

2011 metų sausio – birželio mėnesių ataskaita

SEB pensija 2

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
IV. INFORMACIJA APIE PENSIJŲ FONDO INVESTICINIŲ PRIEMONIŲ PORTFELĮ	4
V. PENSIJŲ FONDO LYGINAMASIS INDEKSAS, INVESTICIJŲ GRAŽA IR RIZIKOS RODIKLIAI.....	5
VI. PENSIJŲ FONDO FINANSINĖ BŪKLĖ.....	6
VII. INFORMACIJA APIE PENSIJŲ FONDO DALYVIUS.....	29
VIII. IŠORINIAI PINIGŲ SRAUTAI.....	29
IX. INFORMACIJA APIE GARANTIJŲ REZERVĄ.....	30
X. INFORMACIJA APIE PENSIJŲ FONDO REIKMĖMS PASISKOLINTAS LĖŠAS	30
XI. KITA INFORMACIJA.....	30
XII. ATSAKINGI ASMENYS	31

PENSIJŲ FONDO *SEB PENSIIJA 2*
2011 M. SAUSIO-BIRŽELIO MĖNESIŲ ATASKAITA

I. BENDROJI INFORMACIJA

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

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

2. Ataskaitinis laikotarpis, už kurį pateikta ataskaita — 2011 m. I pusmetis.

3. Duomenys apie valdymo įmonę:

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

3.2. buveinė (adresas) — Gedimino pr. 20, Vilnius, Lietuvos Respublika;

3.3. telefono, fakso numeriai, el. pašto adresas, interneto svetainės adresas
tel. (8 5) 268 1594

faks. (8 5) 268 1575

e. paštas info.invest@seb.lt

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) — Gediminas Milieška, portfelio valdytojas.

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

AB SEB bankas

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

faks. (8 5) 268 1255

įmonės kodas 112021238

II. GRYNŲJŲ AKTYVŲ, APSKAITOS VIENETŲ SKAIČIUS IR VERTĖ

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

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

Atskaitymai	Taisyklėse nustatyti maksimalūs dydžiai	Faktiškai taikomi atskaitymų dydžiai	Per ataskaitinį laikotarpį priskaičiuota atskaitymų suma (Lt)
Nuo įmokų	3,00 proc.	3,00 proc.	1 237 950
Nuo turto vertės	1,00 proc.	1,00 proc.	4 281 187
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.	32 549
<i>pensijų kaupimo bendrovės keitimas daugiau kaip kartą per metus</i>	4,00 proc.	-	-
Iš viso			5 551 686

Atskaitymai	Taisyklėse nustatyti maksimalūs dydžiai	Faktiškai taikomi atskaitymų dydžiai	Per ataskaitinį laikotarpį priskaičiuota atskaitymų suma (Lt)
BAR *			-
Sąlyginis BIK ir (arba) tikėtinas sąlyginis BIK *			-
PAR (portfelio apyvartumo rodiklis)*			-

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

Bendras išlaidų koeficientas (BIK) – procentinis dydis, kuris parodo, kokia vidutinė fondo grynujų 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. IK-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 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 apsisaugoti nuo galimo fondo investicijų JAV doleriais nuvertėjimo.

Per ataskaitinį laikotarpį fondas sudarė obligacijų, kurių kainų pokytis priklauso nuo Vokietijos 2, 5, 10 arba 30 metų trukmės obligacijų kainų pokyčio, ateities sandorius (*schatz, bohl, bund* ir *buxl futures*). Sudarant šiuos sandorius, yra keičiama bendra fondo palūkanų normų rizika (obligacijų rinkos rizika). Norėdama valdyti šią riziką, valdymo įmonė riboja

fondo investicijų į skolos vertybinius popierius vidutinę finansinę trukmę nuo 0,5 iki 11 metų. Ši nuostata yra įtvirtinta fondo taisyklėse.

Ataskaitiniu laikotarpiu fondas sudarė ateities akcijų indeksų sandorius (*equity index futures*). Buvo sudaromi tik ateities sandoriai, kurių kaina priklauso nuo 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).

(Žr. 23.3. punktas, 7 PASTABA)

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

Ataskaitiniu laikotarpiu fondo investicijų portfelis atitiko taisyklėse nustatytą investicijų strategiją.

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

Ataskaitiniu laikotarpiu fondo investicijų portfelio vertės pokyčiams didžiausią įtaką turėjo:

1. Dėl JAV dolerio spartaus vertės, palyginti su euro verte, mažėjimo mažėjo investicijų JAV doleriais grąža, todėl mažėjo ir viso fondo grąža.
2. Žaliavų kainų mažėjimas. Žaliavų kainos po spartaus didėjimo 2010 metais antrajame 2011 metų ketvirtyje kito, o investuotojų noras rinktis rizikingas turto klases smarkiai sumažėjo. Žaliavų kainų mažėjimas turėjo neigiamą įtaką vieneto vertei.
3. Akcijų rinkų vertės didėjimas. Pirmą 2011 metų pusmetį, nors ir nesparčiai, tačiau akcijų kainos doleriais kilo, o ekonomikos rodikliai ir toliau rodė augančią ekonomiką. Akcijų kainų augimas sustojo antrame ketvirtyje, kai ateities tendencijos rodikliai pablogėjo.
4. 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.
5. Įmonių obligacijų brangimas. 2011 metų pirmą pusmetį įmonių obligacijos toliau brango. Tą lėmė gerėjanti įmonių finansinė padėtis.

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

VI. PENSIJŲ FONDO FINANSINĖ BŪKLĖ

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

23.1. grynujų aktyvų ataskaitą;

GRYNUJŲ AKTYVŲ ATASKAITA (LT)

2011 m. birželio 30 d.

