

2011 metų sausio – birželio mėnesių ataskaita

SEB pensija 2 plus

2011 m. birželio 30 d.

SEB

TURINYS

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

PENSIJŲ FONDO SEB PENSIJA 2 PLUS
2011 M. SAUSIO-BIRŽELIO MĖNESIŲ ATASKAITA

I. BENDROJI INFORMACIJA

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

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

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

3. Duomenys apie valdymo įmonę:

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

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

3.3. telefono, fakso numeriai, el. pašto adresas, interneto svetainės adresas

tel. (8 5) 268 1594

faks. (8 5) 268 1575

e. paštas info.invest@seb.lt

internetu adresas www.seb.lt;

3.4. veiklos licencijos numeris — VĮK – 001;

3.5. pensijų fondo valdytojo vardas, pavardė, pareigos (asmuo ar asmenys, priimančys investicinius sprendimus) — 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 grynųjų aktyvų, apskaitos vienetų skaičių ir vertę:

(Žr. 23.3. punktas, 1 PASTABA)

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

(Žr. 23.3. punktas, 2 PASTABA)

III. ATSKAITYMAI IŠ PENSIJŲ TURTO

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

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

Atskaitymai	Atskaitymų dydis		Per ataskaitinį laikotarpį priskaičiuotų atskaitymų suma (Lt)	% nuo ataskaitinio laikotarpio vidutinės grynųjų aktyvų vertės
	maksimalus, nustatytas sudarymo dokumentuose	ataskaitiniu laikotarpiu taikytas		
Už valdymą:				
<i>nekinamas dydis</i>	1,00 proc.	1,00 proc.	248 915	0,50%
<i>sėkmės mokestis</i>	-	-	-	-
depozitoriumui	0,30 proc.	0,10 proc.	25 002	0,05%
Už sandorių sudarymą			5 213	0,01%
Už auditą			5 102	0,01%

Atskaitymai	Atskaitymų dydis		Per ataskaitinį laikotarpį priskaičiuotų atskaitymų suma (Lt)	% nuo ataskaitinio laikotarpio vidutinės grynųjų aktyvų vertės
	maksimalus, nustatytas sudarymo dokumentuose	ataskaitiniu laikotarpiu taikytas		
Kitos veiklos išlaidos (nurodyti išlaidų rūšis)	-	-	-	-
Išlaidų, įskaičiuojamų į BIK, suma*	-			
BIK % nuo GAV *	-			
Visų išlaidų suma			284 232	0,57%
PAR (praėjusio analogiško ataskaitinio laikotarpio PAR)*	-			

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

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

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

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

(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 (litas) nuo pensijų fondo dalyvio įmokų esant dabartiniam atskaitymų dydžiui ir kokią sumą jis atgautų po 1, 3, 5, 10 metų, jei būtų investuota 10 000 Lt, o metinė investicijų grąža – 5 proc.

-

IV. INFORMACIJA APIE PENSIJŲ FONDO INVESTICINIŲ PRIEMONIŲ PORTFELĮ

11. Ataskaitinio laikotarpio pabaigos investicinių priemonių portfelio sudėtis:

(Žr. 23.3. punktas, 4 PASTABA)

12. (neteko galios)

Punkto pakeitimai:

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

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

(Žr. 23.3. punktas, 6 PASTABA)

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

Per ataskaitinį laikotarpį fondas sudarė obligacijų, kurių kainų pokytis priklauso nuo Vokietijos 2, 5, 10 arba 30 metų trukmės obligacijų kainų pokyčio, ateities sandorius (*schatz*, *bohl* ir *bund 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 atsižvelgiant 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 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 antrame 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 nesmarkiai, 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 GRAŽA IR RIZIKOS RODIKLIAI

VI. PENSIJŲ FONDO FINANSINĖ BŪKLĖ

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

23.1. grynujų aktyvų ataskaitą;

GRYŪŲŲ 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		49 333 136	52 838 402
I.	PINIGAI	4	274 006	582 714
II.	TERMINUOTIEJI INDĖLIAI		-	-
III.	PINIGŲ RINKOS PRIEMONĖS		-	-
III.1.	Valstybės išdo vekseliai		-	-
III.2.	Kitos pinigų rinkos priemonės		-	-
IV.	PERLEIDŽIAMIEJI VERTYBINIAI POPIERIAI	3, 4	49 053 977	52 227 124
IV.1.	Ne nuosavybės vertybiniai popieriai		-	106 255
IV.1.1.	Vyriausybių ir centrinių bankų arba jų garantuoti ne nuosavybės vertybiniai popieriai		-	106 255
IV.1.2.	Kiti ne nuosavybės vertybiniai popieriai		-	-
IV.2.	Nuosavybės vertybiniai popieriai		-	-
IV.3.	Kitų kolektyvinio investavimo subjektų investiciniai vienetai ir akcijos		49 053 977	52 120 869
V.	GAUTINOS SUMOS	4	4 083	28 564
V.1.	Investicijų pardavimo sandorių gautinos sumos		-	-
V.2.	Kitos gautinos sumos		4 083	28 564
VI.	INVESTICINIS IR KITAS TURTAS	4	1 070	-
VI.1.	Investicinis turtas		-	-
VI.2.	Išvestinės finansinės priemonės		1 070	-
VI.3.	Kitas turtas		-	-
B.	ĮSIPAREIGOJIMAI	4	82 776	1 633 512
I.	Finansinio ir investicinio turto pirkimo įsipareigojimai		-	-
II.	Įsipareigojimai kredito įstaigoms		-	1 515 109
III.	Įsipareigojimai pagal išvestinių finansinių priemonių sutartis		3 280	-
IV.	Valdymo įmonei ir depozitoriumui mokėtinos sumos		63 564	111 541
V.	Kitos mokėtinos sumos ir įsipareigojimai		15 932	6 862
C.	GRYŪŲŲ AKTYVAI		49 250 360	51 204 890

