

2010 metų ataskaita

SEB pensija 2

2010 m. gruodžio 31 d.



I. BENDROJI INFORMACIJA.....	3
II. GRYNŪJŲ AKTYVŲ, APSKAITOS VIENETŲ SKAIČIUS IR VERTĘ.....	3
III. ATSKAITYMAI IŠ PENSIJŲ TURTO	4
IV. INFORMACIJA APIE PENSIJŲ FONDO INVESTICINIŲ PRIEMONIŲ PORTFELĮ.....	5
V. PENSIJŲ FONDO LYGINAMASIS INDEKSAS, INVESTICIJŲ GRAŽA IR RIZIKOS RODIKLIAI	13
VI. PENSIJŲ FONDO FINANSINĖ BŪKLĖ	16
VII. INFORMACIJA APIE PENSIJŲ FONDO DALYVIUS	18
VIII. IŠORINIAI PINIGŲ SRAUTAI.....	29
IX. INFORMACIJA APIE GARANTIJŲ REZERVĄ.....	29
X. INFORMACIJA APIE PENSIJŲ FONDO REIKMĖMS PASISKOLINTAS LĖŠAS.....	29
XI. KITA INFORMACIJA	30
XII. ATSAKINGI ASMENYS.....	31

**PENSIJŲ FONDO *SEB PENSİJA 2*
2010 METŲ ATASKAITA**

I. BENDROJI INFORMACIJA

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

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

2. Ataskaitinis laikotarpis, už kurį pateikta ataskaita — 2010 metų dvylika mėnesių.

3. Duomenys apie valdymo įmonę:

3.1. pavadinimas ir įmonės kodas — UAB *SEB investicijų valdymas*, įmonės kodas 125277981;

3.2. buveinė (adresas) — 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, priimantys investicinius sprendimus) — Gediminas Milieška, portfelių valdytojas.

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

AB SEB bankas

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

faks. (8 5) 268 1255

įmonės kodas 112021238

II. GRYNŲJŲ AKTYVŲ, APSKAITOS VIENETŲ SKAIČIUS IR VERTĖ

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

	Ataskaitinio laikotarpio pradžioje (2010 01 04)	Ataskaitinio laikotarpio pabaigoje (2010 12 31)	Prieš metus (2009 12 31)	Prieš dvejus metus (2008 12 31)
Grynujų aktyvų vertė, Lt	726 236 621	853 877 362	726 567 735	475 882 438
Apskaitos vieneto vertė, Lt	1,2289	1,3645	1,2292	0,9860
Apskaitos vienetų skaičius	590 955 022	625 794 232	591 085 954	482 656 580

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

	Apskaitos vienetų skaičius	Vertė, Lt
Apskaitos vienetų skaičius (konvertuojant pinigines lėšas į apskaitos vienetus)	66 011 902	88 162 765
Apskaitos vienetų skaičius (konvertuojant vienetus į pinigines lėšas)	31 303 618	40 546 148

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	Per ataskaitinį laikotarpį sumokėtų atskaitymų suma, Lt
Nuo įmokų	3,00 proc.	3,00 proc.	2 042 070	2 042 070
Nuo turto vertės	1,00 proc.	1,00 proc.	7 836 323	7 692 518
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.	65670	59383
<i>pensijų kaupimo bendrovės keitimas daugiau kaip kartą per metus</i>	4,00 proc.	-	-	-
Iš viso			9 944 062	9 793 972
BAR *				1,25%
Sąlyginis BIK ir (arba) tikėtinas sąlyginis BIK *				1,80%
PAR (portfelio apyvartumo rodiklis)*				142,44

* 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.

Tarpininko pavadinimas	Sumokėti mokesčiai Lt	Paslaugos pavadinimas	Ar susijęs su valdymo įmone
<i>Skandinaviska Enskilda Banken AB</i>	29 347	Komisinis mokestis už sandorius	Ne
AB SEB bankas	5 919	Komisinis mokestis už sandorius	Taip
<i>HSBC Trinkaus</i>	68 598	Komisinis mokestis už sandorius	Ne
Iš viso*	103 864		

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

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

-

10. Pateikti konkretų pavyzdį, iliustruojantį atskaitymų įtaką galutinei dalyviui tenkančiai investicijų grąžai (pateikti tik metų ataskaitoje). Pavyzdyje pateikti skaičiavimus, kiek būtų atskaityta (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.

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

IV. INFORMACIJA APIE PENSIJŲ FONDO INVESTICINIŲ PRIEMONIŲ PORTFELĮ

11. Ataskaitinio laikotarpio pabaigos investicinių priemonių portfelio sudėtis:

Emitento pavadinimas	Šalis	ISIN kodas	Kiekis, vnt.	Bendra nominali vertė	Bendra įsigijimo vertė	Bendra rinkos vertė	Rinka, pagal kurios duomenis nustatyta rinkos vertė (tinklalapio adresas)	Balsų dalis 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 nominali vertė	Bendra įsigijimo vertė	Bendra rinkos vertė	Palūkanų norma	Išpirkimo / konvertavimo data	Dalis GA, %
Ne nuosavybės vertybiniai popieriai, įtraukti į Oficialųjį ar jį atitinkantį prekybos sąrašą									
Iš viso:									
Ne nuosavybės vertybiniai popieriai, įtraukti į Papildomąjį ar jį atitinkantį prekybos sąrašą									
Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT1000600213	35 011	12 088 598	11 340 895	12 009 082	1,33	2011 07 07	1,41
Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT0000601957	100 000	10 000 000	9 499 117	9 998 882	0,58	2011 01 12	1,17
Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT0000603227	73 642	7 364 200	7 606 217	8 097 777	2,70	2012 10 29	0,95
Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT0000605107	19 850	1 985 000	2 103 776	2 109 158	4,15	2015 04 29	0,25
Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT0000601999	75 000	7 500 000	7 313 941	7 470 368	1,20	2011 05 04	0,87
Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT0000601981	12 000	1 200 000	1 172 122	1 195 815	1,20	2011 04 20	0,14
DnB NORD bankas	LT	LT0000431132	47 000	4 700 000	4 686 817	4 828 301	2,79	2013 10 07	0,57
Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT1000600288	5 556	1 918 376	1 856 414	1 860 543	2,38	2012 04 25	0,22

Iš viso:			368 059	46 756 174	45 579 298	47 569 925			5,57
Ne nuosavybės vertybiniai popieriai, kuriais prekiaujama kitose reguliuojamose rinkose									
Slovakijos Respublika	SK	XS0192595873	2 700	9 322 560	9 110 627	10 137 335	2,64	2014 05 20	1,19
Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	XS0147459803	306	1 056 557	1 142 344	1 147 037	2,27	2012 05 10	0,13
Vokietijos Federacinė Respublika	DE	DE0001135267	133	459 222	449 285	514 418	1,60	2015 01 04	0,06
Prancūzijos Respublika	FR	FR0000571218	4 380	15 123 264	18 157 293	19 036 177	3,81	2029 04 25	2,23
Nyderlandų Karalystė	NL	NL0000102242	1 550	5 351 840	4 858 347	5 741 899	1,91	2015 07 15	0,67
Vokietijos Federacinė Respublika	DE	DE0001135317	200	690 560	666 197	773 899	2,25	2017 01 04	0,09
Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	XS0327304001	3 670	12 671 776	12 417 080	13 169 347	4,93	2018 02 07	1,54
Slovakijos Respublika	SK	XS0299989813	4 000	13 811 200	13 420 343	14 759 502	3,65	2017 05 15	1,73
Slovėnijos Respublika	SI	XS0292653994	2 580	8 908 224	8 399 572	9 180 515	4,02	2018 03 22	1,08
Belgijos Karalystė	BE	BE0000298076	700	2 416 960	2 634 390	2 573 728	1,95	2012 09 28	0,30
Čekijos Respublika	CZ	XS0368800073	2 000	6 905 600	6 790 967	7 660 535	3,73	2018 06 11	0,90
Lenkijos Respublika	PL	XS0371500611	2 000	6 905 600	6 930 460	7 773 343	4,12	2018 06 20	0,91
Belgijos Karalystė	BE	BE0000306150	1 320	4 557 696	4 433 271	4 718 360	3,17	2015 09 28	0,55
Vokietijos Federacinė Respublika	DE	DE0001135374	600	2 071 680	2 175 202	2 299 861	2,73	2019 01 04	0,27
Prancūzijos Respublika	FR	FR0010061242	2 150	7 423 520	7 881 439	8 211 640	1,55	2014 04 25	0,96
Rusijos Federacija	RU	XS0114288789	4 000 000	9 343 442	11 120 836	10 989 161	4,82	2030 03 31	1,29
Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	XS0435153068	1 500	5 179 200	6 018 230	6 334 210	3,93	2014 06 22	0,74
Austrijos Respublika	AT	AT0000385992	1 700	5 869 760	6 317 447	6 308 269	1,35	2013 10 20	0,74
Prancūzijos Respublika	FR	FR0000188690	3 200	11 048 960	11 998 729	11 897 961	0,96	2012 10 25	1,39
Austrijos Respublika	AT	AT0000383864	2 000	6 905 600	8 589 876	9 215 002	3,74	2027 07 15	1,08
Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	XS0457764339	1 200	3 131 880	3 263 419	3 496 105	4,44	2015 01 15	0,41
Austrijos Respublika	AT	AT0000385356	2 500	8 632 000	9 368 310	9 370 861	0,90	2012 07 15	1,10
Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	XS0485991417	2 600	6 785 740	6 668 550	7 732 052	5,80	2020 02 11	0,91
Belgijos Karalystė	BE	BE0000315243	700	2 416 960	2 661 275	2 526 071	3,80	2019 03 28	0,30
Vokietijos Federacinė Respublika	DE	DE0001135218	400	1 381 120	1 512 069	1 543 213	0,84	2013 01 04	0,18
Prancūzijos Respublika	FR	FR0010171975	2 550	8 804 640	8 744 768	9 236 730	3,90	2055 04 25	1,08
Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	XS0541528682	3 300	8 612 670	8 550 745	8 647 905	5,33	2017 09 14	1,01
Slovėnijos Respublika	SI	SI0002102919	1 700	5 869 760	6 278 011	6 287 543	1,23	2012 02 05	0,74
Nyderlandų Karalystė	NL	NL0009086115	2 800	9 667 840	11 027 219	10 564 904	3,01	2019 07 15	1,24
Iš viso:			4 054 439	191 325 831	201 586 300	211 847 580			24,81
Išleidžiami nauji ne nuosavybės vertybiniai popieriai									
Iš viso:									
Iš viso ne nuosavybės vertybinių popierių:				238 082 005	247 165 599	259 417 504			30,38