Eil. nr.	Straipsniai	Pastabos Nr.	Finansiniai metai 2011 06 30	Praėję finansiniai metai 2010 12 31
A.	TURTAS		871 927 816	879 535 847
I.	PINIGAI	4	4 209 422	1 056 233
II.	TERMINUOTIEJI INDĖLIAI		-	-
III.	PINIGŲ RINKOS PRIEMONĖS		-	-
III.1.	Valstybės išdo vekseliai		-	-
III.2.	Kitos pinigų rinkos priemonės		-	-
IV.	PERLEIDŽIAMIEJI VERTYBINIAI POPIERIAI	3, 4	867 567 182	878 304 820
IV.1.	Ne nuosavybės vertybiniai popieriai		277 788 328	259 417 505
IV.1.1.	Vyriausbių ir centrinių bankų arba jų garantuoti ne nuosavybės vertybiniai popieriai		272 897 799	254 589 204
IV.1.2.	Kiti ne nuosavybės vertybiniai popieriai		4 890 529	4 828 301
IV.2.	Nuosavybės vertybiniai popieriai		-	-
IV.3.	Kitų kolektyvinio investavimo subjektų investiciniai vienetai ir akcijos		589 778 854	618 887 315
V.	GAUTINOS SUMOS	4	20 505	150 383
V.1.	Investicijų pardavimo sandorių gautinos sumos		-	-
V.2.	Kitos gautinos sumos		20 505	150 383
VI.	INVESTICINIS IR KITAS TURTAS	4	130 707	24 411
VI.1.	Investicinis turtas		-	-
VI.2.	Išvestinės finansinės priemonės		130 707	24 411
VI.3.	Kitas turtas		-	-
B.	ĮSIPAREIGOJIMAI	4	1 876 436	25 658 485
I.	Finansinio ir investicinio turto pirkimo įsipareigojimai		-	-
II.	Įsipareigojimai kredito įstaigoms		-	23 994 127
III.	Įsipareigojimai pagal išvestinių finansinių priemonių sutartis		139 355	539 322
IV.	Valdymo įmonei ir depozitoriumui mokėtinos sumos		757 147	768 047
V.	Kitos mokėtinos sumos ir įsipareigojimai		979 934	356 989
C.	GRYNIEJI AKTYVAI		870 051 380	853 877 362

8 – 29 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		853 877 362	726 567 735
II.	GRYNUJŲ AKTYVŲ VERTĖS PADIDĖJIMAS		111 903 173	90 516 008
II.1.	Dalyvių įmokos į fondą		41 263 744	34 109 082
II.2.	Iš kitų fondų gautos sumos		8 240 771	13 373 908
II.3.	Garantinės įmokos		-	-
II.4.	Palūkanų pajamos		4 384 796	4 523 589
II.5.	Dividendai		460 168	-
II.6.	Pelnas dėl investicijų vertės pasikeitimo ir pardavimo		54 953 959	33 938 140
II.7.	Pelnas dėl užsienio valiutos kursų pokyčio		1 248 413	2 171 758
II.8.	Išvestinių finansinių priemonių pelnas		507 564	1 335 622
II.9.	Kitas grynujų aktyvų vertės padidėjimas		843 758	1 063 909
	PADIDĖJO IŠ VISO:		111 903 173	90 516 008
III.	GRYNUJŲ AKTYVŲ VERTĖS SUMAŽĖJIMAS		95 729 155	42 545 320
III.1.	Išmokos fondo dalyviams		1 757 789	659 309
III.2.	Išmokos kitiems fondams		17 472 249	22 670 027
III.3.	Nuostoliai dėl investicijų vertės pasikeitimo ir pardavimo		70 295 681	11 477 217
III.4.	Nuostoliai dėl užsienio valiutos kursų pokyčio		651 750	1 471 646
III.5.	Išvestinių finansinių priemonių sandorių nuostoliai		-	1 485 915
III.6.	Valdymo sąnaudos:		5 551 686	4 781 206
III.6.1.	Atlyginimas valdymo įmonei		5 551 686	4 781 206
III.6.2.	Atlyginimas depozitoriumui		-	-
III.6.3.	Atlyginimas tarpininkams		-	-
III.6.4.	Audito sąnaudos		-	-
III.6.5.	Kitos sąnaudos		-	-
III.7.	Kitas grynujų aktyvų vertės sumažėjimas		-	-
III.8.	Sąnaudų kompensavimas (-)		-	-
III.9.	Pelno paskirstymas		-	-
	SUMAŽĖJO IŠ VISO:		95 729 155	42 545 320
IV.	GRYNUJŲ AKTYVŲ VERTĖ ATASKAITINIO LAIKOTARPIO PABAIGOJE		870 051 380	774 538 423

8 – 29 puslapiuose pateiktas aiškinamasis raštas yra neatskiriama šių finansinių ataskaitų dalis.

AIŠKINAMASIS RAŠTAS

Bendroji informacija

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

Pensijų fondą *SEB pensija 2* valdo UAB *SEB investicijų valdymas* (toliau - Bendrovė), įsteigta ir įregistruota 2000 m. gegužės mėn. 3 d., įmonės kodas 125277981. 2003 m. rugpjūčio mėn. 28 d. Lietuvos Respublikos Vertybinių popierių komisijos sprendimu Bendrovei išduota valdymo įmonės, veikiančios pagal Lietuvos Respublikos Kolektyvinio investavimo subjektų įstatymą, veiklos licencija Nr. 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, 39-ojo verslo apskaitos standartu „Kolektyvinio investavimo subjektų ir pensijų fondų apskaita, finansinės ataskaitos“, bendraisiais apskaitos principais, nustatytais verslo apskaitos standartuose ir kitais teisės aktais.

