

**2015 metų sausio – gruodžio  
mėnesių ataskaita**  
SEB Pensija 1

2015 m. gruodžio 31 d.

# Turinys

I. Bendroji informacija	2
II. Grynųjų aktyvų, apskaitos vienetų skaičius ir vertė	2
III. Atskaitymai iš pensijų turto	2
IV. Informacija apie pensijų fondo investicinių priemonių portfelį	3
V. Pensijų fondo lyginamasis indeksas, investicijų grąža ir rizikos rodikliai	3
VI. Pensijų fondo finansinė būklė	5
VII. Informacija apie pensijų fondo dalyvius	24
VIII. Išoriniai pinigų srautai	24
IX. Informacija apie garantijų rezervą	24
X. Informacija apie pensijų fondo reikmėms pasiskolintas lėšas	25
XI. Kita informacija	25
XII. Atsakingi asmenys	25

# I. Bendroji informacija

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

Valstybinio socialinio draudimo įmokos dalies kaupimo konservatyvaus investavimo pensijų fondas *SEB pensija 1*, taisyklių Nr. PFV01-K001-001(009).

2. Ataskaitinis laikotarpis, už kurį pateikta ataskaita – 2015 metų dvylika mėnesių

3. Duomenys apie valdymo įmonę:

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

3.2. buveinė (adresas) – J. Balčikonio g. 3, Vilnius, Lietuvos Respublika;

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

tel. (8 5) 268 1528

faks. (8 5) 268 1575

el. paštas info.invest@seb.lt

interneto adresas www.seb.lt;

3.4. veiklos licencijos numeris – VJK – 001;

3.5. pensijų fondo valdytojo vardas, pavardė, pareigos (asmuo ar asmenys, priimančys investicinius sprendimus) – Ignas Pliuškyš, Investicijų valdymo grupės vadovas.

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. 22.3. punktas, 2 Pastaba)

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

(Žr. 22.3. punktas, 3 Pastaba)

## III. Atskaitymai iš pensijų turto

7. 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).

(Žr. 22.3. punktas, 20 Pastaba)

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

(Žr. 22.3. punktas, 9 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 (eurais) nuo pensijų fondo dalyvio įmokų esant dabartiniams atskaitymų dydžiai ir kokią sumą jis atgautų po 1, 3, 5, 10 metų, jei būtų investuota 3 000 Eur, o metinė investicijų grąža – 5 proc.

	Po 1 metų	Po 3 metų	Po 5 metų	Po 10 metų
Sumokėta atskaitymų, Eur	49,79	91,97	137,89	271,28
Sukauptą suma, jei nebūtų atskaitymų, Eur	3 150,00	3 472,88	3 828,84	4 886,68
Sukauptą suma, esant dabartiniams atskaitymų dydžiai, Eur	3 098,71	3 373,11	3 671,81	4 539,46

## IV. Informacija apie pensijų fondo investicinių priemonių portfelį

11. Ataskaitinio laikotarpio pabaigos investicinių priemonių portfelio sudėtis.

(Žr. 22.3. punktas, 5 Pastaba)

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

Priemonės pavadinimas	Priemonės rūšis	Pelnas/nuostolis valiuta	Valiutos kodas	Priemonės panaudojimo tikslas	Pastabos
CME USD/EUR CURRENCY FUTURE	Ateities sandoris (angl. future )	(333 825)	USD	Valiutų kursų svyravimo rizikos valdymas	Reguliuojamų rinkų IP
EURO BOBL FUTURE	Ateities sandoris (angl. future )	(110 050)	EUR	Palūkanų normų rizikos valdymas	Reguliuojamų rinkų IP
EURO BUND FUTURE	Ateities sandoris (angl. future )	99 040	EUR	Palūkanų normų rizikos valdymas	Reguliuojamų rinkų IP
EURO SCHATZ FUTURE	Ateities sandoris (angl. future )	(28 970)	EUR	Palūkanų normų rizikos valdymas	Reguliuojamų rinkų IP

13. 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.

(Žr. 22.3. punktas, 8 Pastaba)

14. Pagal sandorius dėl išvestinių finansinių priemonių prisiimta rizikos apimtis ataskaitinio laikotarpio pabaigoje (atskirai nurodyti sumas pagal skirtingas įsigytų išvestinių finansinių priemonių kategorijas).

Prisiimtos rizikos apimtys skaičiavimui įmonė naudoja įsipareigojimų metodą (angl. commitment approach) ir perskaičiuoja (konvertuoja) kiekvieną išvestinių finansinių priemonių poziciją į tapačias pozicijas pagal šios išvestinės finansinės priemonės bazinio turto rinkos vertę (standartinis įsipareigojimų metodas (angl. standard commitment approach)). Ataskaitinio laikotarpio pabaigoje prisiimtos rizikos nebuvo.

15. 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.

16. Nurodyti veiksnus, 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. Europos centrinio banko (ECB) vykdyta vyriausybės obligacijų supirkimo programa.** Kovo mėnesį ECB pradėta vykdyti programa sukūrė didelę paklausą vyriausybės obligacijoms, todėl jų kainos kilo, o pajamingumas toliau mažėjo. Tai turėjo teigiamą įtaką fondo vieneto vertei.
- 2. Stabili Lietuvos ekonominė ir politinė situacija toliau mažino šalies kredito riziką.** Dėl to mažėjo vyriausybės obligacijų pajamingumas ir kilo jų kaina. Tai turėjo teigiamą įtaką fondo vieneto vertei.

## V. Pensijų fondo lyginamasis indeksas, investicijų grąža ir rizikos rodikliai

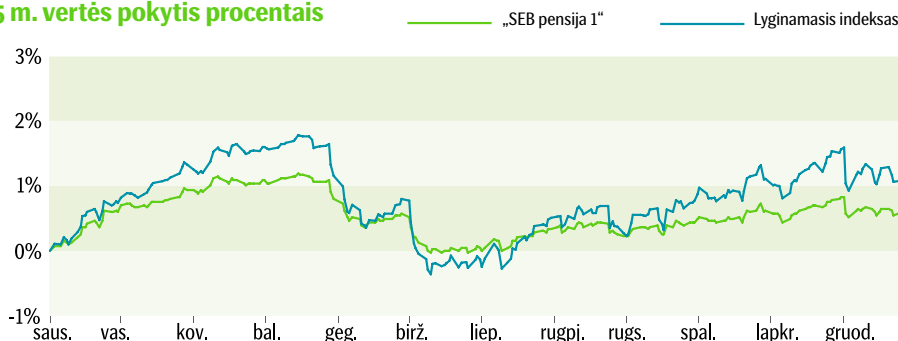
17. Pensijų fondo lyginamasis indeksas ir trumpas jo apibūdinimas (sudėtis, jei lyginamasis indeksas yra sudėtinis, kokias finansų rinkas, turto klases atspindi). Jeigu per ataskaitinį laikotarpį lyginamasis indeksas buvo pakeistas, turi būti pateikta informacija ir apie prieš tai galiojusį lyginamąjį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

(Žr. 22.3. punktas, 19 Pastaba)

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

(Žr. 22.3. punktas, 18 Pastaba)

### 2015 m. vertės pokytis procentais



19. Jei pensijų fondo reklamoje buvo naudojamos investicijų grąžos prognozės, nurodyti prognozuotą dydį, palyginti neatitikimus su faktine grąža ir pateikti galimas neatitikimų priežastis.

Pensijų kaupimo sutartyje nurodyta, kad fondo *SEB pensija 1* ilgojo laikotarpio tikėtina vidutinė metų grąža yra 5 procentai. Apskaičiuojant tikėtiną pensiją SEB pensijų skaičiuokle, buvo pasirinkta prielaida, kad tikėtina vidutinė metų grąža yra 2 procentai. Faktiškai 2015 metų grąža buvo 0,57 procento. Pensijų fondo investicijų grąža buvo mažesnė už prognozuotą pensijų kaupimo sutartyse ir apskaičiuojant pensiją skaičiuokle.

2015 metais vyriausybės obligacijų palūkanos išliko labai žemos, todėl obligacijos uždirbo žymiai mažesnę grąžą negu yra istorinis vidurkis. Visgi prognozuojant tikėtiną fondo grąžą atsižvelgiama ir į ilgalaikį infliacijos lygį bei siekiama, kad fondas užtikrintų teigiamą realią grąžą, t.y. grąžą atėmus infliacijos normą. Infliacija Lietuvoje 2015 metais buvo neigiama (fiksotas kainų lygio smukimas), tad fondo reali grąža buvo teigiama.

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

(Žr. 22.3. punktas, 18 Pastaba)

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

-

## VI. Pensijų fondo finansinė būklė

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

22.1. grynujų aktyvų ataskaitą;

### Grynujų aktyvų ataskaita (EUR)

2015 m. gruodžio 31 d.