KIS pavadinimas	Šalis	ISIN kodas	Kiekis, vnt.	Valdytojas	Bendra įsigijimo vertė	Bendra rinkos vertė	Rinkos vertės nustatymo šaltinis (tinklalapio adresas)	KIS tipas*	Dalis GA, %
Kolektyvinio investavimo subjektų įstatymo 61 str. 1 d. reikalavimus atitinkančių kolektyvinio investavimo subjektų (KIS) vienetai (akcijos)									
Raiffeisen-Eastern European Equities	AT	AT0000785241	19 787	Raiffeisen Kapitalanlage-Gesellschaft m.b.H.	11 784 344	22 204 420	e. pašto pranešimas	KIS 3	2,60
Raiffeisen Eastern European Bond Fund	AT	AT0000A0EYA2	45 824	Raiffeisen Kapitalanlage-Gesellschaft m.b.H.	33 592 605	35 837 081	IS Bloomberg	KIS 1	4,20
SEB Fund 5 - SEB Corporate Bond Fund EUR	LU	LU0133008952	1 962 124	SEB Asset Management S.A.	8 286 720	8 948 862	e. pašto pranešimas	KIS 1	1,05
BlueBay Investment Grade Bond Fund I - Base EUR	LU	LU0225310266	50 300	BlueBay Asset Management PLC	21 848 421	22 525 756	IS Bloomberg	KIS 1	2,64
Comgest Growth AS X JPN-USD	IE	IE00B16C1G93	348 478	Comgest Asset Management International	12 027 441	13 733 335	IS Bloomberg	KIS 3	1,61
SEB Fund 1 - SEB North America Fund	LU	LU0030166176	5 172 714	SEB Asset Management S.A.	53 509 710	61 778 569	e. pašto pranešimas	KIS 3	7,24
SEB Sicav 1-SEB Eastern Europe ex Russia	LU	LU0070133888	3 431 018	SEB Asset Management S.A.	30 704 399	36 108 499	e. pašto pranešimas	KIS 3	4,23
SEB Eastern Europe Bond Fund	EE	EE3600087532	474 467	AS SEB Varahaldus	16 549 270	18 418 408	IS Bloomberg	KIS 1	2,16
Generali Investments SICAV - Central and Eastern E	LU	LU0145480769	30 930	Generali Fund Management SA	14 818 889	15 742 666	IS Bloomberg	KIS 1	1,84
Eaton Vance Int.-US Value Fund Registered SharesI2	IE	IE00B2RKZ343	1 270 032	Eaton Vance Advisors Ireland Ltd	27 881 040	30 362 262	IS Bloomberg	KIS 3	3,56
FAST JAPAN FUND - Y	LU	LU0348530451	94 009	FIL Fund Management Limited	22 811 751	22 398 528	IS Bloomberg	KIS 3	2,62
IShares MSCI Australia Index Fund	US	US4642861037	112 724	BlackRock Fund Advisors	7 232 095	7 484 406	IS Bloomberg	KIS 3	0,88
GLG European Equity S	IE	IE00B29Z0J87	63 760	GLG Partners Asset management Ltd.	16 873 834	17 517 498	IS Bloomberg	KIS 3	2,05
JB Commodity Fund EUR-C	LU	LU0244125398	55 459	Swiss & Global Asset Management	15 800 553	17 710 822	IS Bloomberg	KIS 5	2,07
SEB Fund 2-SEB Russia Fund	LU	LU0273119544	903 645	SEB Asset Management S.A.	27 874 449	38 095 258	e. pašto pranešimas	KIS 3	4,46
JB Euro Government Bond Fund - C	LU	LU0100842706	34 057	Swiss & Global Asset Management	17 130 245	17 803 319	IS Bloomberg	KIS 1	2,08

East Capital Russian Fund	SE	SE0000777708	21 742	East Capital Asset Management AB/Sweden	10 089 351	12 357 183	IS Bloomberg	KIS 3	1,45
HSBC GIF-EUR COR CRD BD-IC	LU	LU0165125831	295 721	HSBC Investment Funds (Luxembourg)	20 487 761	20 766 404	IS Bloomberg	KIS 1	2,43
PICTET FUND-EUR CORP BON	LU	LU0128472205	35 666	Pictet Funds S.A.	19 403 594	19 575 798	IS Bloomberg	KIS 1	2,29
Schroders Euro Corporate Bond Fund	LU	LU0113258742	259 915	Schroder Investment Management Luxemburg	14 708 928	15 094 824	IS Bloomberg	KIS 1	1,77
T ROWE PRICE-US LG CP GRW-A	LU	LU0174119775	733 822	T. Rowe Price Global Inv. Services Ltd	25 688 202	29 819 681	IS Bloomberg	KIS 3	3,49
T ROWE PRICE-ASIAN EX JAPAN JPN-I	LU	LU0266341725	399 939	T. Rowe Price Global Inv. Services Ltd	14 988 656	16 617 307	IS Bloomberg	KIS 3	1,95
Investec GS Asian Equity-A A	LU	LU0345775950	358 587	Investec Asset Management Guernsey	18 418 064	18 623 957	IS Bloomberg	KIS 3	2,18
BGF-Latin American Fund-SD2	LU	LU0252970081	48 500	Black Rock Luxembourg	11 029 437	13 224 976	IS Bloomberg	KIS 3	1,55
TT European Equity A	IE	IE0030893295	335 853	TT International	14 218 096	15 490 398	IS Bloomberg	KIS 3	1,81
Odey Allegra European Fund	IE	IE00B04YBL58	28 433	Odey Asset Management LLP	13 688 764	16 019 946	IS Bloomberg	KIS 3	1,88
JOHCM European Select Val Inst EUR	IE	IE0032904330	2 694 210	J O Hambro Capital Management Limited	16 925 626	17 972 563	IS Bloomberg	KIS 3	2,10
Vontobel Fund-Belvista Commodity I	LU	LU0415415800	48 675	Vontobel Management SA/Luxembourg	17 138 546	17 257 960	IS Bloomberg	KIS 5	2,02
Iš viso:			19 330 393		535 510 790	599 490 687			70,21
Kitų kolektyvinio investavimo subjektų vienetai (akcijos)									
EEREIF	EE	EE3500096500	91 209	AS Gild Property Asset Mamangement	4 166 728	2 780 811	www.gildbankers.com	KIS 5	0,33
KEY HEDGE Fund INC-B EUR	BM	VGG5250A1553	38 323	Key Capital Management Inc	16 466 921	16 615 817	IS Bloomberg www.keyhedge.com	KIS 5	1,95
Iš viso:			129 533		20 633 649	19 396 628			2,27
Iš viso KIS vienetų (akcijų):					556 144 439	618 887 315			72,48

* – 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	FR0000188690	-2 634 607	2 175	e. pašto pranešimas	2011 03 11	0,00
CME USD/EUR CURR FUTURE	Chicago Mercantile Exchange	US	Chicago Mercantile Exchange	USD	XS0541528682	8 198 772	- 126 450	IS Bloomberg	2011 03 14	-0,01
EURO-BOBL FUTURE	EUREX	CH	EUREX	EUR	FR0010061242	1 230 371	- 2 900	e. pašto pranešimas	2011 03 11	-0,00
EURO-BUND FUTURE	EUREX	CH	EUREX	EUR	XS0292653994	1 298 011	- 3 418	e. pašto pranešimas	2011 03 11	-0,00
EURO BUXL 30Y BND FUTURE	EUREX	CH	EUREX	EUR	FR0000571218	-5 215 800	22 236	e. pašto pranešimas	2011 03 11	0,00
Iš viso:							- 108 357			-0,01
Kitos išvestinės finansinės priemonės										
NDF9016	AB SEB bankas	LT	AB SEB bankas	LTL	XS0485991417	6 524 750	- 406 554	e. pašto pranešimas	2011 01 14	-0,05
Iš viso:							- 406 554			-0,05
Iš viso išvestinės finansinės priemonės										
							- 514 911			-0,06

Banko pavadinimas	Valiuta	Bendra rinkos vertė	Palūkanų norma	Dalis GA, %
Pinigai				
AB SEB bankas	LTL	288 900	0,51	0,03
AB SEB bankas	SEK	41 364		0,00
SEB London Futures	EUR	329 041		0,04
SEB London Futures	USD	396 928		0,05
Iš viso pinigai:		1 056 233		0,12

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, %
Pasiskolintos lėšos likvidumui palaikyti		-23 994 127		-2,81
Mokėtinos sumos		-1 125 036		-0,13
Gautinos sumos (dividendai, sukauptos palūkanos už s-tų likučius)		150 383		0,02
Iš viso:		-24 968 780		-2,92

12. Investicijų pasiskirstymas pagal investavimo strategiją atitinkančius kriterijus (pildyti pagal investavimo strategiją atitinkančius kriterijus, pavyzdžiui, pagal turto rūšis, pramonės šakas, geografinę zoną, valiutas, rinkas, emitentų tipus (vyriausybė, bendrovės), emitentų kredito reitingus, priemonių galiojimo trukmę bei kt.):