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

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

Pensijų fondo apskaita tvarkoma atskirai nuo Bendrovės ir 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) Turto padidėjimo ir sumažėjimo traukimo į apskaitą 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 grynųjų aktyvų ataskaitoje parodomos kaip turtas, jeigu tikroji vertė yra teigiama, arba kaip išpareigojimas, jeigu tikroji vertė neigiama. Išvestinių finansinių priemonių vertės padidėjusi dalis yra traukiama į išvestinių finansinių priemonių pelną, o vertės sumažėjusi dalis į išvestinių finansinių priemonių sandorių nuostolius.

Avanso sumokėjimas traukiamas į apskaitą gautinų sumų sąskaitoje. Šio straipsnio padidėjusi ar sumažėjusi vertės dalis traukiama į apskaitą, jei atsiskaitoma užsienio valiuta dėl oficialaus lito ir Lietuvos banko skelbiamo lito ir užsienio valiutos santykio pasikeitimo. Sumažėjusi vertės dalis traukiama į apskaitą gavus prekes ar pasinaudojus paslaugomis arba nebesitikint atgauti sumokėtų sumų.

b) Grynujų aktyvų vertės ir vienetų vertės apskaičiavimo principai

Apskaičiuojant fondo grynujų aktyvų (toliau – GA) 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 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. gryniesi 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 „Swebank“ 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 matematinės apvalinimo taisykles.

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

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

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

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

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

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 2* per ataskaitinį laikotarpį taikė tris mokesčius:

įmokos mokesčių – 3 proc., kuris yra vienkartinis ir išskaičiuojamas iš kiekvienos gautos įmokos iš „Sodros“. Įmokos mokesčiai neskaičiuojamas nuo gautų įmokų iš kitų pensijų fondų ar kitų pensijų kaupimo bendrovių;

turto valdymo mokesčių – 1 proc. nuo pensijų sąskaitoje esančių lėšų vidutinės metinės vertės. Turto valdymo mokesčiai išskaičiuojamas kiekvieną darbo dieną;

bendrovės keitimo mokesčių – iki 0,2 proc. iš pervedamų į kitą bendrovę dalyvio lėšų išskaičiuojamos išlaidos, susijusios su dalyvio sąskaitos uždarymu ir lėšų pervedimu.

d) Pinigų ekvivalentai

Pinigų ekvivalentams priskiriamos trumpalaikės (iki trijų mėnesių) likvidžios investicijos, kurios gali būti greitai iškeičiamos į pinigų sumas ir kurių vertės pasikeitimo rizika yra nereikšminga. 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**GRYNUJŲ AKTYVŲ, APSKAITOS VIENETŲ SKAIČIUS IR VERTĖ**

	Ataskaitinio laikotarpio pradžioje (2011 01 03)	Ataskaitinio laikotarpio pabaigoje (2011 06 30)	Prieš metus (2010 06 30)	Prieš dvejus metus (2009 06 30)
Grynujų aktyvų vertė (Lt)	854 127 816	870 051 380	774 538 423	615 095 661
Investicinio vieneto (akcijos) vertė (Lt)	1,3653	1,3445	1,2723	1,0963
Investicinių vienetų (akcijų), esančių apyvartoje, skaičius	625 612 919	647 122 119	608 790 189	561 063 612

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

2011 01 03 – 2011 06 30

	Apskaitos vienetų skaičius	Vertė (Lt)
Išplatinta (konvertuojant pinigines lėšas į investicinius vienetus)	35 631 590	49 543 576
Išpirkta (konvertuojant investicinius vienetus į pinigines lėšas)	14 303 704	19 269 099

2010 01 04 – 2010 06 30

	Apskaitos vienetų skaičius	Vertė (Lt)
Išplatinta (konvertuojant pinigines lėšas į investicinius vienetus)	35 921 385	47 482 989
Išpirkta (konvertuojant investicinius vienetus į pinigines lėšas)	18 217 150	23 329 336

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	259 417 505	92 872 792	-76 196 772	35 362 701	-33 667 898	277 788 328
Vyriausybių ir centrinių bankų arba jų garantuoti ne nuosavybės vertybiniai popieriai	254 589 204	92 872 792	-76 196 772	35 141 156	-33 508 581	272 897 799
Kiti ne nuosavybės vertybiniai popieriai	4 828 301	-	-	221 545	-159 317	4 890 529
Kitų kolektyvinio investavimo subjektų investiciniai vienetai ir akcijos	618 887 315	302 265 474	-363 075 590	261 276 473	-229 574 818	589 778 854
Iš viso:	878 304 820	395 138 266	-439 272 362	296 639 174	-263 242 716	867 567 182

4 PASTABA

INVESTICINIŲ PRIEMONIŲ PORTFELIO SUDĖTIS

2011 06 30

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

Emitento pavadinimas	Šalis	ISIN kodas	Kiekis (vnt.)	Bendra nominalioji vertė	Bendra įsigijimo vertė	Bendra rinkos vertė	Palūkanų norma	Išpirkimo / konvertavimo data	Dalis GA (%)
Ne nuosavybės vertybiniai popieriai, įtraukti į Oficialųjį ar jį atitinkantį prekybos sąrašą									
Iš viso:									
Ne nuosavybės vertybiniai popieriai, įtraukti į Papildomąjį ar jį atitinkantį prekybos sąrašą									
Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT1000600213	11 435	3 948 277	3 710 721	3 948 013	1,23	2011 07 07	0,45
Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT0000603227	92 142	9 214 200	9 637 817	10 291 856	2,50	2012 10 29	1,18
Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT0000605107	19 850	1 985 000	2 049 680	2 040 145	4,35	2015 04 29	0,23
DnB NORD bankas	LT	LT0000431132	47 000	4 700 000	4 686 817	4 890 529	2,83	2013 10 07	0,56
Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT1000600288	5 556	1 918 376	1 856 414	1 886 422	2,10	2012 04 25	0,22
Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT1000600296	43 804	15 124 645	14 615 174	14 772 905	2,25	2012 07 25	1,70
Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT0000600025	125 000	12 500 000	12 242 353	12 362 332	1,90	2012 02 01	1,42

Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT1000600304	27 969	9 657 136	9 320 560	9 353 461	2,48	2012 10 24	1,08
Iš viso:			372 756	59 047 634	58 119 535	59 545 663			6,84
Ne nuosavybės vertybiniai popieriai, kuriais prekiaujama kitose reguliuojamose rinkose									
Slovakijos Respublika	SK	XS0192595873	2 700	9 322 560	9 110 627	9 840 295	2,67	2014 05 20	1,13
Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	XS0147459803	306	1 056 557	1 113 433	1 101 396	1,85	2012 05 10	0,13
Nyderlandų Karalystė	NL	NL0000102283	920	3 176 576	3 440 493	3 510 701	2,58	2016 07 15	0,40
Vokietijos Federacine Respublika	DE	DE0001135267	133	459 222	449 285	495 500	1,95	2015 01 04	0,06
Prancūzijos Respublika	FR	FR0000571218	4 380	15 123 264	18 157 293	18 113 880	4,01	2029 04 25	2,08
Nyderlandų Karalystė	NL	NL0000102242	1 550	5 351 840	4 858 347	5 715 281	2,30	2015 07 15	0,66
Vokietijos Federacine Respublika	DE	DE0001135317	200	690 560	666 197	750 534	2,41	2017 01 04	0,09
Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	XS0327304001	3 670	12 671 776	12 417 080	13 132 975	4,55	2018 02 07	1,51
Slovakijos Respublika	SK	XS0299989813	4 000	13 811 200	13 420 343	14 444 393	3,61	2017 05 15	1,66
Slovėnijos Respublika	SI	XS0292653994	2 580	8 908 224	8 399 572	8 912 459	4,19	2018 03 22	1,02
Belgijos Karalyste	BE	BE0000298076	700	2 416 960	2 634 390	2 600 785	1,87	2012 09 28	0,30
Belgijos Karalyste	BE	BE0000306150	1 320	4 557 696	4 433 271	4 796 825	3,14	2015 09 28	0,55
Vokietijos Federacine Respublika	DE	DE0001135374	600	2 071 680	2 175 202	2 251 561	2,73	2019 01 04	0,26
Prancūzijos Respublika	FR	FR0010061242	575	1 985 360	2 117 724	2 110 218	1,96	2014 04 25	0,24
Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	XS0435153068	1 500	5 179 200	6 018 230	6 041 795	3,48	2014 06 22	0,69
Austrijos Respublika	AT	AT0000385992	1 700	5 869 760	6 317 447	6 283 227	1,84	2013 10 20	0,72
Prancūzijos Respublika	FR	FR0000188690	3 200	11 048 960	11 998 729	11 868 844	1,53	2012 10 25	1,36
Austrijos Respublika	AT	AT0000383864	2 000	6 905 600	8 589 876	9 259 289	3,87	2027 07 15	1,06
Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	XS0457764339	1 200	2 881 560	3 002 586	3 273 092	3,59	2015 01 15	0,38
Austrijos Respublika	AT	AT0000385356	500	1 726 400	1 873 662	1 870 606	1,55	2012 07 15	0,21
Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	XS0485991417	1 250	3 001 625	2 949 787	3 558 697	5,11	2020 02 11	0,41
Belgijos Karalyste	BE	BE0000315243	700	2 416 960	2 612 009	2 471 824	3,82	2019 03 28	0,28
Vokietijos Federacine Respublika	DE	DE0001135218	400	1 381 120	1 499 468	1 473 225	1,49	2013 01 04	0,17
Prancūzijos Respublika	FR	FR0010171975	2 550	8 804 640	8 744 768	8 468 827	4,23	2055 04 25	0,97
Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	XS0541528682	3 025	7 263 933	7 211 705	7 595 473	4,57	2017 09 14	0,87
Slovėnijos Respublika	SI	SI0002102919	1 700	5 869 760	6 113 296	6 060 737	1,65	2012 02 05	0,70
Nyderlandų Karalystė	NL	NL0009086115	2 800	9 667 840	11 027 219	10 647 522	3,11	2019 07 15	1,22
Vokietijos Federacine Respublika	DE	DE0001135366	1 900	6 560 320	7 969 414	7 991 190	3,77	2040 07 04	0,92
Vokietijos Federacine Respublika	DE	DE0001135424	1 250	4 316 000	4 075 573	4 217 971	2,96	2021 01 04	0,48
Vokietijos Federacine Respublika	DE	DE0001137321	2 800	9 667 840	9 632 003	9 660 477	1,51	2012 12 14	1,11
Vokietijos Federacine Respublika	DE	DE0001141596	3 400	11 739 520	11 528 963	11 724 900	2,24	2016 02 26	1,35
Slovėnijos Respublika	SI	SI0002103149	1 500	5 179 200	5 161 203	5 155 515	4,70	2021 01 18	0,59
Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	XS0602546136	675	1 620 878	1 591 248	1 758 273	5,26	2021 09 03	0,20

Slovėnijos Respublika	SI	SI0002102935	2 000	6 905 600	7 147 365	7 193 745	3,19	2014 04 02	0,83
Vokietijos Federacine Respublika	DE	DE0001135085	950	3 280 160	3 784 990	3 890 630	3,64	2028 07 04	0,45
Iš viso:			60 634	202 890 350	212 242 797	218 242 665			25,08
Išleidžiami nauji ne nuosavybės vertybiniai popieriai									
Iš viso:									
Iš viso ne nuosavybės vertybinių popierių:				261 937 984	270 362 332	277 788 328			31,93