Eil. nr.	Straipsniai	Pastabos Nr.	2015 12 31	2014 12 31
<b>A.</b>	<b>TURTAS</b>		<b>78 063 929</b>	<b>74 454 818</b>
<b>I.</b>	<b>PINIGAI</b>	<b>5</b>	<b>8 807 704</b>	<b>982 058</b>
<b>II.</b>	<b>TERMINUOTIEJI INDĖLIAI</b>		<b>-</b>	<b>4 630 004</b>
<b>III.</b>	<b>PINIGŲ RINKOS PRIEMONĖS</b>		<b>-</b>	<b>-</b>
III.1.	Valstybės išdo vekseliai		-	-
III.2.	Kitos pinigų rinkos priemonės		-	-
<b>IV.</b>	<b>PERLEIDŽIAMIEJI VERTYBINIAI POPIERIAI</b>	<b>4, 5, 6</b>	<b>69 221 779</b>	<b>68 772 585</b>
IV.1.	Ne nuosavybės vertybiniai popieriai		69 221 779	68 772 585
IV.1.1.	Vyriausybės ir centrinių bankų arba jų garantuoti ne nuosavybės vertybiniai popieriai		69 221 779	68 772 585
IV.1.2.	Kiti ne nuosavybės vertybiniai popieriai		-	-
IV.2.	Nuosavybės vertybiniai popieriai		-	-
IV.3.	Kitų kolektyvinio investavimo subjektų investiciniai vienetai ir akcijos		-	-
<b>V.</b>	<b>SUMOKĖTI AVANSAI</b>		<b>-</b>	<b>-</b>
<b>VI.</b>	<b>GAUTINOS SUMOS</b>	<b>5</b>	<b>34 446</b>	<b>1</b>
VI.1.	Investicijų pardavimo sandorių gautinos sumos		-	-
VI.2.	Kitos gautinos sumos		34 446	1
<b>VII.</b>	<b>INVESTICINIS IR KITAS TURTAS</b>	<b>5,8</b>	<b>-</b>	<b>70 170</b>
VII.1.	Investicinis turtas		-	-
VII.2.	Išvestinės finansinės priemonės	8	-	70 170
VII.3.	Kitas turtas		-	-
<b>B.</b>	<b>ĮSIPAREIGOJIMAI</b>	<b>5, 8</b>	<b>427 199</b>	<b>317 368</b>
<b>I.</b>	<b>Mokėtinos sumos</b>		<b>421 984</b>	<b>225 573</b>
I.1.	Už finansinį ir investicinį turtą mokėtinos sumos		-	-
I.2.	Valdymo įmonei ir depozitoriumui mokėtinos sumos	13	45 974	39 986
I.3.	Kitos mokėtinos sumos		376 010	185 587
<b>II.</b>	<b>Sukauptos sąnaudos</b>		<b>-</b>	<b>-</b>
<b>III.</b>	<b>Finansinės skolos kredito įstaigoms</b>		<b>-</b>	<b>-</b>
<b>IV.</b>	<b>Įsipareigojimai pagal išvestinių finansinių priemonių sutartis</b>	<b>8</b>	<b>5 215</b>	<b>91 795</b>
<b>V.</b>	<b>Kiti įsipareigojimai</b>		<b>-</b>	<b>-</b>
<b>C.</b>	<b>GRYNIEJI AKTYVAI</b>	<b>2</b>	<b>77 636 730</b>	<b>74 137 450</b>

7 – 23 puslapiuose pateiktas aiškinamasis raštas yra neatskiriama šių finansinių ataskaitų dalis.

22.2. grynųjų aktyvų pokyčių ataskaitą;

## Grynųjų aktyvų pokyčių ataskaita (EUR)

2015 m. gruodžio 31 d.

Eil. nr.	Straipsniai	Pastabos Nr.	2015 01 01 - 2015 12 31	2014 01 01 - 2014 12 31
<b>I.</b>	<b>GRYNUJŲ AKTYVŲ VERTĖ ATASKAITINIO LAIKOTARPIO PRADŽIOJE</b>		<b>74 137 450</b>	<b>69 139 210</b>
<b>II.</b>	<b>GRYNUJŲ AKTYVŲ VERTĖS PADIDĖJIMAS</b>		<b>10 027 761</b>	<b>9 887 625</b>
II.1.	Dalyvių įmokos į fondą	3, 21	5 529 084	5 454 522
II.2.	Iš kitų fondų gautos sumos	3, 21	2 656 333	906 521
II.3.	Garantinės įmokos		-	-
II.4.	Investicinės pajamos		52	3 989
II.4.1.	Palūkanų pajamos		52	3 989
II.4.2.	Dividendai		-	-
II.4.3.	Nuomos pajamos		-	-
II.5.	Pelnas dėl investicijų vertės pasikeitimo ir pardavimo	4	1 596 218	3 416 463
II.6.	Pelnas dėl užsienio valiutos kursų pokyčio		160 684	38 122
II.7.	Išvestinių finansinių priemonių pelnas		85 390	68 008
II.8.	Kitas grynųjų aktyvų vertės padidėjimas		-	-
	<b>PADIDĖJO IŠ VISO:</b>		<b>10 027 761</b>	<b>9 887 625</b>
<b>III.</b>	<b>GRYNUJŲ AKTYVŲ VERTĖS SUMAŽĖJIMAS</b>		<b>6 528 481</b>	<b>4 889 385</b>
III.1.	Išmokos fondo dalyviams	3, 21	2 471 778	2 317 767
III.2.	Išmokos kitiems fondams	3, 21	2 581 744	1 417 530
III.3.	Nuostoliai dėl investicijų vertės pasikeitimo ir pardavimo	4	730 094	500 911
III.4.	Nuostoliai dėl užsienio valiutos kursų pokyčio		126 619	29 369
III.5.	Išvestinių finansinių priemonių sandorių nuostoliai		68 980	75 395
III.6.	Valdymo sąnaudos:		549 266	548 412
III.6.1.	Atlyginimas valdymo įmonei	20	549 266	548 412
III.6.2.	Atlyginimas depozitoriumui		-	-
III.6.3.	Atlyginimas tarpininkams		-	-
III.6.4.	Audito sąnaudos		-	-
III.6.5.	Palūkanų sąnaudos		-	-
III.6.6.	Kitos sąnaudos		-	-
III.7.	Kitas grynųjų aktyvų vertės sumažėjimas		-	-
III.8.	Sąnaudų kompensavimas (-)		-	-
	<b>SUMAŽĖJO IŠ VISO:</b>		<b>6 528 480</b>	<b>4 889 385</b>
<b>IV.</b>	<b>Grynųjų aktyvų vertės pokytis</b>		<b>3 499 280</b>	<b>4 998 240</b>
<b>V.</b>	<b>Pelno paskirstymas</b>		<b>-</b>	<b>-</b>
<b>VI.</b>	<b>GRYNUJŲ AKTYVŲ VERTĖ ATASKAITINIO LAIKOTARPIO PABAIGOJE</b>	<b>2</b>	<b>77 636 730</b>	<b>74 137 450</b>

7 – 23 puslapiuose pateiktas aiškinamasis raštas yra neatskiriama šių finansinių ataskaitų dalis.

22.3. aiškinamąjį raštą.

# Aiškinamasis raštas

## Bendroji informacija

Valstybinio socialinio draudimo įmokos dalies kaupimo konservatyvaus investavimo pensijų fondo *SEB pensija 1* (toliau – Fondas) taisyklės Nr. PF-V01-K001-001(001) patvirtino Lietuvos Respublikos vertybinių popierių komisija 2003 m. rugpjūčio 28 d. (paskutiniai pakeitimai įsigaliojo – 2013 m. kovo 1 d.). 2006 m. vasario 23 d. pensijų fondo pavadinimas pakeistas į *SEB pensija 1*.

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

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

Fondo auditą atlieka UAB *PricewaterhouseCoopers*, įmonės kodas 111473315, buveinės adresas J.Jasinskio g. 16B, LT-03163 Vilnius, veikianti pagal 2005 m. gruodžio 20 d. Lietuvos auditorių rūmų pažymėjimą Nr.001273.

## Apskaitos principai

Finansinės atskaitos parengtos vadovaujantis Verslo apskaitos standartais, bei kitais Lietuvos Respublikoje finansinę apskaitą reglamentuojančiais teisės aktais.

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

Finansinės atskaitos 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 – eurai (EUR). 2015 m. sausio 1 d. Lietuva prisijungė prie euro zonos ir jos valiuta tapo euras. Litai buvo pakeisti į eurus santykiu 3,4528 lito už 1 eurą. Bendrovė perskaičiavo palyginamuosius skaičius iš litų į eurus taikydama oficialų lito ir euro kursą: 1 euras = 3,4528 Lt. Joks pelnas (nuostolis) dėl valiutų perskaičiavimo pripažintas nebuvo.

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

## (a) Finansinės rizikos valdymo politika

Su Fondo investicijomis yra susijusi ši rizika:

1. palūkanų normų rizika. Investavimo objektai, kaip ir daugelis skolos VP, susiję su rizika, kad VP vertė gali sumažėti ar padidėti dėl pasikeitusių palūkanų normų, t. y. investicijų vertė mažėja didėjant palūkanų normoms, ir atvirkščiai, investicijų vertė didėja, kai palūkanų normos mažėja. Valdydama šią riziką, bendrovė gali naudoti išvestines finansines priemones ir keisti vidutinę fondo obligacijų finansinę trukmę;
2. rinkų ir kredito rizika. Nors konkretūs VP gali suteikti galimybę gauti didesnę investicijų grąžą negu visa rinka ar susijęs rinkos segmentas, visos rinkos vertė gali sumažėti ar padidėti dėl besikeičiančių palūkanų normų, naujo priežiūros institucijų nustatyto reglamentavimo, pasikeitusių ekonomikos sąlygų. VP kreditingumo kokybė priklauso nuo emitento sugebėjimo laiku mokėti palūkanas ir suėjus terminui išpirkti emisiją. Kuo mažesnis emitentui suteiktas kredito reitingas, tuo didesnė rizika, kad emitentas neįvykdys savo įsipareigojimų fondo dalyviams. VP kreditingumo rizika taip pat priklauso ir nuo banko, laiduojančio už konkrečios skolos VP, finansinio pajėgumo. Valdydama šią riziką, bendrovė gali naudoti išvestines finansines priemones, kurių vertė kinta kartu su emitento kreditingumo kokybe;
3. VP pasirinkimo rizika. Nors fondo turtas investuojamas į fiksuoto pajamingumo VP, kurių vertė paprastai kinta nedaug, išlieka rizika, kad įsigytų VP kaina gali skirtis nuo prognozuotos kainos. Bendrovė valdo VP pasirinkimo riziką laikydamasi nustatytų fondo investicijų portfelio diversifikavimo reikalavimų;
4. valiutų kursų svyravimų rizika. Jei investuojama į VP užsienio valiuta, tai, keičiantis valiutos, kuria investuota, kursui euro atžvilgiu, kinta ir investicijų vertė. Bendrovė, valdydama valiutų kursų svyravimo riziką, turi teisę naudoti išvestines finansines priemones;
5. infliacijos / perkamosios galios rizika. Infliacijos tempams spartėjant, skolos VP atkarpų ir pagrindinės sumos perkamoji vertė ir kaina paprastai mažėja. Bendrovė gali valdyti šią riziką naudodama išvestines finansines priemones, kurių vertė kinta kartu su infliacijos augimo pokyčiu, gali investuoti į obligacijas, kurių vertė yra susijusi su infliacijos tempais ir keisti vidutinę fondo obligacijų finansinę trukmę.