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

23.2. grynujų aktyvų pokyčių ataskaitą;

GRYNUJŲ AKTYVŲ POKYČIŲ ATASKAITA (LT)

2011 m. birželio 30 d.

Eil. nr.	Straipsniai	Pastabos Nr.	Finansiniai metai 2011 01 01- 2011 06 30	Praėję finansiniai metai 2010 01 01- 2010 06 30
I.	GRYNUJŲ AKTYVŲ VERTĖ ATASKAITINIO LAIKOTARPIO PRADŽIOJE		51 204 890	41 174 811
II.	GRYNUJŲ AKTYVŲ VERTĖS PADIDĖJIMAS		3 990 790	4 743 643
II.1.	Dalyvių įmokos į fondą		1 902 722	1 970 058
II.2.	Iš kitų fondų gautos sumos		50 761	293 546
II.3.	Garantinės įmokos		-	-
II.4.	Palūkanų pajamos		1 465	20 898
II.5.	Dividendai		16 406	-
II.6.	Pelnas dėl investicijų vertės pasikeitimo ir pardavimo		1 833 724	2 127 047
II.7.	Pelnas dėl užsienio valiutos kursų pokyčio		94 449	205 433
II.8.	Išvestinių finansinių priemonių pelnas		1 070	15 439
II.9.	Kitas grynujų aktyvų vertės padidėjimas		90 193	111 222
	PADIDĖJO IŠ VISO:		3 990 790	4 743 643
III.	GRYNUJŲ AKTYVŲ VERTĖS SUMAŽĖJIMAS		5 945 320	3 048 247
III.1.	Išmokos fondo dalyviams		1 837 155	565 165
III.2.	Išmokos kitiems fondams		151 269	1 123 291
III.3.	Nuostoliai dėl investicijų vertės pasikeitimo ir pardavimo		3 560 339	827 553
III.4.	Nuostoliai dėl užsienio valiutos kursų pokyčio		51 373	130 169
III.5.	Išvestinių finansinių priemonių sandorių nuostoliai		3 280	82 750
III.6.	Valdymo sąnaudos:		341 904	319 319
III.6.1.	Atlyginimas valdymo įmonei		305 998	270 093
III.6.2.	Atlyginimas depozitoriumui		25 003	42 366
III.6.3.	Atlyginimas tarpininkams	8	5 213	1 504
III.6.4.	Audito sąnaudos		5 102	5 021
III.6.5.	Kitos sąnaudos		588	335
III.7.	Kitas grynujų aktyvų vertės sumažėjimas		-	-
III.8.	Sąnaudų kompensavimas (-)		-	-
III.9.	Pelno paskirstymas		-	-
	SUMAŽĖJO IŠ VISO:		5 945 320	3 048 247
IV.	GRYNUJŲ AKTYVŲ VERTĖ ATASKAITINIO LAIKOTARPIO PABAIGOJE		49 250 360	42 870 207

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

23.3. aiškinamąjį raštą.

AIŠKINAMASIS RAŠTAS

Bendroji informacija

Papildomo savanoriško pensijų kaupimo fondo *Pensija 2 plus* taisyklės Nr. PF-S02-K001-018(005) patvirtino Lietuvos Respublikos vertybinių popierių komisija 2004 m. spalio 21 d. (paskutiniai pakeitimai įsigaliojo – 2010 m. gegužės 15 d.). 2006 m. vasario 9 d pensijų fondo pavadinimas pakeistas į *SEB pensija 2 plus*.

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

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

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

Apskaitos principai

Finansinės ataskaitos parengtos vadovaujantis Lietuvos Respublikos buhalterinės apskaitos įstatymu 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. lapkričio 3 d.

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

Fondo apskaita tvarkoma atskirai nuo Bendrovės ir kitų jos valdomų pensijų fondų apskaitos pagal patvirtintą sąskaitų planą.

Finansiniai Fondo metai sutampa su kalendoriniais metais.