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>Raiffeisen Eastern European Bond Fund</i>	AT	AT0000A0EYA2	19 044	<i>Raiffeisen Kapitalanlage-Gesellschaft m.b.H.</i>	14 181 221	15 219 023	IS Bloomberg	KIS 1	1,75
<i>BlueBay Investment Grade Bond Fund I - Base EUR</i>	LU	LU0225310266	48 030	<i>BlueBay Asset Managment PLC</i>	20 862 280	21 849 009	IS Bloomberg	KIS 1	2,51
<i>SEB Fund 5 - SEB Corporate Bond Fund EUR</i>	LU	LU0133008952	1 962 124	<i>SEB Asset Management S.A.</i>	8 286 720	9 089 101	E. pašto pranešimas	KIS 1	1,04
<i>Comgest Growth AS X JPN-USD</i>	IE	IE00B16C1G93	623 821	<i>Comgest Asset Management International</i>	20 858 632	21 615 865	IS Bloomberg	KIS 3	2,48
<i>CRM US Equity Opportunities-S</i>	IE	IE00B43N7R95	842 899	<i>Cramer Rosenthal McGlynn LLC ("CRM")</i>	24 153 683	24 098 379	http://www.ise.ie/app/showClass.asp	KIS 3	2,77
<i>Comstage ETF MSCI USA-I</i>	DE	LU0392495700	26 000	<i>Commerz Derivatives Funds Solutions</i>	1 899 878	1 969 458	IS Bloomberg	KIS 3	0,23
<i>SEB Sicav 1-SEB Eastern Europe ex Russia</i>	LU	LU0070133888	3 699 649	<i>SEB Asset Management S.A.</i>	33 859 613	39 647 124	E. pašto pranešimas	KIS 3	4,56
<i>SEB Eastern Europe Bond Fund</i>	EE	EE3600087532	460 442	<i>AS SEB Varahaldus</i>	16 070 095	18 356 002	IS Bloomberg	KIS 1	2,11
<i>HSBC GIF-EUR COR CRD BD-IC</i>	LU	LU0165125831	226 819	<i>HSBC Investment Funds (Luxembourg) S.A.</i>	15 812 063	16 269 351	IS Bloomberg	KIS 1	1,87
<i>FAST JAPAN FUND -Y</i>	LU	LU0348530451	77 584	<i>FIL Fund Management Limited</i>	17 358 090	16 173 084	IS Bloomberg	KIS 3	1,86
<i>Investec GS Asian Equity-A A</i>	LU	LU0345775950	469 168	<i>Investec Asset Management Guernsey L</i>	22 248 045	23 073 052	IS Bloomberg	KIS 3	2,65

<i>GLG European Equity S</i>	IE	IE00B29Z0J87	51 901	<i>GLG Partners Asset management Ltd.</i>	13 749 511	14 336 333	IS Bloomberg	KIS 3	1,65
<i>East Capital Balkan Fund</i>	SE	SE0001244328	1 796 855	<i>East Capital Asset Management AB/Swe</i>	9 038 836	8881 893	IS Bloomberg	KIS 3	1,02
<i>SEB Fund 2-SEB Russia Fund</i>	LU	LU0273119544	606 419	<i>SEB Asset Management S.A.</i>	21 211 757	23 916 524	E. pašto pranešimas	KIS 3	2,75
<i>JB Euro Government Bond Fund - C</i>	LU	LU0100842706	34 057	<i>Swiss & Global Asset Management</i>	17 130 245	17 797 440	IS Bloomberg	KIS 1	2,05
<i>East Capital Russian Fund</i>	SE	SE0000777708	21 742	<i>East Capital Asset Managment AB/Sweden</i>	9 807 478	11 407 963	IS Bloomberg	KIS 3	1,31
<i>PICTET FUND-EUR CORP BON</i>	LU	LU0128472205	29 189	<i>Pictet Funds S.A.</i>	15 898 728	16 366 121	IS Bloomberg	KIS 1	1,88
<i>Schroders Euro Corporate Bond Fund</i>	LU	LU0113258742	242 553	<i>Schroder Investment Management Luxemburg</i>	13 726 439	14 429 929	IS Bloomberg	KIS 1	1,66
<i>HSBC Euro Govt Bond Fund-C</i>	FR	FR0000971293	3 077	<i>HSBC Global Asset Management (France)</i>	25 690 023	25 902 703	IS Bloomberg	KIS 1	2,98
<i>T ROWE PRICE-ASIAN EX JAPAN JPN-I</i>	LU	LU0266341725	584 451	<i>T. Rowe Price Global Inv. Services Ltd</i>	20 569 536	22 932 228	IS Bloomberg	KIS 3	2,64
<i>BGF-Latin American Fund-\$D2</i>	LU	LU0252970081	77 142	<i>Black Rock Luxembourg</i>	17 589 862	18 566 738	IS Bloomberg	KIS 3	2,13
<i>TT European Equity A</i>	IE	IE0030893295	333 940	<i>TT International</i>	14 271 829	15 021 669	IS Bloomberg	KIS 3	1,73
<i>Odey Allegra European Fund</i>	IE	IE00B04YBL58	26 125	<i>Odey Asset Management LLP</i>	12 648 665	14 425 736	IS Bloomberg	KIS 3	1,66
<i>JOHCM European Select Val Inst EUR</i>	IE	IE0032904330	2 196 918	<i>J O Hambro Capital Management Limited</i>	13 864 038	15 034 499	IS Bloomberg	KIS 3	1,73
<i>Vontobel Fund-Belvista Commodity I</i>	LU	LU0415415800	35 875	<i>Vontobel Management SA/Luxembourg</i>	11 622 043	11 920 110	IS Bloomberg	KIS 5	1,37
<i>JPMorgan Funds - Emerging Markets Local Currency</i>	LU	LU0332400661	363 250	<i>JPMorgan Asset Management Europe SAR</i>	13 904 019	14 872 241	IS Bloomberg	KIS 1	1,71
<i>ING L Renta EMK DBT LOC-ICAP</i>	LU	LU0555021707	1 022	<i>ING Investment Management</i>	13 857 679	14 934 624	IS Bloomberg	KIS 1	1,72
<i>ING (L) Renta Fund Emerging Markets Debt (Hard Cur</i>	LU	LU0555020725	2 275	<i>ING Investment Management</i>	29 583 560	30 526 724	IS Bloomberg	KIS 1	3,51
<i>William Blair US All Cap Growth D</i>	LU	LU0534978027	81 597	<i>William Blair & Company L.L.C.</i>	23 827 062	24 576 662	IS Bloomberg	KIS 3	2,82
<i>DB X-Trackers MSCI USA TRN</i>	LU	LU0274210672	617 526	<i>DB Platinum Advisors</i>	45 438 320	46 903 026	IS Bloomberg	KIS 3	5,39

