iš viso:			2 578	8 698 180	9 145 954	9 334 854			67,52
Išleidžiami nauji ne nuosavybės vertybiniai popieriai									
Iš viso:									
Iš viso ne nuosavybės vertybinių popierių:				11 343 552	11 827 073	12 019 742			86,94
KIS pavadinimas	Šalis	ISIN kodas	Kiekis (vnt.)	Valdytojas	Bendra įsigijimo vertė	Bendra rinkos vertė	Rinkos vertės nustatymo šaltinis (tinklalapis adresas)	KIS tipas*	Dalis GA (%)
Kolektyvinio investavimo subjektų įstatymo 61 str. 1 d. reikalavimus atitinkančių kolektyvinio investavimo subjektų (KIS) vienetai (akcijos)									
SEB Fund 5 - SEB Corporate Bond Fund EUR	LU	LU0133008952	180 320	SEB Asset Management S.A.	759 616	822 404	IS Bloomberg , e. pašto pranešimas	KIS 1	5,95
HSBC GIF-EUR COR CRD BD-IC	LU	LU0165125831	3 851	HSBC Investment Funds (Luxembourg) S.A.	258 960	270 421	IS Bloomberg	KIS 1	1,96
PICTET FUND-EUR CORP BON	LU	LU0128472205	484	Pictet Funds S.A.	258 960	265 902	IS Bloomberg	KIS 1	1,92
Iš viso:			184 655		1 277 536	1 358 727			9,83
Kitų kolektyvinio investavimo subjektų vienetai (akcijos)									
Iš viso:									
Iš viso KIS vienetų (akcijų):					1 277 536	1 358 727			9,83

* – 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										
CME USD/EUR CURR FUTURE	Chicago Mercantile Exchange	US	Chicago Mercantile Exchange	USD	XS0541528682, JAV doleriai s-toje	431 514	- 6 655	IS Bloomberg	2011 03 14	-0,05
Iš viso:							- 6 655			-0,05
Kitos išvestinės finansinės priemonės										
NDF9011	AB SEB bankas	LT	AB SEB bankas	LTL	XS0485991417, XS0541528682	234 891	- 14 088	e. pašto pranešimas	2011 01 14	-0,10
Iš viso:							- 14 088			-0,10
Iš viso išvestinės finansinės priemonės										
							- 20 743			-0,15

Banko pavadinimas	Valiuta	Bendra rinkos vertė	Palūkanų norma	Dalis GA (%)
Pinigai				
AB SEB bankas	LTL	474 190	0,51	3,43
AB SEB bankas	EUR	25 881	0,36	0,19
AB SEB bankas	USD	432	0,20	0,00
SEB London Futures	EUR	3		0,00
SEB London Futures	USD	20 348		0,15
Iš viso pinigai:				
		520 854		3,77

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		-52 781		-0,38
Gautinos sumos		115		0,00
Iš viso:		-52 666		-0,38

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				
Vyriausybės obligacijos	10 389 948	78,63	10 669 765	77,17
Įmonių obligacijos	2 764 163	20,92	2 708 704	19,59
P pinigų rinkos priemonės*	61 012	0,46	468 189	3,39
Išvestinės priemonės	- 817	-0,01	- 20 743	-0,15
Iš viso:	13 214 306	100,00	13 825 914	100,00
Pagal regionus				
Vakarų Europa	7 672 797	58,06	8 536 069	61,74
Vidurio ir Rytų Europa	5 481 314	41,48	4 842 400	35,02
Iš viso:	13 154 112	99,54	13 378 469	96,76

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)	5 893	USD	Valiutų kursų svyravimo rizikos valdymas	Reguliuojamų rinkų IP
CME USD/EUR CURR FUTURE	Ateities sandoris (angl. future)	5 856	USD	Valiutų kursų svyravimo rizikos valdymas	Reguliuojamų rinkų IP
EURO BOBL FUTURE	Ateities sandoris (angl. future)	-783	EUR	Palūkanų normų rizikos valdymas	Reguliuojamų rinkų IP
EURO BOBL FUTURE	Ateities sandoris (angl. future)	-17	EUR	Palūkanų normų rizikos valdymas	Reguliuojamų rinkų IP
EURO BUND FUTURE	Ateities sandoris (angl. future)	-2 733	EUR	Palūkanų normų rizikos valdymas	Reguliuojamų rinkų IP
EURO BUND FUTURE	Ateities sandoris (angl. future)	10 300	EUR	Palūkanų normų rizikos valdymas	Reguliuojamų rinkų IP
EURO SCHATZ FUTURE	Ateities sandoris (angl. future)	5 420	EUR	Palūkanų normų rizikos valdymas	Reguliuojamų rinkų IP
EURO SCHATZ FUTURE	Ateities sandoris (angl. future)	-3 526	EUR	Palūkanų normų rizikos valdymas	Reguliuojamų rinkų IP
Išankstiniai valiutos keitimo sandoriai	Išankstinis sandoris (angl. forward)	-3 424	EUR	Valiutų kursų svyravimo rizikos valdymas	Kitų rinkų investicinė priemonė