Investicijų pasiskirstymas	Rinkos vertė ataskaitinio laikotarpio pabaigoje 2010 12 31	Dalis aktyvuose (%)	Rinkos vertė ataskaitinio laikotarpio pradžioje 2009 12 31	Dalis aktyvuose ataskaitinio laikotarpio pradžioje (%)
Pagal investavimo objektus				
Akcijos	374 590 883	43,87%	272 831 054	52,69%
Obligacijos	434 130 623	50,84%	382 847 377	37,55%
Pinigų rinkos priemonės	9 016 179	1,06%	55 333 137	7,62%
Alternatyvios investicijos	36 654 588	4,29%	15 774 509	2,17%
Išvestinės priemonės	- 514 911	-0,06%	- 218 342	-0,03%
Iš viso	853 877 362	100,00%	726 567 735	100,00%
Pagal regionus (Obligacijos)				
Vakarų Europos obligacijos	245 085 035	28,70%	265 706 352	36,57%
Vidurio ir Rytų Europos obligacijos	178 056 427	20,85%	117 141 025	16,12%
NVS obligacijos	10 989 161	1,29%	0	0,00%
Iš viso	434 130 623	50,84%	382 847 377	52,69%
Pagal regionus (Akcijos)				
Šiaurės Amerikos akcijos	101 524 995	11,89%	90 879 490	12,51%
Vakarų Europos akcijos	67 000 404	7,85%	57 467 231	7,91%
NVS akcijos	50 452 441	5,91%	42 763 859	5,89%
Vidurio ir Rytų Europos akcijos	54 839 566	6,42%	40 253 253	5,54%
Besivystančių rinkų akcijos	18 784 063	2,20%	18 608 726	2,56%
Japonijos akcijos	22 398 528	2,62%	15 419 958	2,12%
Azijos be Japonijos akcijos	59 590 886	6,98%	7 438 537	1,02%
Iš viso	374 590 883	43,87%	272 831 054	37,55%

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

Priemonės pavadinimas	Priemonės rūšis	Pelnas/nuostolis valiuta	Valiutos kodas	Priemonės panaudojimo tikslas	Pastabos
CME USD/EUR CURR FUTURE	Ateities sandoris (angl. future)	-202 488	USD	Valiutų kursų svyravimo rizikos valdymas	Reguliuojamų rinkų IP
EURO BOBL FUTURE	Ateities sandoris (angl. future)	-78 590	EUR	Palūkanų normų rizikos valdymas	Reguliuojamų rinkų IP
EURO BUND FUTURE	Ateities sandoris (angl. future)	-47 040	EUR	Palūkanų normų rizikos valdymas	Reguliuojamų rinkų IP
EURO BUXL FUTURE	Ateities sandoris (angl. future)	24 680	EUR	Palūkanų normų rizikos valdymas	Reguliuojamų rinkų IP
EURO SCHATZ FUTURE	Ateities sandoris (angl. future)	-24 155	EUR	Palūkanų normų rizikos valdymas	Reguliuojamų rinkų IP
EUROSTOXX 50 FUTURE	Ateities sandoris (angl. future)	-247 920	EUR	VP pasirinkimo ir kainų kitimo rizikos valdymas	Reguliuojamų rinkų IP
NIKKEI 225 FUTURE	Ateities sandoris (angl. future)	-13 896 410	JPY	VP pasirinkimo ir kainų kitimo rizikos valdymas	Reguliuojamų rinkų IP
S&P500 EMINI FUTURE	Ateities sandoris (angl. future)	-802 635	USD	VP pasirinkimo ir kainų kitimo rizikos valdymas	Reguliuojamų rinkų IP

Priemonės pavadinimas	Priemonės rūšis	Pelnas/nuostolis valiuta	Valiutos kodas	Priemonės panaudojimo tikslas	Pastabos
Išankstiniai valiutos keitimo sandoriai	Išankstinis sandoris (angl. forward)	1 031 417	LTL	Valiutų kursų svyravimo rizikos valdymas	Kitų rinkų investicinė priemonė

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 investicinė finansinė priemonė gali apsaugoti investicinių priemonių sandorį (investicinių priemonių poziciją) nuo rizikos.

Ataskaitiniu laikotarpiu dalį fondo turto sudarė išankstinių euro ir lito valiutos keitimo sandorių (*currency nondeliverable forwards*) įsipareigojimai. Išankstiniai valiutos keitimo sandoriai sudaromi siekiant apsaugoti nuo galimo fondo investicijų eurais nuvertėjimo. Sudarydamas šiuos sandorius, fondas prisiima išankstinių sandorių emitento kredito riziką. Tokių išvestinių priemonių 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. gryųjų aktyvų vertės. Apskaičiuojant fondui nustatytus investavimo į vieno emitento vertybinius popierius apribojimus, yra atsižvelgiama ir į turimas išvestines finansines priemones.

Per ataskaitinį laikotarpį fondas sudarė obligacijų, kurių kainų pokytis priklauso nuo Vokietijos 2, 5, 10 arba 30 metų trukmės obligacijų kainų pokyčio, ateities sandorius (*schatz, bobl, ir buxl futures*). Sudarant šiuos sandorius, yra keičiama bendra fondo palūkanų normų rizika (obligacijų rinkos rizika). Norėdama valdyti šią riziką, valdymo įmonė riboja fondo investicijų į skolos vertybinius popierius vidutinę finansinę trukmę nuo 0,5 iki 11 metų. Ši nuostata yra įtvirtinta fondo taisyklėse.

Ataskaitiniu laikotarpiu fondas sudarė ateities akcijų indeksų sandorius (*equity index futures*). Buvo sudaromi tik ateities sandoriai, kurių kaina priklauso nuo JAV akcijų indekso *S&P500*, Europos akcijų indekso *DJ EuroStoxx 50* ar Japonijos akcijų indekso *NIKKEI 225*. Tokių sandorių, išvestinių finansinių priemonių, rizika yra nustatoma atsižvelgus į jų nominaliąją vertę. Ši rizika yra ribojama stebint, kad bendra fondo investicijų į pasaulio akcijų rinkas suma neviršytų ribų, nustatytų fondo taisyklėse.

Ataskaitiniu laikotarpiu sudaryti išvestinių investicinių priemonių sandoriai buvo taikomi norint valdyti valiutos, bendros fondo palūkanų normos ir akcijų kainų kitimo riziką.

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

Priemonės rūšis	Išpirkimo data	Įsipareigojimų vertė valiuta ataskaitinio laikotarpio pabaigoje	Valiutos kodas	Pastabos
Ateities sandoris (angl. future)	2011 03 11	840	EUR	Reguliuojamų rinkų investicinė priemonė
Ateities sandoris (angl. future)	2011 03 11	990	EUR	Reguliuojamų rinkų investicinė priemonė
Ateities sandoris (angl. future)	2011 03 14	48 450	USD	Reguliuojamų rinkų investicinė priemonė
Išankstinis sandoris (angl. forward)	2011 01 14	406 554	LTL	Kitos nei reguliuojamų rinkų IP

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

Ataskaitiniu laikotarpiu fondo investicijų portfelis atitiko taisyklėse nustatytą investicijų strategiją.

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

Ataskaitiniu laikotarpiu fondo investicijų portfelio vertės pokyčiams didžiausią įtaką turėjo:

1. Akcijų rinkų vertės didėjimas. Antroje 2010 metų pusėje pasaulio ekonomikos plėtra tapo spartesnė, toliau didėjo bendrovių gaunamas pelnas ir investuotojų rizikos tolerancija – visa tai lėmė, kad akcijų kainos smarkiai išaugo ir turėjo teigiamą įtaką portfelio gražai.

2. Lietuvos Respublikos Vyriausybės obligacijų priedo už riziką mažėjimas. 2010 metais investuotojai dažniausiai rinkosi besivystančių šalių obligacijas. Be to, Lietuvos ekonomikos būklė ir toliau gerėjo bei tapo daug stabilesnė, todėl Lietuvos Respublikos Vyriausybės obligacijų kainos kilo, o pajamingumas mažėjo.
3. Įmonių obligacijų brangimas. 2010 metais, ypač pirmą pusmetį, įmonių obligacijos toliau brango. Tą lėmė gerėjanti įmonių finansinė padėtis.
4. Žaliavų kainų brangimas. Stiprėjant pasaulio ekonomikos atsigavimui, didėjo ir žaliavų kainos. Ypač paklausa išaugo besivystančiose rinkose, tarp jų ir Kinijos. Žaliavų kainų brangimas turėjo teigiamą įtaką vieneto vertės didėjimui.
5. Dėl JAV dolerio vertės, palyginti su euro verte, didėjimo padidėjo investicijų JAV doleriais grąža, todėl padidėjo ir viso fondo grąža.

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

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

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

Fondo SEB pensija 2 lyginamojo indekso sudėtis nuo 2009 m. spalio 1 d.

27 proc.	indeksas <i>MSCI AC World, Net IMI (Investable Market Index)</i> (perskaičiuota litais)
5,5 proc.	indeksas <i>Nomura Central and Eastern Europe ex Russia Total Return</i> (perskaičiuota litais)
5,5 proc.	indeksas <i>RTS</i> (perskaičiuota litais)
23 proc.	indeksas <i>J. P. Morgan Global Bond EMU</i> (perskaičiuota litais)
12 proc.	indeksas <i>Barclays Investment Grade Euro Credit</i> (perskaičiuota litais)
10 proc.	indeksas <i>Merrill Lynch Eastern Europe Government Bond</i> (perskaičiuota litais)
2 proc.	indeksas <i>Merrill Lynch EM Russia Government Bond</i> (perskaičiuota litais)
11 proc.	indeksas, apskaičiuotas atsižvelgiant į 1 mėnesio VILIBOR (indeksuotas)-50 bazinių punktų
2 proc.	indeksas <i>Rogers International Commodity Total Return</i> (perskaičiuota litais)
2 proc.	indeksas <i>HFRX Global Hedge Fund</i> (perskaičiuota litais)

Bendrovės sudarytas indeksas, apskaičiuotas atsižvelgiant į 1 mėnesio indeksuotą palūkanų normą VILIBOR (atėmus 50 bazinių punktų metinę normą). Indeksas rodo tikėtiną Lietuvos Respublikos Vyriausybės vertybinių popierių, indėlių ir grynųjų pinigų grąžą. Šis bendrovės sudarytas indeksas apskaičiuojamas kiekvieną kalendorinę dieną, taikant 1 mėnesio indeksuotą palūkanų normą VILIBOR, iš kurios atimama 50 bazinių punktų metinė norma, ir perskaičiuojant gautą dydį vienai kalendorinei dienai. *Barclays Investment Grade Euro Credit* (perskaičiuota litais) – Vakarų Europos investicinio reitingo įmonių obligacijų indeksas. Rodo tikėtiną investicijų grąžą įsigijus Vakarų Europos investicinio reitingo įmonių obligacijų.