Iš viso:			15 561 495		539 019 947	570 112 613			65,53
Kitų kolektyvinio investavimo subjektų vienetai (akcijos)									
EEREIF	EE	EE3500096500	91 209	<i>AS Gild Property Asset Mamangement</i>	4 166 728	2 944 574	http://www.gildbanke rs.com/	KIS 5	0,34
<i>KEY HEDGE Fund INC-B EUR</i>	BM	VGG5250A1553	38 293	<i>Key Capital Management Inc</i>	16 454 006	16 721 667	IS Bloomberg	KIS 5	1,92
Iš viso:			129 502		18 825 278	19 666 241			2,26
Iš viso KIS vienetų (akcijų):					557 845 225	589 778 854			67,79

* – 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 numatyta mišrus (subalansuotas) investavimas;

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

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

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

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

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

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

Priemonės pavadinimas	Emitentas	Šalis	Kita sandorio šalis	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	DUU1	EUR	FR0000188690, DE0001137321, SI0002102919, AT0000385992, FR0010061242, XS0192595873, BE0000298076, AT0000385356, DE0001135218, SI0002102935	-58 675 813	-92 742	E. pašto pranešimas	2011 09 08	-0,01
CME USD/EUR CURR FUTURE	Chicago Mercantile Exchange	US	ECU1	USD	XS0541528682, XS0457764339, XS0485991417, XS0602546136, IE00B43N7R95	15 939 349	43 869	IS Bloomberg (t-1) dienos 10 val.	2011 09 19	0,01
EURO BOBL FUTURE	EUREX	CH	OEU1	EUR	NL0000102242, BE0000306150	8 855 603	19 750	E. pašto pranešimas	2011 09 08	0,00
EURO BUND FUTURE	EUREX	CH	RXU1	EUR	DE0001135374, NL0009086115, BE0000315243, DE0001135424, SI0002103149, XS0292653994	29 028 242	67 088	E. pašto pranešimas	2011 09 08	0,01
EURO BUXL 30Y BND FUTURE	EUREX	CH	UBU1	EUR	FR0000571218, DE0001135085	1 777 847	-46 613	E. pašto pranešimas	2011 09 08	-0,01
Iš viso:							-8 648			0,00
Kitos išvestinės finansinės priemonės										
Iš viso:										
Iš viso išvestinės finansinės priemonės										
							-8 648			0,00

Banko pavadinimas	Valiuta	Bendra rinkos vertė	Palūkanų norma	Dalis GA (%)
Pinigai				

AB SEB bankas	LTL	1 910 854		0,22
AB SEB bankas	EUR	3 811		0,00
AB SEB bankas	USD	202		0,00
SEB London Futures	EUR	838 602		0,10
SEB London Futures	USD	733 659		0,08
SEB London Futures	JPY	4		0,00
AB SEB bankas	LTL	722 291		0,08
Iš viso pinigai:		4 209 422		0,48

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		20 506		0,00
Mokėtinos sumos		-1 737 081		-0,20
Iš viso:		-1 716 575		-0,20

2010 12 31

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

Iš viso:									
Iš viso nuosavybės vertybinių popierių:									

Emitento pavadinimas	Šalis	ISIN kodas	Kiekis (vnt.)	Bendra nominalioji vertė	Bendra įsigijimo vertė	Bendra rinkos vertė	Palūkanų norma	Išpirkimo / konvertavimo data	Dalis GA (%)
Ne nuosavybės vertybiniai popieriai, įtraukti į Oficialųjį ar jį atitinkantį prekybos sąrašą									
Iš viso:									
Ne nuosavybės vertybiniai popieriai, įtraukti į Papildomąjį ar jį atitinkantį prekybos sąrašą									
Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT1000600213	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)									
Raffaisen-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 Managment 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 Luxembourg	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-\$D2	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 popierių;

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

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

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

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

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

Emitento pavadinimas	Šalis	Priemonės pavadinimas	Kiekis (vnt.)	Valiuta	Bendra rinkos vertė	Palūkanų norma	Galiojimo pabaigos data	Dalis GA (%)
Pinigų rinkos priemonės, kuriomis prekiaujama reguliuojamose rinkose								
Iš viso:								
Kitos pinigų rinkos priemonės								
Iš viso:								
Iš viso pinigų rinkos priemonių:								
Kredito įstaigos pavadinimas								
	Šalis	Valiuta	Bendra rinkos vertė	Palūkanų norma	Indėlio termino pabaiga	Dalis GA (%)		
Indėliai kredito įstaigose								
Iš viso indėlių kredito įstaigose								