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

## **(b) Turto padidėjimo ir sumažėjimo traukimo į apskaitą principai**

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

Vertybinių popierių padidėjusi vertės dalis traukiama į apskaitą, kai 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 įtraukimo į apskaitą (arba apskaitos nutraukimo) 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 išvestinių finansinių priemonių pelną, o vertės sumažėjusi dalis į išvestinių finansinių priemonių sandorių nuostolius.

## **(c) Grynųjų aktyvų vertės ir vienetų vertės apskaičiavimo principai**

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

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

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

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

Turto ar įsipareigojimų tikroji vertė nustatoma kiekvieną darbo dieną laikantis šių patikimumo lygių:

1. Tikroji vertė turi būti nustatoma pagal aktyviojoje rinkoje skelbiamas to turto ar įsipareigojimo kainas.
2. Jeigu aktyviojoje rinkoje to turto ar įsipareigojimo kainos neskelbiamos, tikroji vertė nustatoma pagal šioje ar kitoje rinkoje skelbiamas panašaus turto kainas ar kitus aktyviosios rinkos rodiklius arba apskaičiuojama remiantis šiais rodikliais.
3. Jeigu tikrosios vertės neįmanoma patikimai nustatyti pagal aukščiau išvardintus punktus, rinkose neprekiuojamo turto ar įsipareigojimo tikroji vertė nustatoma pagal kitokius ekonominius rodiklius ar informaciją.

Fondo turto ir įsipareigojimų vertės pasikeitimas pripažįstamas grynųjų aktyvų padidėjimu ar sumažėjimu ir parodomas grynųjų aktyvų pokyčio ataskaitoje.

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 - 0,29 Eur (dvidešimt devyni euro centai).

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

Nustačius klaidą, apskaičiuojama esamiems ir buvusiems dalyviams permokėta ar išmokėta per maža suma. Buvusiems dalyviams kompensuojamų nuostolių, susidariusių dėl klaidos, suma registruojama subjekto įsipareigojimuose.

## **(d) Pinigų ekvivalentai**

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

## (e) Finansinis turtas

Finansinis turtas apima pinigus ir pinigų ekvivalentus, gautinas sumas bei vertybinius popierius.

Finansinis turtas apskaitoje registruojamas tada, kai Bendrovė gauna arba pagal sutartį įgyja teisę gauti pinigus ar kitą finansinį turtą.

Gautinos sumos vertinamos įsigijimo savikaina, atėmus nuostolį dėl nuvertėjimo. Pinigai ir pinigų ekvivalentai vertinami įsigijimo savikaina. Vertybiniai popieriai į apskaitą traukiami įsigijimo savikaina, vėliau - tikrąja verte.

## (f) Finansiniai įsipareigojimai

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

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

Mokėtinos sumos už paslaugas vertinamos įsigijimo savikaina. Įsipareigojimai kredito įstaigoms pradinio pripažinimo metu vertinami įsigijimo savikaina, o vėliau - amortizuota savikaina.

## (g) Išvestinės finansinės priemonės

Iš išvestinės finansinės priemonės atsirandantis finansinis turtas ir finansiniai įsipareigojimai registruojami apskaitoje, kai pagal sutartį įgyjama teisė gauti turtą arba prievolę vykdyti įsipareigojimą.

Iš išvestinės finansinės priemonės atsirandantis finansinis turtas ir finansinis įsipareigojimas pirmą kartą apskaitoje registruojamas įsigijimo savikaina, vėliau - tikrąja verte.

## Kita informacija

Informacija apie investavimo, finansinės rizikos valdymo politiką, investicijų portfelio struktūrą ir atskaitymų valdymo įmonei ir depozitoriumui taisyklės pateikiamos [www.seb.lt](http://www.seb.lt).

### 1 Pastaba. Reikšmingos finansinių ataskaitų sumos ir jų pasikeitimo priežastys.

Reikšmingų pasikeitimų finansinių ataskaitų sumose nebuvo.

### 2 Pastaba. Grynujų aktyvų vertė, vienetų skaičius ir vertė ataskaitinio laikotarpio pradžioje ir pabaigoje, prieš metus, prieš dujus metus. Kai vienetai yra skirtingų klasių, duomenys pateikiami pagal klases.

	Ataskaitinio laikotarpio pradžioje (2015 01 02)	Ataskaitinio laikotarpio pabaigoje (2015 12 31)	Prieš metus (2014 12 31)	Prieš dujus metus (2013 12 31)
Grynujų aktyvų vertė, Eur	74 182 000	77 636 730	74 137 450	69 139 210
Apskaitos vieneto vertė, Eur	0,3847	0,3866	0,3844	0,3714
Apskaitos vienetų skaičius	192 823 627	200 844 179	192 880 751	186 148 552

### 3 Pastaba. Per ataskaitinį laikotarpį išplatintų (konvertuojant pinigus į vienetus) ir išpirktų (konvertuojant vienetus į pinigus) vienetų skaičius ir vertė.

#### 2015 m. gruodžio 31 d.

	Apskaitos vienetų skaičius	Vertė, Eur
Apskaitos vienetų skaičius (konvertuojant pinigines lėšas į apskaitos vienetus)*	21 179 626	8 240 027 **
Apskaitos vienetų skaičius (konvertuojant apskaitos vienetus į pinigines lėšas)	13 216 199	510 8132 **
Skirtumas	7 963 428	3 131 895

#### 2014 m. gruodžio 31 d.

	Apskaitos vienetų skaičius	Vertė, Eur
Apskaitos vienetų skaičius (konvertuojant pinigines lėšas į apskaitos vienetus)*	16 728 101	6 413 363 ***
Apskaitos vienetų skaičius (konvertuojant apskaitos vienetus į pinigines lėšas)	9 995 902	3 787 617 ***
Skirtumas	6 732 199	2 625 745

\* Apskaitos vienetų skaičiaus (konvertuojant pinigines lėšas į apskaitos vienetus) vertė pateikta kartu su įmokes mokesčiu.

\*\* Išplatintų ir išpirktų vienetų vertė nuo grynujų pokyčių ataskaitos punkty II.1 ir II.2 skiriasi 54 610 eurų dėl vienetų grąžintų atgal į fondą.

\*\*\* Išplatintų ir išpirktų vienetų vertė nuo grynujų pokyčių ataskaitos punkty II.1 ir II.2 skiriasi 52 320 eurų dėl vienetų grąžintų atgal į fondą.

**4 Pastaba. Investicijų vertės pokytis per ataskaitinį laikotarpį dėl jų įsigijimo, pardavimo ar išpirkimo ir tikrosios vertės pasikeitimo.**

**2015 m. gruodžio 31 d.**

Investicijos	Pokytis					
	praėjusio ataskaitinio laikotarpio pabaigoje	įsigyta	parduota (išpirkta)	teigiamas vertės pokytis	neigiamas vertės pokytis	ataskaitinio laikotarpio pabaigoje
Vyriausybės ir centrinių bankų arba jų garantuoti ne nuosavybės vertybiniai popieriai	68 772 585	30 463 707	(30 880 637)	1 596 218	(730 094)	69 221 779
<b>Iš viso:</b>	<b>68 772 585</b>	<b>30 463 707</b>	<b>(30 880 637)</b>	<b>1 596 218</b>	<b>(730 094)</b>	<b>69 221 779</b>

**2014 m. gruodžio 31 d.**

Investicijos	Pokytis					
	praėjusio ataskaitinio laikotarpio pabaigoje	įsigyta	parduota (išpirkta)	teigiamas vertės pokytis	neigiamas vertės pokytis	ataskaitinio laikotarpio pabaigoje
Vyriausybės ir centrinių bankų arba jų garantuoti ne nuosavybės vertybiniai popieriai	68 947 667	17 150 125	(20 240 759)	3 416 463	(500 911)	68 772 585
<b>Iš viso:</b>	<b>68 947 667</b>	<b>17 150 125</b>	<b>(20 240 759)</b>	<b>3 416 463</b>	<b>(500 911)</b>	<b>68 772 585</b>

**5 Pastaba. Investicijų portfelio struktūra. Parodomas investicijų pasiskirstymas pagal investavimo strategiją atitinkančius kriterijus nurodant, kokią subjekto grynujų aktyvų vertės dalį (procentais) sudaro investicijos. Atskleidžiami įvykiai, turėję reikšmingos įtakos investicijų portfeliui.**