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

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

a) Turto padidėjimo ir sumažėjimo pripažinimo principai

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

Vertybinių popierių padidėjusi vertės dalis traukiama į apskaitą kai įsigyjami 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 įsipareigojimas jeigu tikroji vertė neigiama. Išvestinių finansinių priemonių vertės padidėjusi dalis yra traukiama į kitas pajamas o vertės sumažėjusi dalis į kitas sąnaudas.

Avanso sumokėjimas traukiamas į apskaitą gautinų sumų sąskaitoje. Šio straipsnio padidėjusi ar sumažėjusi vertės dalis traukiama į apskaitą jei atsiskaitoma užsienio valiuta dėl oficialaus lito ir Lietuvos banko skelbiamo lito ir užsienio

valiutos santykio pasikeitimo. Sumažėjusi vertės dalis traukiama į apskaitą gavus prekes ar pasinaudojus paslaugomis arba nebesitikint atgauti sumokėtų sumų.

b) Grynųjų aktyvų vertės ir vienetų vertės apskaičiavimo principai

Apskaičiuojant fondo grynųjų aktyvų vertę atskirai apskaičiuojama fondo turto vertė ir išipareigojimų vertė.

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

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

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

Išipareigojimai skaičiuojami pagal Verslo apskaitos standartų reikalavimus.

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

Apskaičiuojant grynųjų aktyvų užsienio valiuta vertę turto ir išipareigojimų 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 neprekiuojama vertė;
5. yra gaunamas tikslesnis priemonių vertinimas vertinant taip:
 - 5.1. naudojantis *Bloomberg Reuters* ar kitų tarptautinių naujienų agentūrų informacijos šaltinių teikiamais pelningumo duomenimis ir/arba kainomis;
 - 5.2. pagal tikėtiną pardavimo kainą nustatytą pagal parinktą vertinimo modelį kuris finansų rinkoje yra visuotinai taikomas ir pripažintas;
6. yra gaunamas tikslesnis skolos VP 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 neprekiuojama tikroji vertė nustatoma:

1. nuosavybės VP vertinami pagal VPK patvirtintą GA vertės skaičiavimo metodiką;
2. skolos VP ir pinigų rinkos priemonės vertinami pagal VPK patvirtintą GA vertės skaičiavimo metodiką;
3. išvestinės finansinės priemonės vertinamos pagal paskutinę analogiško anksčiau sudaryto sandorio rinkos vertę jei per laikotarpį nuo sandorio sudarymo dienos iki vertinimo dienos nebuvo didelio ekonominių aplinkybių pasikeitimo. Jei minėta sąlyga netenkinama vertinama pagal tikėtiną pardavimo kainą nustatytą pagal parinktą vertinimo modelį

(nurodytą bendrovės patvirtintose GA skaičiavimo procedūrose) kuris finansų rinkoje yra visuotinai taikomas ir pripažintas;

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

5. terminuoti indėliai bankuose vertinami pagal amortizuotos savikainos vertę;

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

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

8. yra gaunamas tikslesnis priemonių vertinimas vertinant taip:

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

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

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

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

9.2. Lietuvos Respublikos VP pelningumas nustatomas pagal pirminių dilerių AB SEB banko AB „DnB NORD” banko ir AB „Swedbank” skelbiamas konkrečios emisijos tos dienos geriausios pirkimo (mažiausias BID) ir pardavimo (didžiausias ASK) pelningumų vidurkį;

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

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

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

Fondo apskaitos vienetai išreiškia dalyviui priklausančią turto dalį fonde.

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

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

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

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

1. įmokos mokesť – 3 proc., kuris yra vienkartinis ir išskaičiuojamas iš kiekvienos gautos įmokos.

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

d) Pinigų ekvivalentai

Pinigų ekvivalentams priskiriamos trumpalaikės (iki trijų mėnesių) likvidžios investicijos kurios gali būti greitai iškeičiamos į pinigų sumas ir kurių vertės pasikeitimo rizika yra nereikšminga. Investicijos į nuosavybės vertybinius popierius pinigų ekvivalentams nepriskiriamos.

e) Finansiniai įsipareigojimai

Finansiniai įsipareigojimai apima mokėtinas sumas už gautas paslaugas bei įsipareigojimus kredito įstaigoms.

Finansiniai įsipareigojimai apskaitoje registruojami tada kai Fondas prisiima įsipareigojimą sumokėti pinigus ar atsiskaityti kitu finansiniu turtu.

Mokėtinos sumos už paslaugas nustatomos įsigijimo savikaina.

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

Kita informacija

Informacija apie investavimo, finansinės rizikos valdymo politiką, investicijų portfelio struktūrą ir atskaitymų valdymo įmonei ir depozitoriumui taisyklės pateikiamos <http://www.seb.lt/pow/wcp/seblt.asp> → *Pensija* → *Pensijų fondų taisyklės ir ataskaitos*.