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

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

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

Merrill Lynch EM Russia Government Bond (perskaičiuota litais) – Rusijos vyriausybės obligacijų indeksas. Rodo tikėtiną investicijų grąžą įsigijus Rusijos vyriausybės obligacijų.

MSCI AC World, Net IMI (Investable market index) (perskaičiuota eurais) – viso pasaulio akcijų rinkų indeksas, apskaičiuojamas atsižvelgiant į tai, kiek, tikėtina, galima investuoti kiekvienos šalies akcijų rinkoje. Grąža apskaičiuojama atsižvelgus į dividendus, bet atėmus už juos taikomus mokesčius.

Nomura Central and Eastern Europe ex Russia Total Return (perskaičiuota litais) – Vidurio Europos akcijų rinkų indeksas. Rodo tikėtiną grąžą įsigijus Vidurio Europos bendrovių akcijų, įskaitant ir grąžą iš gautų dividendų.

Rogers International Commodity (perskaičiuota eurais) – žaliavų rinkos kainų dinamiką rodantis indeksas. Rodo tikėtiną grąžą investavus į visapusiškai diversifikuotą žaliavų investicinį portfelį.

RTS (perskaičiuota litais) – Rusijos akcijų rinkų indeksas. Rodo tikėtiną grąžą įsigijus Rusijos bendrovių akcijų.

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

	Per ataskaitinį laikotarpį	Prieš metus	Prieš 2 metus	Prieš 10 metų
Apskaitos vieneto vertės pokytis *	11,01%	24,67%	-29,17%	-
Lyginamojo indekso reikšmės pokytis	11,91%	19,53%	-12,93%	-
Metinė grynoji investicijų graža **	10,71%	23,74%	-30,30%	-
Metinė bendroji investicijų graža (pildoma papildomo savanoriško pensijų kaupimo fondui) **	-	-	-	-
Apskaitos vieneto vertės pokyčio standartinis nuokrypis **	6,22%	7,65%	13,82%	-
Lyginamojo indekso reikšmės pokyčio standartinis nuokrypis **	6,15%	9,01%	12,10%	-
Apskaitos vieneto vertės ir lyginamojo indekso reikšmės koreliacijos koeficientas **	0,98	0,94	0,93	-
Indekso sekimo paklaida **	1,22%	3,19%	11,45%	-
Alfa rodiklis **	0,07%	6,64%	1,59%	-
Beta rodiklis **	0,92	0,88	1,89	-

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

** Pateikti rodiklių paaiškinimus.

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

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

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

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

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

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

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



20. Jei pensijų fondo reklamoje buvo naudojamos investicijų gražos prognozės, nurodyti prognozuotą dydį, palyginti neatitikimus su faktine graža ir pateikti galimas neatitikimų priežastis.

Pensijų kaupimo sutartyje nurodyta, kad tikėtina fondo *SEB pensija 2* ilgojo laikotarpio vidutinė metinė grąža yra 7–8 procentai. Lankstuko „SEB pensija“ skiltyje „Kiek galite sukaupti“ daroma prielaida, kad fondo *SEB pensija 2* vidutinė metinė grąža yra 10 procentų.

Faktiškai 2010 metų grąža buvo didesnė (11 procentų). Didesnę, negu buvo nurodyta, grąžą lėmė spartesnis akcijų ir žaliavų turto klasių kainų kilimas, būdingas ekonomikos atsigavimo laikotarpiui. Į šias turto klases, pasirinkus fondą *SEB pensija 2*, vidutiniškai yra investuojama apie 40 procentų fondo turto.

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

	Per paskutinius 3 metus	Per paskutinius 5 metus	Per paskutinius 10 metų	Nuo veiklos pradžios
Vidutinis apskaitos vieneto vertės pokytis*	-0,67%	2,13%	-	4,48%
Vidutinis pensijų fondo lyginamojo indekso reikšmės pokytis*	5,21%	-	-	5,21%
Vidutinė grynoji investicijų grąža*	-1,53%	0,74%	-	2,66%
Vidutinė bendroji investicijų grąža (pildoma papildomo savanoriško pensijų kaupimo fondui)*	-	-	-	-
Vidutinis apskaitos vieneto vertės pokyčio standartinis nuokrypis*	9,18%	7,56%	-	6,88%

* Pateikti rodiklių paaiškinimus.

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

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

Vidutinė grynoji investicijų grąža — metinių grynoji investicijų grąžų geometrinis vidurkis.

Vidutinis apskaitos vieneto vertės pokyčio standartinis nuokrypis — metinių apskaitos vieneto vertės pokyčių standartinių nuokrypių geometrinis vidurkis.

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

-

VI. PENSIJŲ FONDO FINANSINĖ BŪKLĖ

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

23.1. paskutinių 2 finansinių metų balansus, išdėstytus palyginamojoje lentelėje;

BALANSAS (LT)

2010 m. gruodžio 31 d.

Eil. nr.	Turtas	Pastabų numeris	2010 12 31	2009 12 31
I.	PINIGAI IR PINIGŲ EKVIVALENTAI	2	1 056 233	56 182 503
II.	TERMINUOTIEJI INDĖLIAI		-	-
III.	INVESTICIJOS	1,2	878 304 820	671 452 940
1	Skolos vertybiniai popieriai		259 417 505	200 782 981
1.1.	vyriausybių ir centrinių bankų arba jų garantuoti skolos vertybiniai popieriai		254 589 204	185 439 542
1.2.	kiti skolos vertybiniai popieriai		4 828 301	15 343 439
2	Nuosavybės vertybiniai popieriai		-	-
3	Kolektyvinio investavimo subjektų investiciniai vienetai ir akcijos		618 887 315	470 669 959
4	Kitos investicijos		-	-
IV.	PRETENZIJOS DĖL IŠVESTINIŲ FINANSINIŲ PRIEMONIŲ	2	24 411	507 458
V.	GAUTINOS SUMOS	2	150 383	125 708
1	Investicijų pardavimo sandorių gautinos sumos		-	-
2	Kitos gautinos sumos		150 383	125 708
	IŠ VISO TURTO		879 535 847	728 268 609

Eil. nr.	Įsipareigojimai ir gryniesi aktyvai		2010 12 31	2009 12 31
VI.	ĮSIPAREIGOJIMAI		25 119 163	975 073
1	Investicijų pirkimo įsipareigojimai		-	-
2	Mokėtinos sumos kaupimo bendrovei ir depozitoriumui		768 047	617 956
3	Kitos mokėtinos sumos ir įsipareigojimai		356 989	357 117
4	Įsipareigojimai kredito įstaigoms	3	23 994 127	-
VII.	ĮSIPAREIGOJIMAI DĖL IŠVESTINIŲ FINANSINIŲ PRIEMONIŲ		539 322	725 801
VIII.	GRYNIEJI AKTYVAI (I+II+III+IV+V-VI-VII)		853 877 362	726 567 735
	IŠ VISO ĮSIPAREIGOJIMŲ IR GRYNŲJŲ AKTYVŲ		879 535 847	728 268 609

18 – 27 puslapiuose pateiktas aiškinamasis raštas yra neatskiriama šių finansinių ataskaitų dalis.

23.2. paskutinių 2 finansinių metų grynujų aktyvų pokyčių ataskaitas, išdėstytas palyginamojoje lentelėje;

GRYŪŲ AKTYVŲ POKYČIŲ ATASKAITA (LT)

Už metus, pasibaigusius 2010 m. gruodžio 31 d.

Eil. nr.	Straipsniai	Pastabų numeris	2010 01 01–2010 12 31	2009 01 01–2009 12 31
I.	GRYŪŲ AKTYVAI ATASKAITINIO LAIKOTARPIO PRADŽIOJE		726 567 735	475 882 438
II.	IŠ VISO PADIDĖJIMO		762 657 317	356 610 322
1	Pensijų įmokos		68 067 283	134 540 023
2	Iš kitų pensijų fondų pervestos sumos		20 068 486	12 615 887
3	Kaupimo bendrovės garantinės įmokos		-	-
4	Palūkanos ir dividendai		9 812 669	10 879 778
5	Investicijų pardavimo pelnas		5 351 701	4 801 668
6	Investicijų vertės padidėjusi dalis		517 227 095	160 576 000
7	Turto vertės padidėjimas dėl užsienio valiutų kursų pasikeitimo		138 609 804	4 717 495
8	Kitos pajamos	4	3 520 279	28 479 471
III.	IŠ VISO SUMAŽĖJIMO		635 347 690	105 925 025
1	Pensijų išmokos		1 508 296	961 726
2	Į kitus pensijų fondus pervestos sumos		39 010 856	28 503 189
3	Investicijų pardavimo nuostoliai		11 962 303	8 358 827
4	Investicijų vertės sumažėjusi dalis		449 087 726	28 360 548
5	Turto vertės sumažėjimas dėl užsienio valiutų kursų pasikeitimo		122 403 724	13 241 726
6	Valdymo sąnaudos	5	9 944 063	10 028 929
7	Kitos sąnaudos	6	1 430 722	16 470 080
IV.	GRYŪŲ AKTYVAI ATASKAITINIO LAIKOTARPIO PABAIGOJE		853 877 362	726 567 735

		2010 12 31	2009 12 31	2008 12 31
V.	APSKAITOS VIENETO VERTĖ	1,3645	1,2292	0,9860
VI.	APSKAITOS VIENETŲ SKAIČIUS	625 794 232	591 085 954	482 656 580

18 – 27 puslapiuose pateiktas aiškinamasis raštas yra neatskiriama šių finansinių ataskaitų dalis.

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

AIŠKINAMASIS RAŠTAS

Bendroji informacija

Valstybinio socialinio draudimo įmokos dalies kaupimo pensijų fondo *Pensija 2* (toliau – Fondas) taisyklės Nr. PF-V02-K001-001(007) patvirtino Lietuvos Respublikos vertybinių popierių komisija 2003 m. rugpjūčio 28 d. (paskutiniai pakeitimai įsigaliojo – 2010 m. vasario 21 d.). 2006 m. vasario 23 d. Pensijų fondo pavadinimas pakeistas į *SEB Pensija 2*.