**2015 m. gruodžio 31 d.**

Kodas	Emitento (KIS, kredito įstaigos, banko pavadinimas)	Šalis	ISIN kodas / Priemonės pavadinimas	Va-liuta	Kiekis, vnt.	Bendra nominali vertė, Eur	Investicinis sandoris (pozicija)	Sandorio (pozicijos) vertė	Kita sandorio šalis	Bendra įsigijimo vertė, Eur	Bendra rinkos vertė, Eur	Palūkanų norma, %	Rinka (šaltinis), pagal kurios duomenis nustatyta rinkos vertė (tinklalapio adresas)	Išpirkimo / konvertavimo data / terminas	Dalis GA / dalis portfelyje, %
<b>1 Akcijos</b>															
1.1	Nuosavybės vertybiniai popieriai, įtraukti į Oficialųjį ar įj atitinkantį prekybos sąrašą														
<b>Iš viso:</b>															
1.2	Nuosavybės vertybiniai popieriai, įtraukti į Papildomąjį ar įj atitinkantį prekybos sąrašą														
<b>Iš viso:</b>															
1.3	Nuosavybės vertybiniai popieriai, kuriais prekiaujama kitose reguliuojamose rinkose														
<b>Iš viso:</b>															
1.4	Išleidžiami nauji nuosavybės vertybiniai popieriai														
<b>Iš viso:</b>															
<b>Iš viso Akcijos:</b>															
<b>2 Obligacijos</b>															
2.1	Ne nuosavybės vertybiniai popieriai, įtraukti į Oficialųjį ar įj atitinkantį prekybos sąrašą														
<b>Iš viso:</b>															
2.2	Ne nuosavybės vertybiniai popieriai, įtraukti į Papildomąjį ar įj atitinkantį prekybos sąrašą														
	Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT1000607010	EUR	9 863	986 300				1 092 324	1 058 933	0,89		2021.08.28	1,36
	Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT0000611014	EUR	183 662 535	1 836 625				1 851 535	1 904 742	0,00		2016.02.10	2,45
	Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT0000605115	EUR	186 804 912	1 868 049				1 958 826	1 955 329	0,09		2016.10.20	2,52
	Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT0000607053	EUR	234 068 003	2 340 680				2 556 714	2 693 461	0,20		2018.03.28	3,47
	Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT0000603250	EUR	178 898 285	1 788 983				1 786 411	1 822 591	0,01		2016.02.01	2,35
	Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT0000607061	EUR	173 325 996	1 733 260				1 883 914	1 955 123	0,48		2019.10.25	2,52
	Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT0000605123	EUR	58 503 244	585 032				639 001	638 623	0,13		2017.06.07	0,82
	Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT0000607087	EUR	13 639 308	136 393				156 853	154 547	0,72		2020.10.03	0,20
	Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT0000605149	EUR	221 713 276	2 217 133				2 305 427	2 369 944	0,30		2018.10.31	3,05
	Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT0000603276	EUR	96 472 428	964 724				965 499	992 418	0,10		2017.02.27	1,28
	Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT0000610065	EUR	23 169 601	231 696				250 063	286 854	1,12		2023.02.28	0,37
	Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT0000605131	EUR	243 280 816	2 432 808				2 550 606	2 552 592	0,15		2017.08.31	3,29
	Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT1000600270	EUR	200	200 000				223 900	219 179	0,14		2017.09.22	0,28

Kodas	Emitento (KIS, kredito įstaigos, banko pavadinimas)	Šalis	ISIN kodas / Priemonės pavadinimas	Va-liuta	Kiekis, vnt.	Bendra nominali vertė, Eur	Investicinis sandoris (pozicija)	Sandorio (pozicijos) vertė	Kita sandorio šalis	Bendra įsigijimo vertė, Eur	Bendra rinkos vertė, Eur	Palūkanų norma, %	Rinka (šaltinis), pagal kurios duomenis nustatyta rinkos vertė (tinklalapio adresas)	Išpirkimo / konvertavimo data / terminas	Dalis GA / dalis portfelėje, %
	Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT0000607079	EUR	91 200 000	912 000				1 019 865	1 009 646	0,43		2019.08.30	1,30
	Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT0000650012	EUR	10 300	1 030 000				1 015 006	1 036 015	0,66		2020.05.27	1,33
	Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT0000630014	EUR	9 000	900 000				896 040	902 731	0,25		2018.05.20	1,16
	Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT0000630022	EUR	3 972	397 200				396 314	400 754	0,37		2019.03.30	0,52
	<b>Iš viso:</b>				<b>1 704 771 739</b>	<b>20 560 884</b>				<b>21 548 298</b>	<b>21 953 482</b>				<b>28,28</b>
2.3	Ne nuosavybės vertybiniai popieriai, kuriais prekiaujama kitose reguliuojamose rinkose														
	Lenkijos Respublika	PL	XS0210314299	EUR	1 225	1 225 000				1 432 944	1 469 836	0,20		2020.04.15	1,89
	Prancūzijos Respublika	FR	FR0010192997	EUR	2 170	2 170 000				1 994 118	2 640 445	0,13		2021.04.25	3,40
	Nyderlandų Karalystė	NL	NL0000102283	EUR	2 795	2 795 000				2 918 224	2 912 725	(0,47)		2016.07.15	3,75
	Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	XS0327304001	EUR	190	190 000				205 105	217 778	(0,06)		2018.02.07	0,28
	Rumunija	RO	XS0371163600	EUR	1 000	1 000 000				1 168 500	1 182 509	0,43		2018.06.18	1,52
	Lenkijos Respublika	PL	XS0371500611	EUR	1 200	1 200 000				1 210 847	1 403 299	(0,05)		2018.06.20	1,81
	Belgijos Karalyste	BE	BE0000309188	EUR	2 350	2 350 000				2 456 722	2 548 769	(0,39)		2017.03.28	3,28
	Vokietijos Federacinė Respublika	DE	DE0001135374	EUR	3 900	3 900 000				4 145 368	4 518 497	(0,28)		2019.01.04	5,82
	Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	XS0485991417	USD	321	293 795				228 935	356 830	2,56		2020.02.11	0,46
	Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	XS0541528682	USD	2 323	2 126 121				1 798 883	2 299 103	1,16		2017.09.14	2,96
	Slovėnijos Respublika	SI	SI0002103057	EUR	1 000	1 000 000				1 127 260	1 184 462	0,48		2020.01.26	1,53
	Slovėnijos Respublika	SI	SI0002103149	EUR	620	620 000				715 709	759 557	0,66		2021.01.18	0,98
	Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	XS0602546136	USD	130	118 982				96 685	139 548	2,90		2021.03.09	0,18
	Nyderlandų Karalystė	NL	NL0009348242	EUR	550	550 000				638 798	647 191	(0,04)		2020.07.15	0,83
	Prancūzijos Respublika	FR	FR0010415331	EUR	1 535	1 535 000				1 686 715	1 656 549	(0,34)		2017.04.25	2,13
	Vokietijos Federacinė Respublika	DE	DE0001135390	EUR	1 500	1 500 000				1 720 575	1 753 566	(0,16)		2020.01.04	2,26
	Prancūzijos Respublika	FR	FR0011059088	EUR	675	675 000				751 403	797 195	0,21		2021.10.25	1,03
	Prancūzijos Respublika	FR	FR0011196856	EUR	140	140 000				151 220	166 414	0,30		2022.04.25	0,21
	Vokietijos Federacinė Respublika	DE	DE0001135341	EUR	3 440	3 440 000				4 071 826	3 876 576	(0,35)		2018.01.04	4,99
	Prancūzijos Respublika	FR	FR0010604983	EUR	300	300 000				350 049	337 867	(0,27)		2018.04.25	0,44
	Nyderlandų Karalystė	NL	NL0010418810	EUR	2 706	2 706 000				2 846 623	2 990 348	0,44		2023.07.15	3,85
	Vokietijos Federacinė Respublika	DE	DE0001135473	EUR	1 510	1 510 000				1 550 321	1 679 583	0,15		2022.07.04	2,16
	Austrijos Respublika	AT	AT0000A08968	EUR	2 700	2 700 000				3 139 587	3 186 907	(0,20)		2019.03.15	4,10
	Lenkijos Respublika	PL	XS0874841066	EUR	1 400	1 400 000				1 444 800	1 485 165	0,13		2019.01.15	1,91
	Slovėnijos Respublika	SI	SI0002102794	EUR	1 250	1 250 000				1 418 312	1 458 331	0,23		2019.02.06	1,88
	Latvijos Respublika	LV	LV0000570125	EUR	2 150	2 150 000				2 222 086	2 269 108	0,48		2019.11.21	2,92
	Vokietijos Federacinė Respublika	DE	DE0001102358	EUR	3 030	3 030 000				3 209 073	3 330 140	0,41		2024.05.15	4,29
	<b>Iš viso:</b>				<b>42 110</b>	<b>41 874 898</b>				<b>44 700 688</b>	<b>47 268 298</b>				<b>60,88</b>
2.4	Išleidžiami nauji ne nuosavybės vertybiniai popieriai														
	<b>Iš viso:</b>														

Kodas	Emitento (KIS, kredito įstaigos, banko pavadinimas)	Šalis	ISIN kodas / Priemonės pavadinimas	Va-liuta	Kiekis, vnt.	Bendra nominali vertė, Eur	Investicinis sandoris (pozicija)	Sandorio (pozicijos) vertė	Kita sandorio šalis	Bendra įsigijimo vertė, Eur	Bendra rinkos vertė, Eur	Palūkanų norma, %	Rinka (šaltinis), pagal kurios duomenis nustatyta rinkos vertė (tinklalapio adresas)	Išpirkimo / konvertavimo data / terminas	Dalis GA / dalis portfelėje, %
<b>Iš viso Obligacijos:</b>					<b>1 704 813 849</b>	<b>62 435 782</b>				<b>66 248 986</b>	<b>69 221 779</b>				<b>89,16</b>
<b>3</b>	<b>KIS</b>														
3.1	Kolektyvinių investavimo subjektų, atitinkančių Kolektyvinių investavimo subjektų 61 str. 1d. reikalavimus, vienetai (akcijos)														
<b>Iš viso:</b>															
3.2	Kitų kolektyvinių investavimo subjektų vienetai														
<b>Iš viso:</b>															
<b>Iš viso KIS:</b>															
<b>4</b>	<b>Pinigų rinkos priemonės</b>														
4.1	Pinigų rinkos priemonės, kuriomis prekiaujama reguliuojamose rinkose														
<b>Iš viso:</b>															
4.2	Kitos pinigų rinkos priemonės														
<b>Iš viso:</b>															
<b>Iš viso Pinigų rinkos priemonės:</b>															
<b>5</b>	<b>Indėliai kredito įstaigose</b>														
<b>Iš viso:</b>															
<b>Iš viso Indėliai kredito įstaigose:</b>															
<b>6</b>	<b>Išvestinės investicinės priemonės</b>														
6.1	Išvestinės investicinės priemonės, kuriomis prekiaujama reguliuojamose rinkose														
	EURO SCHATZ FUTURE	CH	DUH6	EUR			FR0010415331, FR0010604983, DE0001135374, DE0001135341, AT0000A08968, BE0000309188, NL0000102283	(5 129 460)	EUREX		(1 840)		SEB Futures ataskaita, IS Bloomberg	2016.03.08	(0,00)
	CME USD/EUR CURRENCY FUTURE	US	ECH6	USD			XS0541528682, XS0485991417, XS0602546136, Grynujų pinigų likutis AB SEB banke	2 629 805	Chicago Mercantile Exchange		(4 565)		IS Bloomberg (t-1) dienos 15 val.	2016.03.14	(0,01)