2010 01 04 – 2010 06 30

Priemonės pavadinimas	Priemonės rūšis	Išpirkimo data	Pelnas/nuostolis valiuta	Valiutos kodas	Priemonės panaudojimo tikslas	Pastabos
EURO SCHATZ FUTURE	Ateities sandoris (angl. future)	-	- 3 430	EUR	Obligacijų rizikos valdymas	Reguliuojamų rinkų IP
EURO BOBL	Ateities sandoris	-	692	EUR	Obligacijų rizikos	Reguliuojamų

FUTURE	(angl. future)				valdymas	rinkų IP
EUREX BUND FUTURE	Ateities sandoris (angl. future)	-	- 3 235	EUR	Obligacijų rizikos valdymas	Reguliuojamų rinkų IP
Išankstiniai valiutos keitimo sandoriai	Išankstinis sandoris (angl. forward)	-	- 2 572	LTL	Valiutų kursų svyravimo rizikos valdymas	Kitų rinkų investicinė priemonė

7 PASTABA IŠ IŠVESTINIŲ FINANSINIŲ PRIEMONIŲ SANDORIŲ KYLANČIŲ IŠIPAREIGOJIMŲ BENDRA VERTĖ

2011 06 30

Priemonės rūšis	Išpirkimo data	Išipareigojimų vertė valiuta ataskaitinio laikotarpio pabaigoje	Valiutos kodas	Pastabos
Ateities sandoris (angl. future)	2011 09 08	280	EUR	Reguliuojamų rinkų investicinė priemonė
Ateities sandoris (angl. future)	2011 09 08	1 320	EUR	Reguliuojamų rinkų investicinė priemonė

2010 12 31

Priemonės rūšis	Išpirkimo data	Išipareigojimų vertė valiuta ataskaitinio laikotarpio pabaigoje	Valiutos kodas	Pastabos
Išankstinis sandoris (angl. forward)	2011 01 14	14 088	LTL	Kitos nei reguliuojamų rinkų IP
Ateities sandoris (angl. future)	2011 03 14	2 550	USD	Reguliuojamų 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>	341	Komisinis mokestis už sandorius	Ne
AB SEB bankas	86	Komisinis mokestis už sandorius	Taip
Iš viso:*	427		

* nurodyti mokesčiai nemažina pensijų fondo grynujų 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>	103	Komisinis mokestis už sandorius	Ne
AB SEB bankas	93	Komisinis mokestis už sandorius	Taip
Iš viso:*	196		

* nurodyti mokesčiai nemažina pensijų fondo grynujų 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		434 857
Periodinės įmokos į pensijų fondą	iš Valstybinio socialinio draudimo fondo paties dalyvio įmokėtos lėšos (pildoma tik papildomo savanoriško pensijų kaupimo pensijų fondo atveju)	213 406
	darbdavių ir kitų trečiųjų asmenų įmokėtos lėšos (pildoma tik papildomo savanoriško pensijų kaupimo pensijų fondo atveju)	86 195
	Valstybinio socialinio draudimo fondo sumokėti delspinigiai	-
Iš garantijų rezervo sumokėtos lėšos		-
Iš kitų pensijų fondų pervestos lėšos	iš tos pačios pensijų kaupimo bendrovės	135 256
	iš kitos pensijų kaupimo bendrovės	-
Kitos gautos lėšos (nurodyti šaltinį ir gautų lėšų sumą), iš viso		-

29. Išmokėtos lėšos:

Bendra išmokėtų lėšų suma		1 118 859
Pensijų išmokos	vienkartinės išmokos dalyviams	978 872
	periodinės išmokos dalyviams	-
	išmokos anuiteto įsigijimui	-
Į kitus pensijų fondus pervestos lėšos	valdomus tos pačios pensijų kaupimo bendrovės	46 107
	valdomus kitos pensijų kaupimo bendrovės	-
Išstojusiems dalyviams išmokėtos lėšos (pildoma tik papildomo savanoriško kaupimo pensijų fondų atveju)		22 394
Paveldėtojams išmokėtos lėšos		71 486
Kitais pagrindais išmokėtos lėšos (nurodyti šaltinį ir išmokėtų lėšų sumą), iš viso		-

IX. INFORMACIJA APIE GARANTIJŲ REZERVĄ

30. Jei pensijų fondo taisyklėse yra išsipareigojimas 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 rengę 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.

-