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

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

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

Apskaitos principai

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

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.

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

Finansiniai pensijų fondo metai sutampa su kalendoriniais metais.

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

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

(a) Investavimo politika

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

Bendrovė fondo turtą investuoja pagal tokią politiką ir principus:

1. Siekdama padidinti fondo turto pelningumą, bendrovė į akcijų turto klasę investuoja nuo 20 iki 60 proc. fondo turto;
2. Siekdama užtikrinti stabilų fondo turto pelningumą, bendrovė į obligacijų turto klasę investuoja nuo 40 iki 80 proc. fondo turto;
3. siekdama išnaudoti kitų turto klasių suteikiamas galimybes, bendrovė į pastarąsias investuoja iki 10 proc. fondo turto;
4. Bendrovė neapsiriboja investicijomis į konkrečių valstybių vyriausybių ir centrinių bankų išleistus ar jų garantuotus skolos VP.

Investiciniai sprendimai dėl fondo turto valdymo priimami remiantis Bendrovės Investicinių sprendimų priėmimo tvarka.

(b) Finansinės rizikos valdymo politika

Su Fondo investicijomis yra susijusi ši rizika:

- 1. VP pasirinkimo ir kainų kitimo rizika.** Tai yra rizika, kad VP kainos keisis dėl besikeičiančios situacijos rinkoje ar naujos informacijos apie šiuos VP. Įsigytų VP kainos pokytis gali skirtis nuo prognozuoto kainos pokyčio. Jei įsigytų VP kainos pokytis neatitinka prognozuoto kainos pokyčio, sumažinamas ar padidinamas VP lyginamasis svoris fondo investicijų portfelyje. Bendrovė valdo VP pasirinkimo ir kainų kitimo riziką laikydama taisyklių 9 straipsnyje nustatytų fondo investicijų portfelio diversifikavimo reikalavimų;
- 2. turto paskirstymo rizika.** Tai yra investicijų paskirstymo tarp nuosavybės ir skolos VP rizika. Bendrovė, įvertinusi pasaulio šalių ekonomikos augimo perspektyvas, priima sprendimą, kokią fondo turto dalį skirti akcijų rinkoms, fiksuoto pajamingumo investicijų priemonėms ir kitoms investicijoms; fondo turtas, investuojamas į akcijas ar kolektyvinius investavimo subjektus, investuojančius į akcijas, paskirstomas įvairiuose pasaulio geografiniuose regionuose ir ekonomikos sektoriuose;
- 3. palūkanų normų rizika.** Taisyklėse nustatyti investavimo objektai, kaip ir daugelis skolos VP, susiję su rizika, kad VP vertė gali sumažėti ar padidėti dėl pasikeitusių palūkanų normų, t. y. investicijų vertė mažėja didėjant palūkanų normoms, ir atvirkščiai, investicijų vertė didėja, kai palūkanų normos mažėja. Valdydama šią riziką, bendrovė gali naudoti išvestines finansines priemones ir keisti vidutinę fondo obligacijų finansinę trukmę;
- 4. rinkų ir kredito rizika.** Nors konkretūs VP gali suteikti galimybę gauti didesnę investicijų grąžą negu visa rinka ar susijęs rinkos segmentas, visos rinkos vertė gali sumažėti ar padidėti dėl besikeičiančių palūkanų normų, naujo priežiūros institucijų nustatyto reglamentavimo, pasikeitusių ekonomikos sąlygų. VP kreditingumo kokybė priklauso nuo emitento sugebėjimo laiku mokėti palūkanas ir suėjus terminui išpirkti emisiją. Kuo mažesnis emitentui suteiktas kredito reitingas, tuo didesnė rizika, kad emitentas neįvykdys savo įsipareigojimų fondo dalyviams. VP kreditingumo rizika taip pat priklauso ir nuo banko, laiduojančio už konkrečius skolos VP, finansinio pajėgumo. Valdydama šią riziką, bendrovė gali naudoti išvestines finansines priemones, kurių vertė kinta kartu su emitento kreditingumo kokybe arba keisti skolos VP dalį fonde;
- 5. valiutų kursų svyravimų rizika.** Jei investuojama į VP užsienio valiuta, tai, keičiantis valiutos, kuria investuota, kursui lito atžvilgiu, kinta ir investicijų vertė. Bendrovė, valdydama valiutų kursų svyravimo riziką, turi teisę naudoti išvestines finansines priemones;
- 6. infliacijos/perkamosios galios rizika.** Infliacijos tempams spartėjant skolos VP atkarpų ir pagrindinės sumos perkamoji vertė ir kaina paprastai mažėja. Valdant šią riziką, bendrovė gali naudotis išvestinėmis finansinėmis priemonėmis, kurių vertė kinta kartu su infliacijos augimo pokyčiu, gali investuoti į obligacijas, kurių vertė yra susijusi su infliacijos tempais arba keisti obligacijų dalį fonde bei keisti vidutinę fondo obligacijų finansinę trukmę;
- 7. rizika, susijusi su VPK nereguliuojamų VP įsigijimu, apskaita ir nuosavybės teise į juos.** Galima didesnė šių VP rizika, palyginti su VP, reguliuojamais VPK, dėl informacijos apie šiuos VP trūkumo ar vėlavimo, kiekvienos šalies skirtingo teisinio reglamentavimo, skirtingų VP apskaitos standartų ir galimo papildomo apmokestinimo toje valstybėje, kurioje VP buvo išleisti. Bendrovė valdo šių VP riziką vertindama jų reguliavimo, apmokestinimo ir apskaitos ypatumus.

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

Pastarojo meto pasaulio ir Lietuvos finansų rinkų svyravimai

Besitęsianti pasaulinė likvidumo krizė, kuri prasidėjo 2008 m. viduryje, lėmė daugelio problemų atsiradimą, įskaitant mažesnę kapitalo rinkos finansavimą, žemesnę likvidumo lygį bankininkystės sektoriuje ir kartais didesnes tarpbankinio skolinimosi normas ir ypač didelius svyravimus vertybinių popierių rinkose. Nors pasaulio ekonomikoje ir stebima atsigavimo ženklų, situacija finansų sektoriuje vis dar yra labai jautri.

Vadovybė negali patikimai nustatyti, kokią įtaką Fondo finansinei būklei turės tolesnis finansų rinkų likvidumo mažėjimas ir svyravimų didėjimas valiutos ir nuosavybės vertybinių popierių rinkose. Vadovybė mano, kad

dabartinėmis sąlygomis taikomos visos būtinos priemonės Fondo veiklos stabilumui ir plėtrai užtikrinti.

(c) Turto padidėjimo ir sumažėjimo pripažinimo principai

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

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

Išvestinės finansinės priemonės balanse parodomos kaip turtas, jeigu tikroji vertė yra teigiama, arba kaip išipareigojimas, 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.

(d) Atskaitymų valdymo įmonei ir depozitoriumui taisyklės

Iš pensijų fondo turto galima daryti tik tokius atskaitymus, kurie yra susiję su Fondo valdymu ir yra nustatyti Fondo taisyklėse. Visos kitos taisyklėse nenumatytos arba nustatytus dydžius viršijančios išlaidos dengiamos iš valdymo įmonės.

Atskaitymai iš pensijų fondo turto pagal kiekvieną pensijų kaupimo sutartį su valdymo įmone per metus yra:

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

2010 m. ir 2009 m. taikomi atitinkamai 1 ir 3 proc. dydžio mokesčiai

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

Atskaitymai depozitoriumui mokami iš valdymo įmonės.

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

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

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

Pagal SEB investicijų valdymo valdybos sprendimą (2010-01-18), II pakopos pensijų fondų dalyviams išeinantiems į kitą bendrovę nuo 2010-01-27 d. pradedamas taikyti išėjimo mokestis.

Išėjimo mokesčio patvirtintas dydis yra "iki 0,2 procento" nuo pervedamų lėšų.

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

(e) Investicijų įvertinimo metodai, investicijų pervaldinimo periodiškumas

Į balansą traukiama investicijų ataskaitinio laikotarpio pabaigos tikroji vertė.

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

1. priemonės yra kotiruojamos keliose reguliuojamose rinkose; tuo atveju jų tikrajai vertei nustatyti naudojama tos reguliuojamos rinkos, kurios prekybai šiomis priemonėmis būdingas didesnis likvidumas, reguliarumas ir dažnumas, duomenys;
2. pagal šio straipsnio 1 punkte pateiktą kriterijų neįmanoma pagrįstai pasirinkti rinkos, kurios duomenimis remiantis turi būti nustatoma priemonės tikroji vertė; tuo atveju jai nustatyti naudojama reguliuojamos rinkos, kurioje yra priemonės emitento buveinė, duomenys;
3. per paskutinę prekybos sesiją priemonė nebuvo kotiruojama; tuo atveju tikrajai vertei nustatyti naudojama paskutinė žinoma, tačiau ne daugiau kaip prieš 30 (trisdešimt) kalendorinių dienų buvusi vidutinė rinkos kaina arba uždarymo kaina, jei nuo paskutinės prekybos dienos neįvyko įvykių, dėl kurių dabartinė rinkos kaina yra reikšmingai mažesnė ar didesnė už paskutinę žinomą kainą;
4. priemonė nebuvo kotiruojama daugiau kaip 30 (trisdešimt) kalendorinių dienų iki vertinimo dienos arba buvo kotiruojama rečiau, nei nustatyta skaičiavimo procedūrose; tuo atveju jos vertė nustatoma kaip priemonių, kuriomis reguliuojamose rinkose neprekiuojama, vertė;
5. naudojantis *Bloomberg*, *Reuters* ar kitų tarptautinių naujienų agentūrų, informacijos šaltinių teikiamais pelningumo duomenimis ir/arba kainomis yra gaunamas tikslesnis priemonių vertinimas.

Jei gali būti gaunamas tikslesnis įvertinimas, tikroji vertė nustatoma remiantis pirminių dilerių (AB SEB banko, AB DnB NOR banko ir AB *Swedbanko*) skelbiamais pelningumo vidurkiais, atsižvelgiant į analogiškos trukmės, reitingo ir panašių išleidimo sąlygų vertybinių popierių vertę, pagal tikėtiną pardavimo kainą, naudojantis tarptautinių naujienų agentūrų, informacijos šaltinių teikiamais pelningumo duomenimis ir kainomis.