1 PASTABA**GRYNUJŲ AKTYVŲ APSKAITOS VIENETŲ SKAIČIUS IR VERTĖ**

	Ataskaitinio laikotarpio pradžioje (2011 01 03)	Ataskaitinio laikotarpio pabaigoje (2011 06 30)	Prieš metus (2010 06 30)	Prieš dvejus metus (2009 06 30)
Grynųjų aktyvų vertė (Lt)	51 153 532	49 250 360	42 870 207	33 102 276
Investicinio vieneto (akcijos) vertė (Lt)	1 3212	1 2731	1 1624	0 9581
Investicinių vienetų (akcijų) esančių apyvartoje skaičius	38 716 028	38 684 922	36 879 975	34 550 011

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

2011 01 03 – 2011 06 30

	Apskaitos vienetų skaičius	Vertė (Lt)
Išplatinta (konvertuojant pinigines lėšas į investicinius vienetus)	1 460 915	1 953 483
Išpirkta (konvertuojant investicinius vienetus į pinigines lėšas)	1 529 974	1 988 424

2010 01 04 – 2010 06 30

	Apskaitos vienetų skaičius	Vertė (Lt)
Išplatinta (konvertuojant pinigines lėšas į investicinius vienetus)	1 855 840	2 263 603
Išpirkta (konvertuojant investicinius vienetus į pinigines lėšas)	1 466 040	1 688 456

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
Vyriausybės ir centrinių bankų arba jų garantuoti ne nuosavybės vertybiniai popieriai	106 255	-	-106 247	402	-410	-
Kitų kolektyvinio investavimo subjektų investiciniai vienetai ir akcijos	52 120 869	25 920 255	-28 716 035	23 125 316	-23 396 428	49 053 977
Iš viso :	52 227 124	25 920 255	-28 822 282	23 125 718	-23 396 838	49 053 977

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

KIS pavadinimas	Šalis	ISIN kodas	Kiekis (vnt.)	Valdytojas	Bendra įsigijimo vertė	Bendra rinkos vertė	Rinkos vertės nustatymo šaltinis (tinklalapio adresas)	KIS tipas*	Dalis GA (%)
Kolektyvinio investavimo subjektų įstatymo 61 str. 1 d. reikalavimus atitinkančių kolektyvinio investavimo subjektų (KIS) vienetai (akcijos)									
<i>Comstage ETF MSCI USA-I</i>	DE	LU0392495700	13 284	<i>Commerz Derivatives Funds Solutions</i>	994 857	1 006 242	IS Bloomberg	KIS 3	2 04
<i>Comgest Growth AS X JPN-USD</i>	IE	IE00B16C1G93	61 112	<i>Comgest Asset Management International</i>	2 052 517	2 117 561	IS Bloomberg	KIS 3	4 30
<i>SEB Eastern Europe Bond Fund</i>	EE	EE3600087532	26 559	<i>AS SEB Varahaldus</i>	909 871	1 058 806	IS Bloomberg	KIS 1	2 15
<i>CRM US Equity Opportunities-S</i>	IE	IE00B43N7R95	91 216	<i>Cramer Rosenthal McGlynn LLC ("CRM")</i>	2 621 060	2 607 854	http://www.ise.ie/app/showClass.asp	KIS 3	5 30
<i>East Capital Balkan Fund</i>	SE	SE0001244328	213 082	<i>East Capital Asset Management AB/Swe</i>	1 071 600	1 053 268	IS Bloomberg	KIS 3	2 14
<i>SEB Sicav 1-SEB Eastern Europe ex Russia</i>	LU	LU0070133888	427 380	<i>SEB Asset Management S.A.</i>	3 716 869	4 580 000	E. pašto pranešimas	KIS 3	9 30
<i>HSBC GIF-EUR COR CRD BD-IC</i>	LU	LU0165125831	14 542	<i>HSBC Investment Funds (Luxembourg) S.A.</i>	1 014 052	1 043 090	IS Bloomberg	KIS 1	2 12
<i>HSBC Euro Govt Bond Fund-C</i>	FR	FR0000971293	402	<i>HSBC Global Asset Management (France)</i>	3 365 383	3 384 104	IS Bloomberg	KIS 1	6 87
<i>FAST JAPAN FUND -Y</i>	LU	LU0348530451	8 369	<i>FIL Fund Management Limited</i>	1 896 132	1 744 530	IS Bloomberg	KIS 3	3 54
<i>Investec GS Asian Equity-A A</i>	LU	LU0345775950	45 077	<i>Investec Asset Management Guernsey L</i>	2 050 977	2 216 828	IS Bloomberg	KIS 3	4 50
<i>GLG European Equity S</i>	IE	IE00B29Z0J87	6 020	<i>GLG Partners Asset management Ltd.</i>	1 589 638	1 662 788	IS Bloomberg	KIS 3	3 38
<i>ING L Renta EMK DBT LOC-ICAP</i>	LU	LU0555021707	48	<i>ING Investment Management</i>	650 850	701 430	IS Bloomberg	KIS 1	1 42
<i>ING (L) Renta Fund Emerging Markets Debt (Hard Cur</i>	LU	LU0555020725	54	<i>ING Investment Management</i>	702 203	724 590	IS Bloomberg	KIS 1	1 47
<i>SEB Fund 2-SEB Russia Fund</i>	LU	LU0273119544	61 159	<i>SEB Asset Management S.A.</i>	1 944 954	2 412 046	E. pašto pranešimas	KIS 3	4 90