Kodas	Emitento (KIS, kredito įstaigos, banko pavadinimas)	Šalis	ISIN kodas / Priemonės pavadinimas	Va-liuta	Kiekis, vnt.	Bendra nominali vertė, Eur	Investicinis sandoris (pozicija)	Sandorio (pozicijos) vertė	Kita sandorio šalis	Bendra įsigijimo vertė, Eur	Bendra rinkos vertė, Eur	Palūkanų norma, %	Rinka (šaltinis), pagal kurios duomenis nustatyta rinkos vertė (tinklalapio adresas)	Išpirkimo / konvertavimo data / terminas	Dalis GA / dalis portfelyje, %	
	EURO BOBL FUTURE	CH	OEH6	EUR			FR0010192997, FR0011059088, FR0011196856, DE0001135390, DE0001135473, NL0009348242	(914 690)	EUREX			1190		SEB Futures ataskaita, IS Bloomberg	2016.03.08	0,00
<b>Iš viso:</b>											<b>(5 215)</b>	<b>(0,01)</b>				
6.2	Kitos išvestinės investicinės priemonės															
<b>Iš viso:</b>											<b>(5 215)</b>	<b>(0,01)</b>				
<b>Iš viso Išvestinės investicinės priemonės:</b>											<b>(5 215)</b>	<b>(0,01)</b>				
<b>7</b>	<b>Pinigai</b>															
	AB SEB bankas	LT		USD							21 720	0,0927			0,03	
	AB SEB bankas	LT		EUR							8 308 802				10,70	
	SEB LONDON	GB		EUR							44 169				0,06	
	SEB LONDON	GB		USD							169 533				0,22	
	AB SEB bankas	LT		EUR							227 354				0,29	
	AB SEB bankas	LT		EUR							36 127				0,05	
<b>Iš viso:</b>											<b>8 807 704</b>	<b>11,34</b>				
<b>Iš viso Pinigai:</b>											<b>8 807 704</b>	<b>11,34</b>				
<b>8</b>	<b>Kitos priemonės, nenumatytos Kolektyvinio investavimo subjektų įstatymo 57 str. 1 d.</b>															
	Gautinos sumos										34 446				0,04	
	Mokėtinos sumos										421 984				(0,54)	
<b>Iš viso:</b>											<b>387 538</b>	<b>(0,50)</b>				
<b>Iš viso Kitos priemonės, nenumatytos Kolektyvinio investavimo subjektų įstatymo 57 str. 1 d.:</b>																
<b>9</b>	<b>IŠ VISO:</b>											<b>77 636 730</b>	<b>100,00</b>			

**2014 m. gruodžio 31 d.**

Kodas	Emitento (KIS, kredito įstaigos, banko pavadinimas)	Šalis	ISIN kodas / Priemonės pavadinimas	Va-liuta	Kiekis, vnt.	Bendra nominali vertė, Eur	Investicinis sandoris (pozicija)	Sandorio (pozicijos) vertė	Kita sandorio šalis	Bendra įsigijimo vertė, Eur	Bendra rinkos vertė, Eur	Palūkanų norma, %	Rinka (šaltinis), pagal kurios duomenis nustatyta rinkos vertė (tinklalapio adresas)	Išpirkimo / konvertavimo data / terminas	Dalis GA / dalis portfelyje, %
<b>1 Akcijos</b>															
1.1	Nuosavybės vertybiniai popieriai, įtraukti į Oficialųjį ar įj atitinkantį prekybos sąrašą														
<b>Iš viso:</b>															
1.2	Nuosavybės vertybiniai popieriai, įtraukti į Papildomąjį ar įj atitinkantį prekybos sąrašą														
<b>Iš viso:</b>															
1.3	Nuosavybės vertybiniai popieriai, kuriais prekiaujama kitose reguliuojamose rinkose														
<b>Iš viso:</b>															
1.4	Išleidžiami nauji nuosavybės vertybiniai popieriai														
<b>Iš viso:</b>															
<b>Iš viso Akcijos:</b>															
<b>2 Obligacijos</b>															
2.1	Ne nuosavybės vertybiniai popieriai, įtraukti į Oficialųjį ar įj atitinkantį prekybos sąrašą														
<b>Iš viso:</b>															
2.2	Ne nuosavybės vertybiniai popieriai, įtraukti į Papildomąjį ar įj atitinkantį prekybos sąrašą														
	Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT0000611014	LTL	63 415	1 836 625				1 851 535	1 968 011	0,30		2016.02.10	2,65
	Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT0000605107	LTL	9 921	287 332				299 309	301 264	0,15		2015.04.29	0,41
	Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT0000605115	LTL	64 500	1 868 049				1 958 826	2 029 500	0,50		2016.10.20	2,74
	Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT0000603243	LTL	84 895	2 458 729				2 564 217	2 563 843	0,15		2015.02.27	3,46
	Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT0000607053	LTL	80 819	2 340 680				2 556 714	2 761 238	0,80		2018.03.28	3,72
	Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT0000603250	LTL	61 770	1 788 983				1 786 411	1 851 533	0,28		2016.01.31	2,50
	Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT0000607061	LTL	59 846	1 733 260				1 883 915	1 955 257	1,10		2019.10.25	2,64
	Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT0000605123	LTL	20 200	585 032				639 001	657 612	0,65		2017.06.07	0,89
	Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT0000605149	LTL	68 957	1 997 133				2 068 088	2 135 078	0,88		2018.10.31	2,88
	Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT0000603276	LTL	33 310	964 724				965 499	995 982	0,58		2017.02.27	1,34
	Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT0000610065	LTL	8 000	231 696				250 063	280 245	1,78		2023.02.28	0,38
	Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT0000605131	LTL	84 000	2 432 808				2 550 606	2 577 216	0,68		2017.08.31	3,48
<b>Iš viso:</b>					<b>639 633</b>	<b>18 525 052</b>				<b>19 374 184</b>	<b>20 076 779</b>				<b>27,08</b>
2.3	Ne nuosavybės vertybiniai popieriai, kuriais prekiaujama kitose reguliuojamose rinkose														



Kodas	Emitento (KIS, kredito įstaigos, banko pavadinimas)	Šalis	ISIN kodas / Priemonės pavadinimas	Va-liuta	Kiekis, vnt.	Bendra nominali vertė, Eur	Investicinis sandoris (pozicija)	Sandorio (pozicijos) vertė	Kita sandorio šalis	Bendra įsigijimo vertė, Eur	Bendra rinkos vertė, Eur	Palūkanų norma, %	Rinka (šaltinis), pagal kurios duomenis nustatyta rinkos vertė (tinklalapio adresas)	Išpirkimo / konvertavimo data / terminas	Dalis GA / dalis portfelyje, %
	Lenkijos Respublika	PL	XS0210314299	EUR	1 225	1 225 000				1 432 944	1 492 868	0,54		2020.04.15	2,01
	Prancūzijos Respublika	FR	FR0010192997	EUR	2 170	2 170 000				1 994 118	2 687 295	0,33		2021.04.25	3,62
	Nyderlandų Karalystė	NL	NL0000102283	EUR	2 795	2 795 000				2 918 224	3 019 580	(0,05)		2016.07.15	4,07
	Nyderlandų Karalystė	NL	NL0000102242	EUR	800	800 000				749 842	826 102	(0,09)		2015.07.15	1,11
	Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	XS0327304001	EUR	390	390 000				421 005	458 738	0,51		2018.02.07	0,62
	Lenkijos Respublika	PL	XS0371500611	EUR	1 200	1 200 000				1 210 847	1 453 797	0,36		2018.06.20	1,96
	Belgijos Karalyste	BE	BE0000309188	EUR	2 350	2 350 000				2 456 722	2 633 329	(0,05)		2017.03.28	3,55
	Vokietijos Federacine Respublika	DE	DE0001135374	EUR	3 900	3 900 000				4 145 368	4 641 932	(0,07)		2019.01.04	6,26
	Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	XS0485991417	USD	321	263 908				228 935	326 195	2,96		2020.02.11	0,44
	Vokietijos Federacine Respublika	DE	DE0001135283	EUR	1 250	1 250 000				1 306 831	1 290 784	(0,10)		2015.07.04	1,74
	Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	XS0541528682	USD	2 323	1 909 841				1 798 884	2 105 620	1,78		2017.09.14	2,84
	Slovėnijos Respublika	SI	SI0002103057	EUR	1 000	1 000 000				1 127 260	1 175 312	1,33		2020.01.26	1,59
	Slovėnijos Respublika	SI	SI0002103149	EUR	620	620 000				715 709	744 305	1,58		2021.01.18	1,00
	Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	XS0602546136	USD	130	106 879				96 685	126 762	3,15		2021.03.09	0,17
	Nyderlandų Karalystė	NL	NL0009348242	EUR	550	550 000				638 797	660 405	0,16		2020.07.15	0,89
	Prancūzijos Respublika	FR	FR0010415331	EUR	1 535	1 535 000				1 686 715	1 708 662	(0,04)		2017.04.25	2,30
	Vokietijos Federacine Respublika	DE	DE0001135390	EUR	1 500	1 500 000				1 720 575	1 792 386	(0,01)		2020.01.04	2,42
	Prancūzijos Respublika	FR	FR0011059088	EUR	675	675 000				751 403	808 985	0,38		2021.10.25	1,09
	Vokietijos Federacine Respublika	DE	DE0001135440	EUR	2 500	2 500 000				2 904 900	3 045 319	0,13		2021.07.04	4,11
	Prancūzijos Respublika	FR	FR0011196856	EUR	1 500	1 500 000				1 620 210	1 805 202	0,45		2022.04.25	2,43
	Vokietijos Federacine Respublika	DE	DE0001135341	EUR	3 440	3 440 000				4 071 826	3 999 212	(0,10)		2018.01.04	5,39
	Prancūzijos Respublika	FR	FR0010604983	EUR	300	300 000				350 049	347 894	(0,01)		2018.04.25	0,47
	Nyderlandų Karalystė	NL	NL0010418810	EUR	1 246	1 246 000				1 255 632	1 380 758	0,55		2023.07.15	1,86
	Vokietijos Federacine Respublika	DE	DE0001135473	EUR	1 510	1 510 000				1 550 321	1 693 254	0,24		2022.07.04	2,28
	Austrijos Respublika	AT	AT0000A08968	EUR	2 700	2 700 000				3 139 587	3 283 499	0,03		2019.03.15	4,43
	Lenkijos Respublika	PL	XS0874841066	EUR	1 400	1 400 000				1 444 800	1 491 017	0,39		2019.01.15	2,01
	Slovėnijos Respublika	SI	SI0002102794	EUR	1 250	1 250 000				1 418 312	1 467 894	0,98		2019.02.06	1,98
	Latvijos Respublika	LV	LV0000570125	EUR	2 150	2 150 000				2 222 086	2 228 700	1,17		2019.11.21	3,01
	<b>Iš viso:</b>				<b>42 730</b>	<b>42 236 628</b>				<b>45 378 587</b>	<b>48 695 806</b>				<b>65,68</b>
2.4	Išleidžiami nauji ne nuosavybės vertybiniai popieriai														
	<b>Iš viso:</b>														
	<b>Iš viso Obligacijos:</b>				<b>682 363</b>	<b>60 761 681</b>				<b>64 752 771</b>	<b>68 772 585</b>				<b>92,76</b>
<b>3</b>	<b>KIS</b>														
3.1	Kolektyvinių investavimo subjektų, atitinkančių Kolektyvinių investavimo subjektų 61 str. 1d. reikalavimus, vienetai (akcijos)														
	<b>Iš viso:</b>														