Investicijos vertinamos kiekvieną dieną. Vertybinių popierių ir kitų investicijų, turėtų ataskaitinio laikotarpio pradžioje, taip pat per ataskaitinį laikotarpį įsigytų vertybinių popierių ir kitų investicijų kiekvienos dienos vertės pokytis priskiriamas investicijų vertės padidėjusiai ar sumažėjusiai daliai. Pardavus investicijas, jų tikrosios vertės ir pardavimo kainos skirtumas parodomas „grynųjų aktyvų pokyčio ataskaitoje“ kaip „investicijų pardavimo pelnas“ arba „investicijų pardavimo nuostolis“.

Skolos vertybinių popierių tikroji vertė apima ir palūkanų pajamas.

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

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

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

(f) Išvestinės finansinės priemonės

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

Kiekvienos dienos tikrosios vertės pokytis, nustatytas vertinant iš išvestinės finansinės priemonės atsirandantį finansinį turtą ir finansinį įsipareigojimą, parodomas „grynųjų aktyvų pokyčio ataskaitoje“ kaip „kitos pajamos“ arba „kitos sąnaudos“. Pasibaigus iš išvestinės finansinės priemonės kylančioms teisėms ir įsipareigojimams, apskaitoje yra registruojamas gautas (gautinas) ar sumokėtas (mokėtinas) atlygis.

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

(g) Apskaitos vieneto vertės nustatymo taisyklės

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

Fondo apskaitos vienetai (jų dalys) neturi nominaliosios vertės.

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

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

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

(h) 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.

(i) Investicijų portfelio struktūra

Bendrovė, investuodama fondo turtą, laikosi šių diversifikavimo reikalavimų:

1. į vieno emitento VP ar pinigų rinkos priemones gali būti investuota ne daugiau kaip 5 proc. fondo turtą sudarančių grynujų aktyvų;
2. į vieno emitento VP ar pinigų rinkos priemones gali būti investuota daugiau kaip 5 proc., bet ne daugiau kaip 10 proc. grynujų aktyvų, su sąlyga, kad tokių investicijų bendra suma nebus didesnė kaip 40 proc. grynujų aktyvų (šis apribojimas netaikomas indėliams);
3. investicijos į Europos Sąjungos valstybės narės ar jų savivaldybių, kitos valstybės ar tarptautinės organizacijos, kuriai priklauso bent viena Europos Sąjungos valstybė, išleistus arba garantuotus vieno emitento VP ar pinigų rinkos priemones negali būti didesnės kaip 35 proc. fondo turtą sudarančių grynujų aktyvų;
4. investicijos į VP ar pinigų rinkos priemones gali sudaryti iki 100 proc. fondo turtą sudarančių grynujų aktyvų, jei:
 - 4.1. tokiu atveju dalyvių interesai būtų pakankamai apsaugoti;
 - 4.2. investuota į ne mažiau kaip 6 emisijų VP;
 - 4.3. į vienos emisijos VP investuota ne daugiau kaip 30 proc. grynujų aktyvų;
 - 4.4. gavus VPK leidimą.
5. investicijos į obligacijas, išleistas tokios Europos Sąjungos valstybėje registruotą buveinę turinčios kredito įstaigos negali būti didesnės kaip 25 proc. grynujų aktyvų;
6. bendra investicijų į VP suma gali sudaryti iki 80 proc. fondo turtą sudarančių grynujų aktyvų, jei į tokias vieno emitento obligacijas investuojama daugiau kaip 5 proc., bet ne daugiau kaip 25 proc. grynujų aktyvų;
7. ne daugiau kaip 20 proc. fondo grynujų aktyvų gali būti investuota į kolektyvinio investavimo subjekto investicinius vienetus ar akcijas;
8. investicijos į indėlius vienoje kredito įstaigoje negali sudaryti daugiau kaip 20 proc. fondo turtą sudarančių grynujų aktyvų.

Bendra investicijų į vieno emitento išleistus VP, pinigų rinkos priemones ar indėlius suma negali būti didesnė kaip 20 (dvidešimt) procentų fondo turtą sudarančių grynujų aktyvų.

Investicijų į vieno emitento išleistus VP, pinigų rinkos priemones, indėlius suma negali būti didesnė kaip 35 (trisdešimt penki) procentai fondo turtą sudarančių grynujų aktyvų.

Į įmonių, priklausančių grupei, kuri turi sudaryti konsoliduotą finansinę atskaitomybę, išleistus VP ir pinigų rinkos priemones gali būti investuojama ne daugiau kaip 20 (dvidešimt) procentų grynujų aktyvų.

(j) Finansiniai įsipareigojimai

Finansiniai įsipareigojimai apima mokėtinas sumas už gautas paslaugas bei įsipareigojimus kredito įstaigoms. Finansiniai įsipareigojimai apskaitoje registruojami tada, kai Fondas prisiima įsipareigojimą sumokėti pinigus ar atsiskaityti kitu finansiniu turtu. Mokėtinos sumos už paslaugas vertinamos įsigijimo savikaina. Įsipareigojimai kredito įstaigoms pradinio pripažinimo metu vertinami įsigijimo savikaina, o vėliau - amortizuota savikaina.

(k) Apskaitos politikos keitimas

Nuo 2010 m. sausio 01 d. vertybinių popierių pardavimo savikainos nurašymo būdas FIFO pakeistas į svertinio vidurkio būdą.

Nuo 2010 m. sausio 01 d. buvo atnaujinta fondų buhalterinės apskaitos sistema, dėl to buvo pakeista išvestinių finansinių priemonių apskaitos metodika, bei kitaip atvaizduojamos Investicijų vertės padidėjimo pajamos ir Investicijų vertės sumažėjimo sąnaudos Grynųjų aktyvų pokyčio ataskaitoje.

Pasikeitimai Grynųjų aktyvų pokyčio ataskaitoje aprašyti lentelėje:

GA pokyčio ataskaitos straipsnis	Pagal naują metodiką	Pagal seną metodiką	Metodikos pakeitimo rezultatas
Kitos pajamos	Kiekvieną dieną išvestinės finansinės priemonės įvertinamos tikrąja verte, stornuojami vakar dienos tikrosios vertės įrašai turto ir pajamų-sąnaudų sąskaitose. Jei tikroji IFP vertė yra teigiama turto sąskaitoje, tuomet atspindimos <i>Kitos pajamos Grynųjų aktyvų pokyčio ataskaitoje.</i>	Buvo kaupiamos kiekvienos dienos išvestinių finansinių priemonių vertės padidėjimo sumos iki priešpaskutinės išvestinės finansinės priemonės nurašymo dienos.	Lyginant su praėjusiais metais, žymiai sumažėja tiek Grynųjų aktyvų pokyčio ataskaitos padidėjimo, tiek sumažėjimo straipsnių apyvartos
Kitos sąnaudos	Kiekvieną dieną išvestinės finansinės priemonės įvertinamos tikrąja verte, stornuojami vakar dienos tikrosios vertės įrašai turto ir pajamų-sąnaudų sąskaitose. Jei tikroji IFP vertė yra neigiama turto sąskaitoje, tuomet atspindimos <i>Kitos sąnaudos Grynųjų aktyvų pokyčio ataskaitoje.</i>	Buvo kaupiamos kiekvienos dienos išvestinių finansinių priemonių vertės sumažėjimo sumos iki priešpaskutinės išvestinės finansinės priemonės nurašymo dienos.	
Investicijų vertės padidėjimo suma	Kaupiamos kiekvienos dienos nuosavybės ir skolos vertybinių popierių vertės padidėjimo sumos	Kaupiamos nuosavybės ir skolos vertybinių popierių vertės padidėjimo sumos paskaičiuojamos atskirai kiekvienam vertybiniam popieriui už ketvirtį, todėl eliminuojami kiekvienos dienos vertybinių popierių vertės svyravimai	Lyginant su praėjusiais metais, žymiai padidėja tiek Grynųjų aktyvų pokyčio ataskaitos padidėjimo, tiek sumažėjimo straipsnių apyvartos
Turto vertės padidėjimas dėl užsienio valiutų kursų pasikeitimo	Kaupiamos kiekvienos dienos nuosavybės ir skolos vertybinių popierių vertės padidėjimo dėl valiutos kurso pokyčio sumos	Kaupiamos nuosavybės ir skolos vertybinių popierių vertės padidėjimo dėl valiutos kurso pokyčio sumos paskaičiuojamos atskirai kiekvienam vertybiniam popieriui už ketvirtį, todėl eliminuojami kiekvienos dienos vertybinių popierių vertės svyravimai	
Investicijų vertės sumažėjimo suma	Kaupiamos kiekvienos dienos nuosavybės ir skolos vertybinių popierių vertės sumažėjimo sumos	Kaupiamos nuosavybės ir skolos vertybinių popierių vertės sumažėjimo sumos paskaičiuojamos atskirai kiekvienam vertybiniam popieriui už ketvirtį, todėl eliminuojami kiekvienos dienos vertybinių popierių vertės svyravimai	
Turto vertės sumažėjimas dėl užsienio valiutų kursų pasikeitimo	Kaupiamos kiekvienos dienos nuosavybės ir skolos vertybinių popierių vertės sumažėjimo dėl valiutos kurso pokyčio sumos	Kaupiamos nuosavybės ir skolos vertybinių popierių vertės sumažėjimo dėl valiutos kurso pokyčio sumos paskaičiuojamos atskirai kiekvienam vertybiniam popieriui už ketvirtį, todėl eliminuojami kiekvienos dienos vertybinių popierių vertės svyravimai	

Palyginamieji 2009 m. duomenys negali būti patikimai įvertinti, nes nėra pakankamo 2009 m. pirminių duomenų detalumo.