<i>East Capital Russian Fund</i>	SE	SE0000777708	2 225	<i>East Capital Asset Management AB/Sweden</i>	939 839	1 167 451	IS Bloomberg	KIS 3	2 37
<i>PICTET FUND-EUR CORP BON</i>	LU	LU0128472205	1 028	<i>Pictet Funds S.A.</i>	556 011	576 640	IS Bloomberg	KIS 1	1 17
<i>T ROWE PRICE-ASIAN EX JAPAN JPN-I</i>	LU	LU0266341725	58 842	<i>T. Rowe Price Global Inv. Services Ltd</i>	2 089 131	2 308 815	IS Bloomberg	KIS 3	4 69
<i>BGF-Latin American Fund-\$D2</i>	LU	LU0252970081	8 204	<i>Black Rock Luxembourg</i>	1 837 889	1 974 571	IS Bloomberg	KIS 3	4 01
<i>TT European Equity A</i>	IE	IE0030893295	37 451	<i>TT International</i>	1 597 463	1 684 646	IS Bloomberg	KIS 3	3 42
<i>Odey Allegra European Fund</i>	IE	IE00B04YBL58	2 942	<i>Odey Asset Management LLP</i>	1 432 130	1 624 589	IS Bloomberg	KIS 3	3 30
<i>JOHCM European Select Val Inst EUR</i>	IE	IE0032904330	245 264	<i>J O Hambro Capital Management Limited</i>	1 542 962	1 678 451	IS Bloomberg	KIS 3	3 41
<i>William Blair US All Cap Growth D</i>	LU	LU0534978027	8 928	<i>William Blair & Company L.L.C.</i>	2 615 016	2 689 169	IS Bloomberg	KIS 3	5 46
<i>Vontobel Fund-Belvista Commodity I</i>	LU	LU0415415800	4 205	<i>Vontobel Management SA/Luxembourg</i>	1 362 249	1 397 186	IS Bloomberg	KIS 5	2 84
<i>DB X-trackers MSCI AC Asia ex-Japan</i>	LU	LU0322252171	9 475	<i>DB Platinum Advisors</i>	778 518	776 082	IS Bloomberg	KIS 3	1 58
<i>DB X-Trackers MSCI USA TRN</i>	LU	LU0274210672	55 706	<i>DB Platinum Advisors</i>	4 087 650	4 231 044	IS Bloomberg	KIS 3	8 59
Iš viso:			1 402 574		43 419 821	46 421 783			94 26
Kitų kolektyvinio investavimo subjektų vienetai (akcijos)									
<i>EEREIF</i>	EE	EE3500096500	21 936	<i>AS Gild Property Asset Mamangement</i>	1 011 167	708 185	http://www.gildbankers.com/	KIS 5	1 44
<i>KEY HEDGE Fund INC-B EUR</i>	BM	VGG5250A1553	4 406	<i>Key Capital Management Inc</i>	1 894 078	1 924 010	IS Bloomberg	KIS 5	3 91
Iš viso:			26 342		2 421 853	2 632 195			5 34
Iš viso KIS vienetų (akcijų):					45 841 675	49 053 977			99 60

* – 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	FR0000971293	-1 485 464	-2 348	E. pašto pranešimas	2011 09 08	0 00
EURO BOBL FUTURE	EUREX	CH	EUREX	USD	FR0000971293	-402 527	-932	E. pašto pranešimas	2011 09 08	0 00
EURO BUND FUTURE	EUREX	CH	EUREX	EUR	FR0000971293	433 257	1 070	E. pašto pranešimas	2011 09 08	0 00
Iš viso:							-2 210			0 00
Kitos išvestinės finansinės priemonės										
Iš viso:										
Iš viso išvestinės finansinės priemonės										
Banko pavadinimas	Valiuta	Bendra rinkos vertė	Palūkanų norma	Dalis GA (%)						
Pinigai										
AB SEB bankas	LTL	183 494		0 37						
AB SEB bankas	EUR	69 309		0 14						
AB SEB bankas	USD	0		0 00						
SEB London Futures	EUR	21 050		0 04						
SEB London Futures	USD	144		0 00						
SEB London Futures	JPY	9		0 00						
Iš viso pinigai:		274 006		0 56						
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		4 083		0 01
Mokėtinos sumos		-79 496		-0 16
Iš viso:		-75 413		-0 15

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									
Iš viso:									