Kodas	Emitento (KIS, kredito įstaigos, banko pavadinimas)	Šalis	ISIN kodas / Priemonės pavadinimas	Va-liuta	Kiekis, vnt.	Bendra nominali vertė, Eur	Investicinis sandoris (pozicija)	Sandorio (pozicijos) vertė	Kita sandorio šalis	Bendra įsigijimo vertė, Eur	Bendra rinkos vertė, Eur	Palūkanų norma, %	Rinka (šaltinis), pagal kurios duomenis nustatyta rinkos vertė (tinklalapio adresas)	Išpirkimo / konvertavimo data / terminas	Dalis GA / dalis portfelėje, %
3.2	Kitų kolektyvinių investavimo subjektų vienetai														
<b>Iš viso:</b>															
<b>Iš viso KIS:</b>															
<b>4</b>	<b>Pinigų rinkos priemonės</b>														
4.1	Pinigų rinkos priemonės, kuriomis prekiaujama reguliuojamose rinkose														
<b>Iš viso:</b>															
4.2	Kitos pinigų rinkos priemonės														
<b>Iš viso:</b>															
<b>Iš viso Pinigų rinkos priemonės:</b>															
<b>5</b>	<b>Indėliai kredito įstaigose</b>														
	AB SEB bankas	LT		EUR							4 630 004	0,02		2015.01.06	6,25
<b>Iš viso:</b>															
<b>Iš viso Indėliai kredito įstaigose:</b>															
											<b>4 630 004</b>				<b>6,25</b>
											<b>4 630 004</b>				<b>6,25</b>
<b>6</b>	<b>Išvestinės investicinės priemonės</b>														
6.1	Išvestinės investicinės priemonės, kuriomis prekiaujama reguliuojamose rinkose														
	EUREX	CH	DUH5	EUR		DE0001135283, FR0010415331, NL0000102283, NL0000102242, BE0000309188	(3 554 880)		EUREX		(6 080)		SEB Futures ataskaita, IS Bloomberg	2015.03.06	(0,01)
	Chicago Mercantile Exchange	US	ECH5	USD		XS0541528682, XS0485991417, XS0602546136	2 376 696		Chicago Mercantile Exchange		(43 055)		IS Bloomberg (t-1) dienos 10 val.	2015.03.16	(0,06)
	EUREX	CH	OEH5	EUR		DE0001135341, DE0001135374	(7 035 120)		EUREX		(42 660)		SEB Futures ataskaita, IS Bloomberg	2015.03.06	(0,06)
	EUREX	CH	RXH5	EUR		DE0001135440, NL0010418810	3 585 010		EUREX		70 170		SEB Futures ataskaita, IS Bloomberg	2015.03.06	0,09
<b>Iš viso:</b>															
<b>(21 625)</b>															
<b>(0,03)</b>															
6.2	Kitos išvestinės investicinės priemonės														
<b>Iš viso:</b>															
<b>Iš viso Išvestinės investicinės priemonės:</b>															
<b>(21 625)</b>															
<b>(0,03)</b>															
<b>7</b>	<b>Pinigai</b>														
	AB SEB bankas	LT		LTL							591 801	0,0468			0,80
	AB SEB bankas	LT		LTL							166 598				0,22

Kodas	Emitento (KIS, kredito įstaigos, banko pavadinimas)	Šalis	ISIN kodas / Priemonės pavadinimas	Va-liuta	Kiekis, vnt.	Bendra nominali vertė, Eur	Investicinis sandoris (pozicija)	Sandorio (pozicijos) vertė	Kita sandorio šalis	Bendra įsigijimo vertė, Eur	Bendra rinkos vertė, Eur	Palūkanų norma, %	Rinka (šaltinis), pagal kurios duomenis nustatyta rinkos vertė (tinklalapio adresas)	Išpirkimo / konvertavimo data / terminas	Dalis GA / dalis portfelėje, %
	SEB LONDON	GB		USD							96 815				0,13
	AB SEB bankas	LT		EUR							6 130				0,01
	SEB LONDON	GB		EUR							120 714				0,16
	<b>Iš viso:</b>										<b>982 058</b>				<b>1,32</b>
	<b>Iš viso Pinigai:</b>										<b>982 058</b>				<b>1,32</b>
<b>8</b>	<b>Kitos priemonės, nenumatytos Kolektyvinio investavimo subjektų įstatymo 57 str. 1 d.</b>														
	Gautinos sumos										1				0,00
	Mokėtinos sumos										(225 573)				(0,30)
	<b>Iš viso:</b>										<b>(225 572)</b>				<b>(0,30)</b>
	<b>Iš viso Kitos priemonės, nenumatytos Kolektyvinio investavimo subjektų įstatymo 57 str. 1 d.:</b>														
<b>9</b>	<b>Iš viso:</b>										<b>74 137 450</b>				<b>100,00</b>

\* – 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 investavimo strategiją

## 6 Pastaba. Investicijų paskirstymas pagal investavimo strategiją atitinkančius kriterijus.

Investicijų pasiskirstymas	Ataskaitinio laikotarpio pabaigoje 2015 12 31		Ataskaitinio laikotarpio pradžioje 2014 12 31	
	Rinkos vertė, Eur	Dalis aktyvuose, %	Rinkos vertė, Eur	Dalis aktyvuose, %
<b>Pagal turto rūšis</b>				
Vyriausybės obligacijos	69 221 779	89,16	68 772 585	92,76
Imonių obligacijos	-	-	-	-
Išvestinės priemonės	(5 215)	(0,01)	(21 625)	(0,03)
Pinigų rinkos priemonės	8 420 166	10,85	5 386 490	7,27
<b>Iš viso:</b>	<b>77 636 730</b>	<b>100,00</b>	<b>74 137 450</b>	<b>100,00</b>
<b>Pagal regionus (tik obligacijos)</b>				
Lietuva	24 966 740	32,16	23 094 093	31,15
Išsivysčiusios rinkos	33 042 772	42,56	39 012 109	52,62
Kitos rinkos	11 212 267	14,44	6 666 382	8,99
<b>Iš viso:</b>	<b>69 221 779</b>	<b>89,16</b>	<b>68 772 585</b>	<b>92,76</b>

## 7 Pastaba. Investicijų, kurios apskaitoje nebuvo įvertintos tikrąja verte, pardavimo rezultatai (pelnas ir nuostoliai).

Investicijų, kurios apskaitoje nebuvo įvertintos tikrąja verte nebuvo.

## 8 Pastaba. Išvestinės finansinės priemonės ar jų grupės pagal 26-ąjį verslo apskaitos standartą „Išvestinės finansinės priemonės“.

Ataskaitiniu ir praėjusiu laikotarpiais fondas sudarė valiutos ateities (currency futures) ir obligacijų ateities (schatz, bund ir bobl futures) sandorius.

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

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

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

Sudaryti išvestinių investicinių priemonių sandoriai buvo taikomi norint valdyti valiutos ir bendros fondo palūkanų normos riziką.