1 PASTABA

INVESTICIJŲ VERTĖS POKYTIS

(Lt)

Balanso straipsniai	Pokytis					
	praėjusio ataskaitinio laikotarpio pabaigoje	įsigyta	parduota (išpirkta)	vertės padidėjimas	vertės sumažėjimas	ataskaitinio laikotarpio pabaigoje
Skolos vertybiniai popieriai:	200 782 981	150 525 352	(105 731 497)	90 928 332	(77 087 663)	259 417 505
Vyriausybės ir centrinių bankų arba jų garantuoti skolos vertybiniai popieriai	185 439 542	145 502 272	(89 391 497)	89 898 393	(76 859 506)	254 589 204
Kiti skolos vertybiniai popieriai	15 343 439	5 023 080	(16 340 000)	1 029 939	(228 157)	4 828 301
Kolektyvinio investavimo subjektų investiciniai vienetai ir akcijos	470 669 959	450 221 826	(381 668 708)	571 802 083	(492 137 845)	618 887 315
Nuosavybės vertybiniai popieriai	-	-	-	-	-	-
Iš viso	671 452 940	600 747 178	(487 400 205)	662 730 415	(569 225 508)	878 304 820

2 PASTABA TURTO STRUKTŪRA ATASKAITINIO LAIKOTARPIO PABAIGOJE

Turto arba emitento pavadinimas	Valstybės, į kurios vertybinius popierius investuota, pavadinimas	Valiutos, kuria yra turtas, pavadinimas	Nominalioji vertė (jeigu ji yra)	Metų palūkanų norma (jeigu ji yra)	Indėlio, investicijos pabaigos terminas (jeigu ji terminuota)	Tikroji vertė (Lt)	Turto, investicijos lyginamoji dalis (proc.)
Pinigai						1 056 233	0,12
Sąskaita AB SEB banke		LTL	288 900	0,51		288 900	0,03
Sąskaita AB SEB banke		SEK	107 700			41 364	0,00
FUTURE SEB_956		EUR				329 041	0,04
FUTURE SEB_956		USD				396 928	0,05
Investicijos						878 304 820	99,87
Raffaisen-Eastern European Equities	AT	EUR				22 204 420	2,52
SEB Fund 1 - SEB North America Fund	LU	USD				61 778 569	7,02
SEB Sicav 1-SEB Eastern Europe ex Russia	LU	EUR				36 108 499	4,11
SEB Fund 2-SEB Russia Fund	LU	EUR				38 095 258	4,33
East Capital Russian Fund	SE	SEK				12 357 183	1,40
Eaton Vance Int.-US Value Fund Registered SharesI2	IE	USD				30 362 262	3,45
T ROWE PRICE-US LG CP GRW-A	LU	USD				29 819 681	3,39
FAST JAPAN FUND -Y	LU	JPY				22 398 528	2,55
Comgest Growth AS X JPN-USD	IE	USD				13 733 335	1,56

Turto arba emitento pavadinimas	Valstybės, į kurios vertybinius popierius investuota, pavadinimas	Valiutos, kuria yra turtas, pavadinimas	Nominalioji vertė (jeigu ji yra)	Metų palūkanų norma (jeigu ji yra)	Indėlio, investicijos pabaigos terminas (jeigu ji terminuota)	Tikroji vertė (Lt)	Turto, investicijos lyginamoji dalis (proc.)
T ROWE PRICE-ASIAN EX JAPAN JPN-I	LU	USD				16 617 307	1,89
IShares MSCI Australia Index Fund	US	USD				7 484 406	0,85
Investec GS Asian Equity-A A	LU	USD				18 623 957	2,12
BGF-Latin American Fund-\$D2	LU	USD				13 224 976	1,50
TT European Equity A	IE	EUR				15 490 398	1,76
Odey Allegra European Fund	IE	EUR				16 019 945	1,82
GLG European Equity S	IE	EUR				17 517 498	1,99
JOHCM European Select Val Inst EUR	IE	EUR				17 972 563	2,04
JB Commodity Fund EUR-C	LU	EUR				17 710 822	2,01
EEREIF	EE	EUR				2 780 811	0,32
KEY HEDGE Fund INC-B EUR	BM	EUR				16 615 817	1,89
Vontobel Fund-Belvista Commodity I	LU	USD				17 257 960	1,96
SEB Fund 5 - SEB Corporate Bond Fund EUR	LU	EUR				8 948 862	1,02
SEB Eastern Europe Bond Fund	EE	EUR				18 418 408	2,09
JB Euro Government Bond Fund - C	LU	EUR				17 803 319	2,02
HSBC GIF-EUR COR CRD BD-IC	LU	EUR				20 766 404	2,36
PICTET FUND-EUR CORP BON	LU	EUR				19 575 798	2,23
BlueBay Investment Grade Bond Fund I - Base EUR	LU	EUR				22 525 756	2,56
Raiffeisen Eastern European Bond Fund	AT	EUR				35 837 081	4,07
Schroders Euro Corporate Bond Fund	LU	EUR				15 094 824	1,72
Generali Investments SICAV - Central and Eastern European Bond Fund	LU	EUR				15 742 666	1,79
DnB NORD bankas 3,5% 10/2013	LT	LTL	4 700 000	3,50	2013 10 07	4 828 301	0,55
SLOVAK 4,5% 05/2014	SL	EUR	9 322 560	4,50	2014 05 20	10 137 334	1,15
LITHUANIA 5,875% 05/2012	LT	EUR	1 056 557	5,88	2012 05 10	1 147 037	0,13
GERMANY 3,750% 01/2015	DE	EUR	459 222	3,75	2015 01 04	514 418	0,06
FRANCE 5,5% 04/2029	FR	EUR	15 123 264	5,50	2029 04 25	19 036 177	2,16
Netherlands 3,25% 07/2015	NL	EUR	5 351 840	3,25	2015 07 15	5 741 899	0,65
GERMANY 3,75% 01/2017	DE	EUR	690 560	3,75	2017 01 04	773 899	0,09
LITHUANIA 4,85% 02/2018	LT	EUR	12 671 776	4,85	2018 02 07	13 169 347	1,50
SLOVAK 4,375% 05/2017	SL	EUR	13 811 200	4,38	2017 05 15	14 759 502	1,68
SLOVENIA 4% 03/2018	SL	EUR	8 908 224	4,00	2018 03 22	9 180 515	1,04
Belgium Kingdom 5% 09/2012	BE	EUR	2 416 960	5,00	2012 09 28	2 573 728	0,29

Turto arba emitento pavadinimas	Valstybės, į kurios vertybinius popierius investuota, pavadinimas	Valiutos, kuria yra turtas, pavadinimas	Nominalioji vertė (jeigu ji yra)	Metų palūkanų norma (jeigu ji yra)	Indėlio, investicijos pabaigos terminas (jeigu ji terminuota)	Tikroji vertė (Lt)	Turto, investicijos lyginamoji dalis (proc.)
CZECH REPUBLIC 5% 06/2018	CZ	EUR	6 905 600	5,00	2018 06 11	7 660 535	0,87
POLAND 5,625% 06/2018	PL	EUR	6 905 600	5,63	2018 06 20	7 773 343	0,88
Belgium Kingdom 3,75% 09/2015	BE	EUR	4 557 696	3,75	2015 09 28	4 718 360	0,54
GERMANY 3,75% 01/2019	DE	EUR	2 071 680	3,75	2019 01 04	2 299 861	0,26
FRANCE 4% 04/2014	FR	EUR	7 423 520	4,00	2014 04 25	8 211 639	0,93
RUSSIA 7,50% 03/2030	RU	USD	9 343 442	7,50	2030 03 31	10 989 161	1,25
LITHUANIA 9,375% 06/2014	LT	EUR	5 179 200	9,38	2014 06 22	6 334 210	0,72
AUSTRIA 3,8% 10/2013	AT	EUR	5 869 760	3,80	2013 10 20	6 308 269	0,72
FRANCE 4,75% 10/2012	FR	EUR	11 048 960	4,75	2012 10 25	11 897 961	1,35
AUSTRIA 6,25% 07/2027	AT	EUR	6 905 600	6,25	2027 07 15	9 215 002	1,05
LITHUANIA 6,75% 01/2015	LT	USD	3 131 880	6,75	2015 01 15	3 496 105	0,40
AUSTRIA 5% 07/2012	AT	EUR	8 632 000	5,00	2012 07 15	9 370 861	1,07
VVP 60021 07/2011	LT	EUR	12 088 598	0,00	2011 07 07	12 009 082	1,37
VVP 60195 01/2011	LT	LTL	10 000 000	0,00	2011 01 12	9 998 882	1,14
VVP 60322 7,60% 10/2012	LT	LTL	7 364 200	7,60	2012 10 29	8 097 777	0,92
LITHUANIA 7,375% 02/2020	LT	USD	6 785 740	7,38	2020 02 11	7 732 052	0,88
Belgium Kingdom 4% 03/2019	BE	EUR	2 416 960	4,00	2019 03 28	2 526 071	0,29
GERMANY 4,5% 01/2013	DE	EUR	1 381 120	4,50	2013 01 04	1 543 213	0,18
FRANCE 4% 04/2055	FR	EUR	8 804 640	4,00	2055 04 25	9 236 730	1,05
VVP 60510 4,9% 04/2015	LT	LTL	1 985 000	4,90	2015 04 29	2 109 158	0,24
VVP 60199 05/2011	LT	LTL	7 500 000	0,00	2011 05 04	7 470 368	0,85
VVP 60198 04/2011	LT	LTL	1 200 000	0,00	2011 04 20	1 195 815	0,14
LITHUANIA 5,125% 09/2017	LT	USD	8 612 670	5,13	2017 09 14	8 647 905	0,98
SLOVENIA 4,25% 02/2012	SL	EUR	5 869 760	4,25	2012 02 05	6 287 543	0,71
Netherland 4% 07/2019	NL	EUR	9 667 840	4,00	2019 07 15	10 564 904	1,20
VVP 60028 04/2012	LT	EUR	1 918 376	0,00	2012 04 25	1 860 543	0,21
Pretenzijos dėl išvestinių finansinių priemonių:						24 411	0,00
FUTURE_SCHATZ_EUREX		EUR			2011 03 11	2 175	0,00
FUTURE_BUXL_EUREX		EUR			2011 03 11	22 236	0,01
Kitos gautinos sumos						150 383	0,01
Gautinos palūkanos už a/s likučius		LTL				1 446	0,00
Gautinos palūkanos už a/s likučius		EUR				1 438	0,00
Gautinos palūkanos už a/s likučius		USD				214	0,01
Gautini dividendai		USD				129 174	0,00
Kt. gautinos sumos		LTL				16 189	0,00
Kt. gautinos sumos		EUR				995	0,00
Kt. gautinos sumos		USD				927	0,00
Iš viso						879 535 847	100,00