Priemonės pavadinimas	Emitentas	Šalis	Kita sandorio šalis	Valiuta	Investicinis sandoris (pozicija)	Sandorio (pozicijos) vertė	Bendra rinkos vertė	Rinkos pavadinimas (tinklalapio adresas)	Galiojimo terminas	Dalis GA (%)
Išvestinės finansinės priemonės, kuriomis prekiaujama reguliuojamose rinkose										
EURO-SCHATZ FUTURE	EUREX	CH	EUREX	EUR	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
Mokėtinios 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

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				
Akcijos	342 580 233	39,37	374 590 883	43,87
Obligacijos	493 400 598	56,71	434 130 623	50,84
Pinigų rinkos priemonės	2 492 846	0,29	9 016 179	1,06
Alternatyvios investicijos	31 586 351	3,63	36 654 588	4,29
Išvestinės priemonės	- 8 648	0,00	- 514 911	-0,06
Iš viso:	870 051 380	100,00	853 877 362	100,00
Pagal regionus				
Obligacijos				
Vakarų Europos obligacijos	267 096 497	30,70	245 085 035	28,70
Vidurio ir Rytų Europos obligacijos	165 970 511	19,08	178 056 427	20,85
Besivystančių rinkų obligacijos	60 333 590	6,93	0	0,00
NVS obligacijos	0	0,00	10 989 161	1,29
Iš viso:	493 400 598	56,71	434 130 623	50,84
Akcijos				
Šiaurės Amerikos akcijos	97 547 525	11,21	101 524 995	11,89
Vakarų Europos akcijos	58 818 237	6,76	67 000 404	7,85
NVS akcijos	35 324 487	4,06	50 452 441	5,91
Vidurio ir Rytų Europos akcijos	48 529 017	5,58	54 839 566	6,42
Besivystančių rinkų akcijos	18 566 738	2,13	18 784 063	2,20
Japonijos akcijos	16 173 084	1,86	22 398 528	2,62
Azijos be Japonijos akcijos	67 621 146	7,77	59 590 886	6,98
Iš viso:	342 580 233	39,37	374 590 883	43,87

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)	78 188	USD	Valiutų kursų svyravimo rizikos valdymas	Reguliuojamų rinkų IP
CME USD/EUR CURR FUTURE	Ateities sandoris (angl. future)	216 913	USD	Valiutų kursų svyravimo rizikos valdymas	Reguliuojamų rinkų IP
EURO BUXL FUTURE	Ateities sandoris (angl. future)	20 820	EUR	Palūkanų normų rizikos valdymas	Reguliuojamų rinkų IP
EURO BUXL FUTURE	Ateities sandoris (angl. future)	97 480	EUR	Palūkanų normų rizikos valdymas	Reguliuojamų rinkų IP
EURO BOBL FUTURE	Ateities sandoris (angl. future)	-33 550	EUR	Palūkanų normų rizikos valdymas	Reguliuojamų rinkų IP
EURO BOBL FUTURE	Ateities sandoris (angl. future)	40 240	EUR	Palūkanų normų rizikos valdymas	Reguliuojamų rinkų IP
EURO BUND FUTURE	Ateities sandoris (angl. future)	-63 830	EUR	Palūkanų normų rizikos valdymas	Reguliuojamų rinkų IP
EURO BUND	Ateities sandoris	194 180	EUR	Palūkanų normų	Reguliuojamų

FUTURE	(angl. future)			rizikos valdymas	rinkų IP
EURO SCHATZ FUTURE	Ateities sandoris (angl. future)	30 085	EUR	Palūkanų normų rizikos valdymas	Reguliuojamų rinkų IP
EURO SCHATZ FUTURE	Ateities sandoris (angl. future)	-40 480	EUR	Palūkanų normų rizikos valdymas	Reguliuojamų rinkų IP
Išankstiniai valiutos keitimo sandoriai	Išankstinis sandoris (angl. forward)	-99 508	EUR	Valiutų kursų svyravimo rizikos valdymas	Kitų rinkų investicinė priemonė
NIKKEI 225 FUTURE	Ateities sandoris (angl. future)	18 010 000	JPY	VP pasirinkimo ir kainų kitimo rizikos valdymas	Reguliuojamų rinkų IP

2010 01 04 – 2010 06 30

Priemonės pavadinimas	Priemonės rūšis	Pelnas/nuostolis valiuta	Valiutos kodas	Priemonės panaudojimo tikslas	Pastabos
CME S&P FUTURE	Ateities sandoris (angl. future)	- 561 890	USD	Investicijų į akcijų rinkas rizikos valdymas	Reguliuojamų rinkų IP
DJ EURO STOXXX 50 FUTURE	Ateities sandoris (angl. future)	- 207 730	EUR	Investicijų į akcijų rinkas rizikos valdymas	Reguliuojamų rinkų IP
EUREX BUND FUTURE	Ateities sandoris (angl. future)	- 175 220	EUR	Obligacijų rizikos valdymas	Reguliuojamų rinkų IP
EURO BOBL FUTURE	Ateities sandoris (angl. future)	- 66 880	EUR	Obligacijų rizikos valdymas	Reguliuojamų rinkų IP
EURO BUXL FUTURE	Ateities sandoris (angl. future)	- 149 620	EUR	Obligacijų rizikos valdymas	Reguliuojamų rinkų IP
EURO SCHATZ FUTURE	Ateities sandoris (angl. future)	- 14 990	EUR	Obligacijų rizikos valdymas	Reguliuojamų rinkų IP
SIMEX NIKKEI 225 FUTURE	Ateities sandoris (angl. future)	-10 337 910	JPY	Investicijų į akcijų rinkas rizikos valdymas	Reguliuojamų rinkų IP
Išankstiniai valiutos keitimo sandoriai	Išankstinis sandoris (angl. forward)	- 89 170	LTL	Valiutų kursų svyravimo rizikos valdymas	Kitų rinkų investicinė priemonė