Ne nuosavybės vertybiniai popieriai kuriais prekiaujama kitose reguliuojamose rinkose									
Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT0000605107	1 000	100 000	99 451	106 255	4 15	2015 04 29	0 21
Iš viso:			1 000	100 000	99 451	106 255			0 21
Išleidžiami nauji ne nuosavybės vertybiniai popieriai									
Iš viso:									
Iš viso ne nuosavybės vertybinių popierių:				100 000	99 451	106 255			0 21
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	2 195	Raiffeisen Kapitalanlage-Gesellschaft m.b.H.	1 415 795	2 463 606	e. pašto pranešimas	KIS 3	4 81
Comgest Growth AS X JPN	IE	IE00B16C1G93	26 855	Comgest Asset Management International	899 769	1 058 354	IS Bloomberg	KIS 3	2 07
SEB Eastern Europe Bond Fund	EE	EE3600087532	38 299	AS SEB Varahaldus	1 312 064	1 486 739	IS Bloomberg	KIS 1	2 90
SEB Sicav 1-SEB Eastern Europe ex Russia	LU	LU0070133888	371 904	SEB Asset Management S.A.	3 039 395	3 913 967	e. pašto pranešimas	KIS 3	7 64
SEB Fund 1 - SEB North America Fund	LU	LU0030166176	507 634	SEB Asset Management S.A.	5 628 257	6 062 758	e. pašto pranešimas	KIS 3	11 84
Eaton Vance Int.-US Value Fund Registered Shares	IE	IE00B2RKZ343	150 762	Eaton Vance Advisors Ireland Ltd	3 293 694	3 604 221	IS Bloomberg	KIS 3	7 04
iShares MSCI Australia Index Fund	US	US4642861037	13 102	BlackRock Fund Advisors	841 185	869 919	IS Bloomberg	KIS 3	1 70
FAST JAPAN FUND	LU	LU0348530451	10 200	FIL Fund Management Limited	2 500 944	2 430 159	IS Bloomberg	KIS 3	4 75
GLG European Equity	IE	IE00B29Z0J87	6 644	GLG Partners Asset management Ltd.	1 754 022	1 825 279	IS Bloomberg	KIS 3	3 56
Investec GS Asian Equity	LU	LU0345775950	39 879	Investec Asset Management Guernsey L	1 968 154	2 071 179	IS Bloomberg	KIS 3	4 04
HSBC GIF-EUR COR CRD BD	LU	LU0165125831	10 253	HSBC Investment Funds (Luxembourg) S.A.	707 321	720 031	IS Bloomberg	KIS 1	1 41

HSBC Euro Govt Bond Fund	FR	FR0000971293	21	HSBC Global Asset Management (France)	175 631	173 359	IS Bloomberg	KIS 1	0 34
JOHCM European Select Value	IE	IE0032904330	277 619	J O Hambro Capital Management Limited	1 743 663	1 851 946	IS Bloomberg	KIS 3	3 62
JB Commodity Fund	LU	LU0244125398	6 409	Swiss & Global Asset Management	1 824 278	2 046 719	IS Bloomberg	KIS 5	4 00
BGF-Latin American Fund	LU	LU0252970081	5 249	Black Rock Luxembourg	1 191 086	1 431 389	IS Bloomberg	KIS 3	2 80
Odey Allegra European Fund	IE	IE00B04YBL58	3 216	Odey Asset Management LLP	1 561 047	1 811 984	IS Bloomberg	KIS 3	3 54
PICTET FUND-EUR CORP BOND	LU	LU0128472205	672	Pictet Funds S.A.	359 202	368 831	IS Bloomberg	KIS 1	0 72
SEB Fund 2-SEB Russia Fund	LU	LU0273119544	102 614	SEB Asset Management S.A.	2 768 625	4 325 940	e. pašto pranešimas	KIS 3	8 45
East Capital Russian Fund	SE	SE0000777708	2 378	East Capital Asset Management AB	1 030 090	1 351 654	IS Bloomberg	KIS 3	2 64
T ROWE PRICE-US LG CP GRW	LU	LU0174119775	90 922	T. Rowe Price Global Inv. Services Ltd	3 192 169	3 694 700	IS Bloomberg	KIS 3	7 22
T ROWE PRICE-ASIAN EX JAPAN JPN	LU	LU0266341725	50 196	T. Rowe Price Global Inv. Services Ltd	1 931 326	2 085 630	IS Bloomberg	KIS 3	4 07
TT European Equity	IE	IE0030893295	40 335	TT International	1 714 205	1 860 353	IS Bloomberg	KIS 3	3 63
Vontobel Fund-Belvista Commodity	LU	LU0415415800	5 730	Vontobel Management SA	2 017 542	2 031 600	IS Bloomberg	KIS 5	3 97
Iš viso:			1 763 089		42 869 464	49 540 317			96 75
Kitų kolektyvinio investavimo subjektų vienetai (akcijos)									
EEREIF	EE	EE3500096500	21 936	AS Gild Property Asset Mamangement	1 011 167	668 799	www.gildbankers.com	KIS 5	1 31
KEY HEDGE Fund INC-B EUR	BM	VGG5250A1553	4 409	Key Capital Management Inc	1 895 488	1 911 753	IS Bloomberg www.keyhedge.com	KIS 5	3 73
Iš viso:			26 346		2 906 655	2 580 552			5 04
Iš viso KIS vienetų (akcijų):					45 292 727	52 120 869			101 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 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										
Iš viso:										
Kitos išvestinės finansinės priemonės										
Iš viso:										
Iš viso išvestinės finansinės priemonės										
Banko pavadinimas	Valiuta	Bendra rinkos vertė	Palūkanų norma	Dalis GA (%)						
Pinigai										
AB SEB bankas	LTL	149 977	0 51	0 29						
AB SEB bankas	USD	428 609	0 20	0 84						
SEB London Futures	EUR	56		0 00						
SEB London Futures	USD	4 072		0 01						
Iš viso pinigai:		582 714		1 14						
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		-1 515 109		-2 96
Mokėtinos sumos		- 118 403		-0 23
Gautinos sumos (dividendai sukauptos palukanos už s-tų likučius)		28 564		0 06
Iš viso:		-1 604 948		-3 14