### 2015 m. gruodžio 31 d. galiojė ateities sandoriai

Priemonės pavadinimas	Valiutos kodas	Išpirkimo data	Priemonės naudojimo tikslas
EURO SCHATZ FUTURE	EUR	2016.03.08	Palūkanų normų rizikos valdymas
CME USD/EUR CURRENCY FUTURE	USD	2016.03.14	Valiutų kursų svyravimo rizikos valdymas
EURO BOBL FUTURE	EUR	2016.03.08	Palūkanų normų rizikos valdymas

### 2014 m. gruodžio 31 d. galiojė ateities sandoriai

Priemonės pavadinimas	Valiutos kodas	Išpirkimo data	Priemonės naudojimo tikslas
EURO SCHATZ FUTURE	EUR	2015.03.06	Palūkanų normų rizikos valdymas
CME USD/EUR CURRENCY FUTURE	USD	2015.03.16	Valiutų kursų svyravimo rizikos valdymas
EURO BOBL FUTURE	EUR	2015.03.06	Palūkanų normų rizikos valdymas
EURO BUND FUTURE	EUR	2015.03.06	Palūkanų normų rizikos valdymas

## 9 Pastaba. Atlyginimo tarpininkams sąnaudos.

2015 m. gruodžio 31 d.

Tarpininko pavadinimas	Sumokėti mokesčiai, Eur	Ar susijęs su valdymo įmone
AB SEB bankas	394	Taip
Skandinaviska Enskilda Banken AB	1 796	Taip
<b>Iš viso:*</b>	<b>2 190</b>	-

2014 m. gruodžio 31 d.

Tarpininko pavadinimas	Sumokėti mokesčiai, Eur	Ar susijęs su valdymo įmone
AB SEB bankas	607	Taip
Skandinaviska Enskilda Banken AB	1 740	Taip
<b>Iš viso:*</b>	<b>2 347</b>	-

\* nurodyti mokesčiai nemažina pensijų fondo grynųjų aktyvų vertės. Bendrovė perveda nurodytus mokesčius į fondo sąskaitą.

## 10 Pastaba. Dalyviams apskaičiuoti ir (ar) išmokėti dividendai ar kitos išmokos, kurias išmokėjus vienetų skaičius nesikeičia.

Pensijų fondas dividendų nemoka.

## 11 Pastaba. Pasiskolintos ir paskolintos lėšos.

2015 m. gruodžio 31 d. ir 2014 m. gruodžio 31 d. fondas skolintų lėšų neturėjo.

## 12 Pastaba. Trečiosios šalies įsipareigojimai garantuoti subjekto pajamingumo dydį.

Įsipareigojimų nebuvo.

## 13 Pastaba. Sandorių su susijusiais asmenimis (valdymo įmone, tos pačios valdymo įmonės subjektais ir pan.) ataskaitinio ir praėjusio ataskaitinio laikotarpių sumos, suskirstytos į grupes, kita reikšminga informacija pagal 30-ąjį verslo apskaitos standartą „Susiję asmenys“.

Rodikliai	Per laikotarpį		Likutis datai	
	2015 01 01 - 2015 12 31	2014 01 01 - 2014 12 31	2015 12 31	2014 12 31
<b>AB SEB bankas</b>				
Pinigai laikomi banke	Žr. 5 pastaba	Žr. 5 pastaba	Žr. 5 pastaba	Žr. 5 pastaba
Komisinis mokestis už sandorius	Žr. 9 pastaba	Žr. 9 pastaba	-	-
<b>UAB SEB investicijų valdymas</b>				
Atskaitymai nuo įmokų	Žr. 20 pastaba	Žr. 20 pastaba	73	60
Atskaitymai nuo turto vertės	Žr. 20 pastaba	Žr. 20 pastaba	45 901	39 926
Už pensijų kaupimo bendrovės keitimą	Žr. 20 pastaba	Žr. 20 pastaba	-	-
<b>Skandinaviska Enskilda Banken AB</b>				
Komisinis mokestis už sandorius	Žr. 9 pastaba	Žr. 9 pastaba	-	-
Valdymo mokesčio į investuojamus fondus nuolaida	-	-	-	-
Investicijos į SEB grupės valdomus fondus	-	-	-	-
Pinigai laikomi banke	Žr. 5 pastaba	Žr. 5 pastaba	Žr. 5 pastaba	Žr. 5 pastaba

## 14 Pastaba. Reikšmingas apskaitinių įvertinimų, jeigu tokių buvo, pakeitimo poveikis ar pateiktos lyginamosios informacijos koregavimas dėl apskaitos politikos keitimo ar dėl klaidų taisymo pagal 7-ąjį verslo apskaitos standartą „Apskaitos politikos, apskaitinių įvertinimų keitimas ir klaidų taisymas“.

Siekiant teisingiau pateikti ne nuosavybės vertybinių popierių palūkanas, 2014 m. vyriausybės vertybinių popierių sukauptos palūkanos iškeltos iš grynųjų aktyvų pokyčių ataskaitos II.4.1 eilutės (2 286 170 Eur suma) į II.5 (1 580 935 Eur suma) bei III.3 (705 235 Eur suma) eilutes. Patikslintas klasifikavimas atitinka 2015 m. pateikimą bei VAS 39 nuostatas.

## 15 Pastaba. Trumpas reikšmingų pobalansinių įvykių, kurių neatskleidimas gali turėti reikšmingos įtakos įmonės finansinių ataskaitų vartotojų galimybei priimti sprendimus, apibūdinimas pagal 19-ąjį verslo apskaitos standartą „Atidėjiniai“, neapibrėžtieji įsipareigojimai ir turtas bei pobalansiniai įvykiai“.

Pobalansinių įvykių nebuvo.

**16 Pastaba. Po grynujų aktyvų skaičiavimo datos įvykę reikšmingi turto ir įsipareigojimų pokyčiai, neįtraukti į grynujų aktyvų vertę.**

Turto ir įsipareigojimų pokyčių neįtrauktų į grynujų aktyvų vertę nebuvo.

**17 Pastaba. Kita reikšminga informacija apie kolektyvinio investavimo subjekto ar pensijų fondo finansinę būklę, veiksniai ir aplinkybės, turėję įtakos subjekto turtui ar įsipareigojimams pagal 18-ąjį verslo apskaitos standartą „Finansinis turtas ir finansiniai įsipareigojimai“ ir kitus verslo apskaitos standartus.**

Nebuvo.

**18 Pastaba. Investicijų grąža ir investicijų grąžos lyginamoji informacija.**

**Investicinio vieneto vertės pokyčio, investicinių priemonių portfelio metinės investicijų bendrosios ir grynosios grąžos ir lyginamojo indekso reikšmės pokyčio rodikliai**

	Per ataskaitinį laikotarpį	Prieš metus	Prieš 2 metus	Prieš 10 metų
Apskaitos vieneto vertės pokytis, %*	0,57	3,49	(0,09)	2,21
Lyginamojo indekso reikšmės pokytis, %	1,08	4,70	(0,23)	-
Metinė grynoji investicijų grąža, %**	0,57	3,48	(0,09)	2,21
Apskaitos vieneto (akcijos) vertės pokyčio standartinis nuokrypis, %**	0,86	0,75	1,48	1,55
Lyginamojo indekso reikšmės pokyčio standartinis nuokrypis, %**	1,62	1,20	1,69	-
Apskaitos vieneto vertės ir lyginamojo indekso reikšmės koreliacijos koeficientas**	0,97	0,88	0,99	-
Indekso sekimo paklaida, %**	0,80	0,50	0,30	-
Alfa rodiklis, %**	(0,07)	0,56	0,12	-
Beta rodiklis**	0,59	0,63	0,92	-

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

\*\* Rodiklių paaiškinimai:

Metinė grynoji investicijų grąža – valstybinio socialinio draudimo įmokos dalies kaupimo pensijų fondo investicijų grąža, kurią apskaičiuojant atsižvelgiama į prekybą ir valdymo išlaidas.

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

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

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

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

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

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

**Investicinio fondo vidutinė investicijų grąža, vidutinis investicinio vieneto vertės pokytis ir vidutinis lyginamojo indekso reikšmės pokytis**

	Per paskutinius 3 metus	Per paskutinius 5 metus	Per paskutinius 10 metų	Nuo veiklos pradžios
Vidutinis apskaitos vieneto vertės pokytis, %*	1,31	2,41	2,47	2,53
Vidutinis pensijų fondo lyginamojo indekso reikšmės pokytis, %*	1,83	2,80	-	3,76
Vidutinė grynoji investicijų grąža, %*	1,31	2,35	2,00	1,44
Vidutinis apskaitos vieneto vertės pokyčio standartinis nuokrypis, %*	1,08	1,40	2,23	2,09

\*Rodiklių paaiškinimai:

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

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

Vidutinė grynoji investicijų grąža – metinių grynujų investicijų grąžų geometrinis vidurkis.

Vidutinis apskaitos vieneto vertės pokyčio standartinis nuokrypis – metinis apskaitos vieneto vertės pokyčio standartinis nuokrypis už nurodytą laikotarpį

**19 Pastaba. Lyginamojo indekso sudėtis ir pakeitimo priežastys.**

Turto klasė	Lyginamojo indekso pavadinimas	Dalis sudėtiniame lyginamajame indekse, %
Vakarų Europos vyriausybės obligacijos	Merrill Lynch EMU Direct Governments, AAA-A Rated, 1-10 Year	70
Lietuvos Respublikos Vyriausybės obligacijos	Lietuvos Respublikos Vyriausybės vertybinių popierių indeksas	30

Sudėtinis lyginamasis indeksas ataskaitiniu laikotarpiu nebuvo keičiamas.