3 PASTABA ĮSIPAREIGOJIMAI KREDITO ĮSTAIGOMS**(Lt)**

Straipsnis	Valiuta	Suma valiuta	Suma litais	Palūkanų norma %
Sąskaitos kredito perviršio limitas	EUR	2 733 941	9 439 752	1,3563
Sąskaitos kredito perviršio limitas	USD	5 576 602	14 554 375	1,0019
Iš viso			23 994 127	

4 PASTABA KITOS PAJAMOS**(Lt)**

Straipsnis	2010 01 01 – 2010 12 31	2009 01 01 – 2009 12 31
Valiutos pirkimo ir pardavimo pajamos	641 047	446 606
Gauta retrocesija	2 128 943	1 393 448
Išvestinių finansinių priemonių pajamos	750 289	26 639 417
Iš viso	3 520 279	28 479 471

Straipsnyje „Išvestinių finansinių priemonių pajamos“ reikšmė 2010 m žymiai skiriasi nuo 2009 m. reikšmės dėl apskaitos politikos pakeitimo, paminėto aukščiau. Palyginamųjų duomenų neįmanoma perskaičiuoti dėl nepakankamo 2009 m. duomenų detalumo.

5 PASTABA VALDYMO SĄNAUDOS**(Lt)**

Straipsnis	2010 01 01 – 2010 12 31	2009 01 01 – 2009 12 31
Turto valdymo mokestis	7 836 323	5 992 678
Platinimo ir išpirkimo mokesčiai	2 107 740	4 036 251
Iš viso	9 944 063	10 028 929

6 PASTABA KITOS SĄNAUDOS**(Lt)**

Straipsnis	2010 01 01 – 2010 12 31	2009 01 01 – 2009 12 31
Kitos sąnaudos	-	40
Valiutos pirkimo ir pardavimo sąnaudos	381 719	158 172
Išvestinių finansinių priemonių sąnaudos	1 049 003	16 311 868
Iš viso	1 430 722	16 470 080

Straipsnyje „Išvestinių finansinių priemonių sąnaudos“ reikšmė 2010 m žymiai skiriasi nuo 2009 m. reikšmės dėl apskaitos politikos pakeitimo, paminėto aukščiau. Palyginamųjų duomenų neįmanoma perskaičiuoti dėl nepakankamo 2009 m. duomenų detalumo.

VII. INFORMACIJA APIE PENSIJŲ FONDO DALYVIUS

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

Dalyvių skaičius ataskaitinio laikotarpio pradžioje		174 152
Dalyvių skaičius ataskaitinio laikotarpio pabaigoje	dalyviai, pasinaudoję teise nukelti pensijų išmokos mokėjimą	327
	dalyviai, gaunantys periodines pensijų išmokas	0
	kiti dalyviai	175 177
	Iš viso	175 504
Dalyvių skaičiaus pokytis		1 352

25. Per ataskaitinį laikotarpį prisijungusių dalyvių skaičius:

Bendras prisijungusių dalyvių skaičius		9 824
Dalyviai, pensijų kaupimo sutartis sudarę pirmą kartą		5 652
Iš kitų pensijų fondų atėję dalyviai	iš tos pačios pensijų kaupimo bendrovės	159
	iš kitos pensijų kaupimo bendrovės	4 013

26. Per ataskaitinį laikotarpį pasitraukusių dalyvių skaičius:

Bendras pasitraukusių dalyvių skaičius		8 472
Į kitus pensijų fondus išėjusių dalyvių skaičius	valdomus tos pačios pensijų kaupimo bendrovės	280
	valdomus kitos pensijų kaupimo bendrovės	7 829
Baigusią dalyvavimą dalyvių skaičius	išstojusių (pildoma tik papildomo savanoriško pensijų kaupimo pensijų fondo atveju)	0
	sulaukusią nustatyto pensijos amžiaus ir pasinaudojusią teise į pensijų išmoką (vienkartinę išmoką, anuitetą ir jų derinį)	116
	dalyvių, pasinaudojusią Pensijų kaupimo įstatymo suteikta galimybe vienašališkai nutraukti pirmą kartą sudarytą sutartį	17
	mirusių dalyvių	230

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

		Dalyviai pagal amžių				
		iki 30	nuo 30 iki 45	nuo 45 iki 60	nuo 60	iš viso
Dalyvių skaičius	iš viso	37 147	88 787	48 686	884	175 504
	vyrai	19 537	44 516	23 354	673	88 080
	moterys	17 610	44 271	25 332	211	87 424
Dalyvių dalis, %	iš viso	100%	100%	100%	100%	100%
	vyrai	52,59%	50,14%	47,97%	76,13%	50,19%
	moterys	47,41%	49,86%	52,03%	23,87%	49,81%

VIII. IŠORINIAI PINIGŲ SRAUTAI

28. Per ataskaitinį laikotarpį faktiškai gautos lėšos:

Bendra gautų lėšų suma		88 135 769
Periodinės įmokos į pensijų fondą	iš Valstybinio socialinio draudimo fondo	68 067 283
	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	1 025 108
	iš kitos pensijų kaupimo bendrovės	19 043 094
Kitos gautos lėšos (nurodyti šaltinį ir gautų lėšų sumą), iš viso		284
	kompensavimas klientams	284
		-

29. Išmokėtos lėšos:

Bendra išmokėtų lėšų suma		40 519 152
Pensijų išmokos	vienkartinės išmokos dalyviams	692 775
	periodinės išmokos dalyviams	
	išmokos anuiteto įsigijimui	
Į kitus pensijų fondus pervestos lėšos	valdomus tos pačios pensijų kaupimo bendrovės	2 296 633
	valdomus kitos pensijų kaupimo bendrovės	36 714 223
Išstojusiems dalyviams išmokėtos lėšos (pildoma tik papildomo savanoriško kaupimo pensijų fondų atveju)		
Paveldėtojams išmokėtos lėšos		815 521
Kitais pagrindais išmokėtos lėšos (nurodyti šaltinį ir išmokėtų lėšų sumą), iš viso		

IX. INFORMACIJA APIE GARANTIJŲ REZERVĄ

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

-

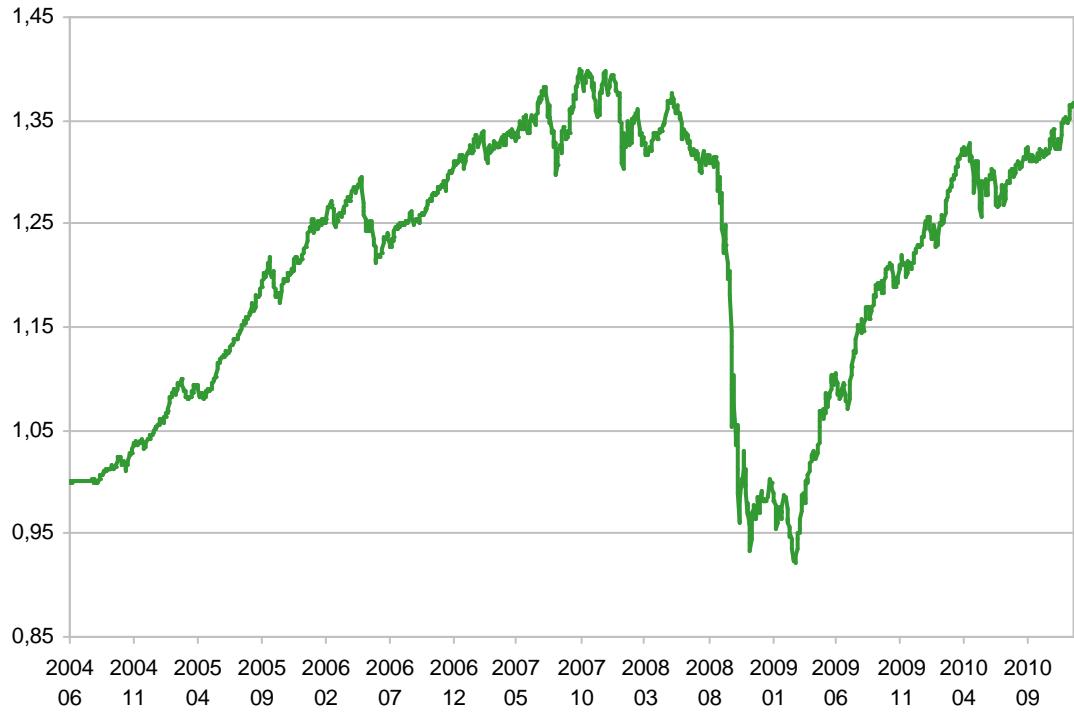
X. INFORMACIJA APIE PENSIJŲ FONDO REIKMĖMS PASISKOLINTAS LĖŠAS

31. Pensijų fondo reikmėms pasiskolintos lėšos ataskaitinio laikotarpio pabaigoje:

Eil. Nr.	Paskolos suma	Paskolos valiuta	Paskolos paėmimo data	Paskolos grąžinimo terminas	Palūkanų dydis	Skolinimosi tikslas	Kreditorius	Skolintų lėšų dalis, lyginant su fondo GA (%)
1.	9 439 752	EUR	2010 12 31	2011 01 04	1,3563	likvidumui palaikyti	AB SEB bankas	1,11
2.	14 554 375	USD	2010 12 31	2011 01 05	1,0019	likvidumui palaikyti	AB SEB bankas	1,70
Iš viso	23 994 127							2,81

XI. KITA INFORMACIJA

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



XII. ATSAKINGI ASMENYS

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

-

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

-

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

-

36. Asmenys, atsakingi už ataskaitoje pateiktą informaciją:

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

Tvirtinu _____ Vaiva Tylienė, l.e. generalinio direktoriaus pareigas,
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.

-