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	37 535 936	76,21	41 817 024	81,67
Obligacijos	7 488 661	15,21	2 855 215	5,58
Pinigų rinkos priemonės	198 592	0,40	1 920 500	3,75
Alternatyvios investicijos	4 029 381	8,18	4 612 152	9,00
Išvestinės priemonės	- 2 210	0,00	0	0,00
Iš viso:	49 250 360	100,00	51 204 890	100,00
Pagal regionus (obligacijos)				
Vakarų Europos obligacijos	5 003 833	10,16	1 262 221	2,47
Besivystančių rinkų obligacijos	1 426 021	2,90	0	0,00
Vidurio ir Rytų Europos obligacijos	1 058 806	2,15	1 592 994	3,11
Iš viso:	7 488 661	15,21	2 855 215	5,58
Pagal regionus (akcijos)				
Šiaurės Amerikos akcijos	10 534 309	21,39	11 725 272	22,90
Vakarų Europos akcijos	6 650 474	13,50	7 349 562	14,35
NVS akcijos	3 579 498	7,27	5 677 593	11,09
Vidurio ir Rytų Europos akcijos	5 633 268	11,44	6 298 457	12,30
Besivystančių rinkų akcijos	1 974 571	4,01	2 094 304	4,09
Japonijos akcijos	1 744 530	3,54	2 430 159	4,75
Azijos be Japonijos akcijos	7 419 286	15,06	6 241 676	12,19
Iš viso :	37 535 936	76,21	41 817 024	81,67

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
EURO BOBL FUTURE	Ateities sandoris (angl. future)	-123	EUR	Palūkanų normų rizikos valdymas	Reguliuojamų rinkų IP
EURO BUND FUTURE	Ateities sandoris (angl. future)	3 187	EUR	Palūkanų normų rizikos valdymas	Reguliuojamų rinkų IP
EURO SCHATZ FUTURE	Ateities sandoris (angl. future)	-2 873	EUR	Palūkanų normų rizikos valdymas	Reguliuojamų rinkų IP
NIKKEI 225 FUTURE	Ateities sandoris (angl. future)	2 058 360	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
EURO SCHATZ FUTURE	Ateities sandoris (angl. future)	-488	EUR	Obligacijų rizikos valdymas	Reguliuojamų rinkų IP
EURO BUXL FUTURE	Ateities sandoris (angl. future)	6 035	EUR	Obligacijų rizikos valdymas	Reguliuojamų rinkų IP

CME S&P FUTURE	Ateities sandoris (angl. future)	-31 969	USD	Investicijų į akcijų rinkas rizikos valdymas	Reguliuojamų rinkų IP
SIMEX NIKKEI 225 FUTURE	Ateities sandoris (angl. future)	-89 595	JPY	Investicijų į akcijų rinkas rizikos valdymas	Reguliuojamų rinkų IP
EURO BOBL FUTURE	Ateities sandoris (angl. future)	-645	EUR	Obligacijų rizikos valdymas	Reguliuojamų rinkų IP
EUREX BUND FUTURE	Ateities sandoris (angl. future)	-4 167	EUR	Obligacijų rizikos valdymas	Reguliuojamų rinkų IP
DJ EURO STOXXX 50 FUTURE	Ateities sandoris (angl. future)	-20 228	EUR	Investicijų į akcijų rinkas rizikos valdymas	Reguliuojamų rinkų IP