**20 Pastaba. Atskaitymai (atskaitymų rūšys ir apskaičiuotos sumos) iš valstybinio socialinio draudimo įmokos dalies kaupimo fondo ar iš papildomo savanoriško pensijų kaupimo fondo turto portfelio apyvartumo rodiklis. Papildomo savanoriško pensijų kaupimo fondo atskaitymų dalis procentais palyginti su ataskaitinio laikotarpio vidutine grynųjų aktyvų verte. Jei per ataskaitinį laikotarpį keitėsi atskaitymų dydžiai atskirai pateikiamos kiekvieno nustatyto dydžio sumos. Valstybinio socialinio draudimo įmokos dalies kaupimo fondo bendras atskaitymų rodiklis. Papildomo savanoriško pensijų kaupimo fondo bendras išlaidų koeficientas. Jei yra skaičiuojamas valstybinio socialinio draudimo įmokos dalies kaupimo fondo ar papildomo savanoriško pensijų kaupimo fondo sąlyginis tikėtinas bendrasis išlaidų koeficientas pateikiama išsamesnė informacija apie jį.**

**2015 m. gruodžio 31 d.**

Atskaitymai	Taisyklėse numatyti maksimalūs dydžiai, %	Faktiškai taikomi atskaitymų dydžiai, %	Per ataskaitinį laikotarpį priskaičiuota atskaitymų suma, Eur
Nuo įmokų	1	1	55 329
Nuo turto vertės	0,65	0,65	493 262
Už keitimą			
fondo keitimas toje pačioje bendrovėje daugiau kaip kartą per metus	0,05	-	-
pensijų kaupimo bendrovės keitimas kartą per metus	0,05	0,05	675
pensijų kaupimo bendrovės keitimas daugiau kaip kartą per metus	0,05	-	-
<b>Iš viso:</b>			<b>549 266</b>
BAR, %*			0,72
Sąlyginis BIK ir (arba) tikėtinas sąlyginis BIK, %*			-
PAR (portfelio apyvartumo rodiklis)*			11,17

**2014 m. gruodžio 31 d.**

Atskaitymai	Taisyklėse numatyti maksimalūs dydžiai	Faktiškai taikomi atskaitymų dydžiai	Per ataskaitinį laikotarpį priskaičiuota atskaitymų suma, Eur
Nuo įmokų	1,5	1,5	81 835
Nuo turto vertės	0,65	0,65	465 992
Už keitimą			
fondo keitimas toje pačioje bendrovėje daugiau kaip kartą per metus	0,05	-	-
pensijų kaupimo bendrovės keitimas kartą per metus	0,05	0,05	585
pensijų kaupimo bendrovės keitimas daugiau kaip kartą per metus	0,05	-	-
<b>Iš viso:</b>			<b>548 412</b>
BAR, %*			0,76
Sąlyginis BIK ir (arba) tikėtinas sąlyginis BIK, %*			-
PAR (portfelio apyvartumo rodiklis)*			35,49

\*Rodiklių paaiškinimai:

Valstybinio socialinio draudimo įmokos dalies kaupimo pensijų fondo bendrasis atskaitymų rodiklis (BAR) – procentinis dydis, apskaičiuojamas bendrąsias veiklos išlaidas, kurias sudaro atskaitymai nuo pensijų įmokų ir nuo pensijų turto, dalijant iš vidutinės atitinkamo laikotarpio grynųjų aktyvų vertės.

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

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

## 21 Pastaba. Gautos ir išmokėtos lėšos.

2015 m. gruodžio 31 d.

Bendra gautų lėšų suma, Eur		8 185 417
Periodinės įmokos į pensijų fondą	iš Valstybinio socialinio draudimo fondo	5 529 082
	pačio dalyvio įmokėtos lėšos (pildoma tik papildomo savanoriško pensijų kaupimo pensijų fondo atveju)	-
	darbdavių ir kitų trečiųjų asmenų įmokėtos lėšos (pildoma tik papildomo savanoriško pensijų kaupimo pensijų fondo atveju)	-
Valstybinio socialinio draudimo fondo sumokėti delspinigiai		-
Iš garantijų rezervo sumokėtos lėšos		-
Iš kitų pensijų fondų pervestos lėšos	iš tos pačios pensijų kaupimo bendrovės	1 753 303
	iš kitos pensijų kaupimo bendrovės	903 030
Kitos gautos lėšos	kompensavimas klientams	2

Bendra išmokėtų lėšų suma, Eur		
Pensijų išmokos	vienkartinės išmokos dalyviams	2 041 677
	periodinės išmokos dalyviams	-
	išmokos anuiteto įsigijimui	189 522
Į kitus pensijų fondus pervestos lėšos	valdomus tos pačios pensijų kaupimo bendrovės	1 232 852
	valdomus kitos pensijų kaupimo bendrovės	1 348 892
Išstojusiems dalyviams išmokėtos lėšos (pildoma tik papildomo savanoriško kaupimo pensijų fondų atveju)		-
Paveldėtojams išmokėtos lėšos		240 579
Kitais pagrindais išmokėtos lėšos		-

2014 m. gruodžio 31 d.

Bendra gautų lėšų suma, Eur		6 361 043
Periodinės įmokos į pensijų fondą	iš Valstybinio socialinio draudimo fondo	5 454 522
	pačio dalyvio įmokėtos lėšos (pildoma tik papildomo savanoriško pensijų kaupimo pensijų fondo atveju)	-
	darbdavių ir kitų trečiųjų asmenų įmokėtos lėšos (pildoma tik papildomo savanoriško pensijų kaupimo pensijų fondo atveju)	-
Valstybinio socialinio draudimo fondo sumokėti delspinigiai		-
Iš garantijų rezervo sumokėtos lėšos		-
Iš kitų pensijų fondų pervestos lėšos	iš tos pačios pensijų kaupimo bendrovės	663 778
	iš kitos pensijų kaupimo bendrovės	242 742
Kitos gautos lėšos	kompensavimas klientams	1

Bendra išmokėtų lėšų suma, Eur		3 754 558*
Pensijų išmokos	vienkartinės išmokos dalyviams	1 919 944
	periodinės išmokos dalyviams	-
	išmokos anuiteto įsigijimui	181 819
Į kitus pensijų fondus pervestos lėšos	valdomus tos pačios pensijų kaupimo bendrovės	247 823
	valdomus kitos pensijų kaupimo bendrovės	1 169 374
Išstojusiems dalyviams išmokėtos lėšos (pildoma tik papildomo savanoriško kaupimo pensijų fondų atveju)		-
Paveldėtojams išmokėtos lėšos		235 264
Kitais pagrindais išmokėtos lėšos	pervedimas į ES fondus	334

\*Bendra išmokėtų lėšų suma nuo grynujų aktyvų pokyčio ataskaitos punktų III.1. ir III.2. skiriasi 19 261 Eur dėl vienetų grąžintų atgal į fondą.



## VII. Informacija apie pensijų fondo dalyvius

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

<b>Dalyvių skaičius ataskaitinio laikotarpio pradžioje</b>		<b>35 576</b>
Dalyvių skaičius ataskaitinio laikotarpio pabaigoje	dalyviai, pasinaudoję teise nukelti pensijų išmokos mokėjamą	3 486
	dalyviai, gaunantys periodines pensijų išmokas	-
	kiti dalyviai	31 237
<b>Iš viso:</b>		<b>34 723</b>
Dalyvių skaičiaus pokytis		(853)

24. Per ataskaitinį laikotarpį prisijungusių dalyvių skaičius:

<b>Bendras prisijungusių dalyvių skaičius</b>		<b>1 270</b>
Dalyviai, pensijų kaupimo sutartis sudarę pirmą kartą		533
Iš kitų pensijų fondų atėję dalyviai	iš tos pačios pensijų kaupimo bendrovės	347
	iš kitos pensijų kaupimo bendrovės	390

25. Per ataskaitinį laikotarpį pasitraukusių dalyvių skaičius:

<b>Bendras pasitraukusių dalyvių skaičius</b>		<b>2 123</b>
Į kitus pensijų fondus išėjusių dalyvių skaičius	valdomus tos pačios pensijų kaupimo bendrovės	432
	valdomus kitos pensijų kaupimo bendrovės	727
Baigusių dalyvavimą dalyvių skaičius	išstojusių (pildoma tik papildomo savanoriško pensijų kaupimo pensijų fondo atveju)	-
	sulaukusių nustatyto pensijos amžiaus ir pasinaudojusių teise į pensijų išmoką (vienkartinę išmoką, anuitetą ir jų derinį)	817
	dalyvių, pasinaudojusių Pensijų kaupimo įstatymo suteikta galimybe vienašališkai nutraukti pirmą kartą sudarytą sutartį	11
	mirusių dalyvių	136

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

		Dalyviai pagal amžių				iš viso:
		iki 30	nuo 30 iki 45	nuo 45 iki 60	nuo 60	
Dalyvių skaičius	<b>iš viso:</b>	<b>1 070</b>	<b>9 154</b>	<b>19 368</b>	<b>5 131</b>	<b>34 723</b>
	vyrų	496	4 686	8 432	2 867	16 481
	moterys	574	4 468	10 936	2 264	18 242
Dalyvių dalis, %	<b>iš viso:</b>	<b>100</b>	<b>100</b>	<b>100</b>	<b>100</b>	<b>100</b>
	vyrų	46	51	44	56	47
	moterys	54	49	56	44	53

## VIII. Išoriniai pinigų srautai

27. Per ataskaitinį laikotarpį faktiškai gautos lėšos.

(Žr. 22.3. punktas, 21 Pastaba)

28. Išmokėtos lėšos.

(Žr. 22.3. punktas, 21 Pastaba)

## IX. Informacija apie garantijų rezervą

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

-

## X. Informacija apie pensijų fondo reikmėms pasiskolintas lėšas

30. Pensijų fondo reikmėms pasiskolintos lėšos ataskaitinio laikotarpio pabaigoje.  
(Žr. 22.3. punktas, 11 Pastaba)

## XI. Kita informacija

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

**Viso laikotarpio vieneto vertė eurais**



## XII. Atsakingi asmenys

32. 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.

-

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

-

34. 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.

-

35. Asmenys, atsakingi už ataskaitoje pateiktą informaciją:

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

Tvirtinu \_\_\_\_\_

**Virgilijus Mirkės,**  
generalinis direktorius,  
tel. (8 5) 268 1528, faks. (8 5) 268 1575.,  
el. paštas info.invest@seb.lt

Tvirtinu \_\_\_\_\_

**Airdas Kuzminskas,**  
vyriausiasis buhalteris,  
tel. (8 5) 268 1528, faks. (8 5) 268 1575,  
el. paštas info.invest@seb.lt;

35.2. 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