7 PASTABA IŠ IŠVESTINIŲ FINANSINIŲ PRIEMONIŲ SANDORIŲ KYLANČIŲ ĮSIPAREIGOJIMŲ BENDRA VERTĖ

2011 06 30

Priemonės rūšis	Išpirkimo data	Įsipareigojimų vertė valiuta ataskaitinio laikotarpio pabaigoje	Valiutos kodas	Pastabos
Ateities sandoris (angl. future)	2011 09 08	13 500	EUR	Reguliuojamų rinkų investicinė priemonė
Ateities sandoris (angl. future)	2011 09 08	26 860	EUR	Reguliuojamų rinkų investicinė priemonė

2010 12 31

Priemonės rūšis	Išpirkimo data	Išipareigojimų 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

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>	11 422	Komisinis mokestis už sandorius	Ne
AB SEB bankas	2 962	Komisinis mokestis už sandorius	Taip
<i>DB Platinum Advisors</i>	15 071	Komisinis mokestis už sandorius	Ne
HSBC Trinkaus	38 866	Komisinis mokestis už sandorius	Ne
Iš viso :*	68 321		

* 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>	11 738	Komisinis mokestis už sandorius	Ne
AB SEB bankas	5 523	Komisinis mokestis už sandorius	Taip
<i>HSBC Trinkaus</i>	5 066	Komisinis mokestis už sandorius	Ne
Iš viso :*	22 327		

* 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 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

VII. INFORMACIJA APIE PENSIJŲ FONDO DALYVIUS

-

VIII. IŠORINIAI PINIGŲ SRAUTAI

28. Per ataskaitinį laikotarpį faktiškai gautos lėšos:

Bendra gautų lėšų suma		49 504 515
Periodinės įmokos į pensijų fondą	iš Valstybinio socialinio draudimo fondo	41 263 744
	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 delpinigiaai		-
Iš garantijų rezervo sumokėtos lėšos		-
Iš kitų pensijų fondų pervestos lėšos	iš tos pačios pensijų kaupimo bendrovės	625 033
	iš kitos pensijų kaupimo bendrovės	7 615 738
Kitos gautos lėšos (nurodyti šaltinį ir gautų lėšų sumą), iš viso		-

29. Išmokėtos lėšos:

Bendra išmokėtų lėšų suma		19 230 038
Pensijų išmokos	vienkartinės išmokos dalyviams	592 321
	periodinės išmokos dalyviams	
	išmokos anuiteto įsigijimui	
Į kitus pensijų fondus pervestos lėšos	valdomus tos pačios pensijų kaupimo bendrovės	1 220 285
	valdomus kitos pensijų kaupimo bendrovės	16 241 945
Išstojusiems dalyviams išmokėtos lėšos (pildoma tik papildomo savanoriško kaupimo pensijų fondų atveju)		
Paveldėtojams išmokėtos lėšos		1 165 467
Kitais pagrindais išmokėtos lėšos (nurodyti šaltinį ir išmokėtų lėšų sumą), iš viso		10 020

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.

-

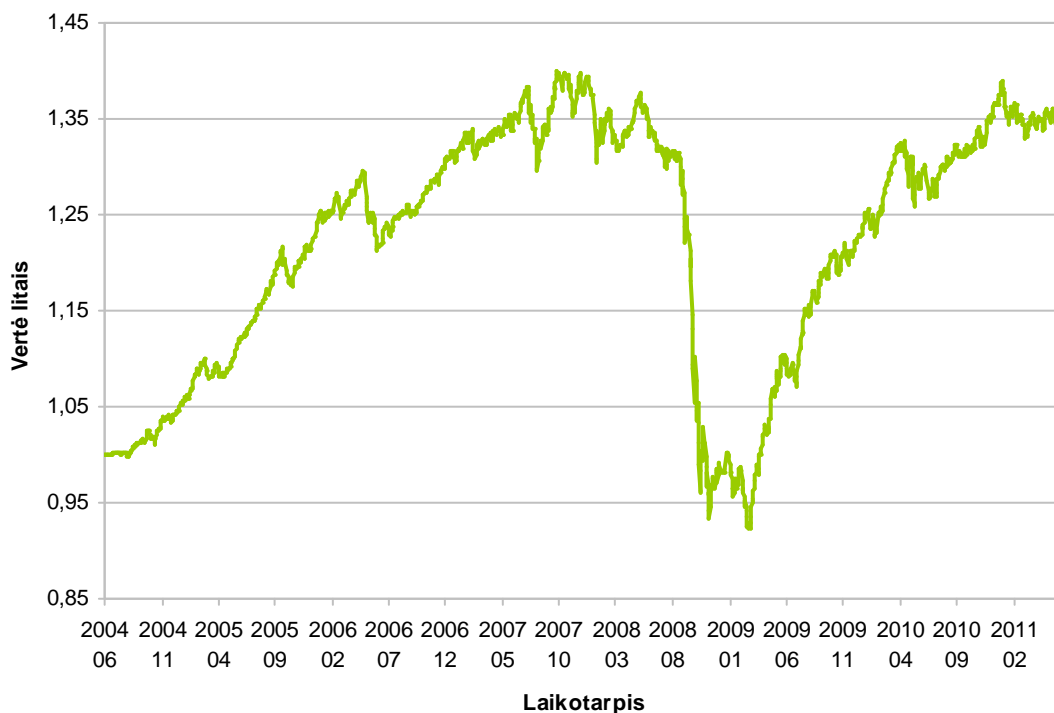
X. INFORMACIJA APIE PENSIJŲ FONDO REIKMĖMS PASISKOLINTAS LĖŠAS

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.

-