7 PASTABA IŠ IŠVESTINIŲ FINANSINIŲ PRIEMONIŲ SANDORIŲ KYLANČIŲ IŠIPAREIGOJIMŲ BENDRA VERTĖ

2011 06 30

Priemonės rūšis	Išpirkimo data	Išipareigojimų vertė valiuta ataskaitinio laikotarpio pabaigoje	Valiutos kodas	Pastabos
Ateities sandoris (angl. future)	2011 09 08	270	EUR	Reguliuojamų rinkų investicinė priemonė
Ateities sandoris (angl. future)	2011 09 08	680	EUR	Reguliuojamų rinkų investicinė priemonė

2010 12 31

-

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>	455	Komisinis mokestis už sandorius	Ne
<i>DB Platinum Advisors</i>	1 805	Komisinis mokestis už sandorius	Ne
HSBC Trinkaus	2 953	Komisinis mokestis už sandorius	Ne
Iš viso:*	5 213		

* 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>	634	Komisinis mokestis už sandorius	Ne
AB SEB bankas	281	Komisinis mokestis už sandorius	Taip
<i>HSBC Trinkaus</i>	589	Komisinis mokestis už sandorius	Ne
Iš viso:*	1 504		

* 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 Lt.	Paskolos valiuta	Paskolos paėmimo data	Paskolos gražinimo terminas	Palūkanų dydis	Skolinimosi tikslas	Kreditorius	Skolintų lėšų dalis lyginant su fondo GA (%)
1.	1 515 109	EUR	2010 12 31	2011 01 04	1 3563	likvidumui palaikyti	AB SEB bankas	2 96
Iš viso:	1 515 109							2 96

VII. INFORMACIJA APIE PENSIJŲ FONDO DALYVIUS

-

VIII. IŠORINIAI PINIGŲ SRAUTAI

28. Per ataskaitinį laikotarpį faktiškai gautos lėšos:

Bendra gautų lėšų suma		1 953 483
Periodinės įmokos į pensijų fondą	iš Valstybinio socialinio draudimo fondo 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)	1 273 515
		629 207
Valstybinio socialinio draudimo fondo sumokėti delspinigiai		-
Iš garantijų rezervo sumokėtos lėšos		-
Iš kitų pensijų fondų pervestos lėšos	iš tos pačios pensijų kaupimo bendrovės	46 107
	iš kitos pensijų kaupimo bendrovės	4 654
Kitos gautos lėšos (nurodyti šaltinį ir gautų lėšų sumą), iš viso		-

29. Išmokėtos lėšos:

Bendra išmokėtų lėšų suma		1 988 424
Pensijų išmokos	vienkartinės išmokos dalyviams	1 459 837
	periodinės išmokos dalyviams	-
	išmokos anuiteto įsigijimui	-
Į kitus pensijų fondus pervestos lėšos	valdomus tos pačios pensijų kaupimo bendrovės	135 256
	valdomus kitos pensijų kaupimo bendrovės	16 013
Išstojusiems dalyviams išmokėtos lėšos (pildoma tik papildomo savanoriško kaupimo pensijų fondų atveju)		320 241
Paveldėtojams išmokėtos lėšos		57 077
Kitais pagrindais išmokėtos lėšos (nurodyti šaltinį ir išmokėtų lėšų sumą), iš viso		-

IX. INFORMACIJA APIE GARANTIJŲ REZERVĄ

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

-

X. INFORMACIJA APIE PENSIJŲ FONDO REIKMĖMS PASISKOLINTAS LĖŠAS

31. Pensijų fondo reikmėms pasiskolintos lėšos ataskaitinio laikotarpio pabaigoje:

(Žr. 23.3. punktas, 9 PASTABA)

XI. KITA INFORMACIJA

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



Vieneto vertė litais nuo fondo veiklos pradžios

XII. ATSAKINGI ASMENYS

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

-

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

-

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

-

36. Asmenys, atsakingi už ataskaitoje pateiktą informaciją:

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

Tvirtinu _____ Gediminas Milieška, generalinis direktorius,
tel. (8 5) 268 1594, faks. (8 5) 268 1575, e. paštas info.invest@seb .lt

Tvirtinu _____ Inga Riabovaitė, Operacijų departamento vadovė,
tel. (8 5) 268 1594, faks. (8 5) 268 1575, e. paštas info.invest@seb .lt

Tvirtinu _____ Sonata Šablinskaitė-Braškienė, vyriausioji buhalterė,
tel. (8 5) 268 1594, faks. (8 5) 268 1575, e. paštas info.invest@seb .lt;

36.2. jeigu ataskaitą rengia konsultantai arba ji rengiama padedant konsultantams, nurodyti konsultantų vardus, pavardes, telefonų ir faksų numerius, el. pašto adresus (jeigu konsultantas yra juridinis asmuo, nurodyti jo pavadinimą, telefonų ir faksų numerius, el. pašto adresą bei konsultanto atstovo(-ų) vardą, pavardę); pažymėti, kokias konkrečias dalis rengė konsultantai arba kokios dalys parengtos jiems padedant, ir nurodyti konsultantų atsakomybės ribas.

-