

**2017 metų sausio – birželio
mėnesių ataskaita**
SEB pensija 1+

2017 m. birželio 30 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	4
VI. Pensijų fondo finansinė būklė	4
VII. Informacija apie pensijų fondo dalyvius	18
VIII. Išoriniai pinigų srautai	18
IX. Informacija apie garantijų rezervą	18
X. Informacija apie pensijų fondo reikmėms pasiskolintas lėšas	19
XI. Kita informacija	19
XII. Atsakingi asmenys	19

I. Bendroji informacija

1. Pensijų fondo pavadinimas, visas pensijų fondo taisyklių, pagal kurias jis veikia, pavadinimas, Vertybinių popierių komisijos ar Lietuvos banko pensijų fondo taisyklėms suteiktas numeris.

(Žr. 17.3. punktą, Bendroji informacija)

2. Ataskaitinis laikotarpis, už kurį pateikta ataskaita – 2017 metų sausio – birželio mėnesių ataskaita.

3. Duomenys apie valdymo įmonę.

(Žr. 17.3. punktą, Bendroji informacija)

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

(Žr. 17.3. punktą, Bendroji informacija)

II. Grynųjų aktyvų, apskaitos vienetų skaičius ir vertė

5. Nurodyti grynųjų aktyvų, apskaitos vienetų skaičių ir vertę.

(Žr. 17.3. punktą, 2 Pastaba)

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

(Žr. 17.3. punktą, 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).

Atskaitymai	Atskaitymo dydis		Per ataskaitinį laikotarpį priskaičiuotų atskaitymų suma, Eur	% nuo ataskaitinio laikotarpio vidutinės grynųjų aktyvų vertės
	maksimalus, nustatytas sudarymo dokumentuose, %	ataskaitiniu laikotarpiu taikytas, %		
Už valdymą				
nekinamas dydis	0,65	0,65	21 943	0,33
sėkmės mokestis	-	-	-	-
Depozitoriumui	0,3	0,05	1 693	0,03
Už sandorių sudarymą			119	-
Už auditą			955	-
Kitos veiklos išlaidos (nurodyti išlaidų rūšis)			-	-
Išlaidų, įskaičiuojamų į BIK, suma				
BIK % nuo GAV*				
Visų išlaidų suma:			24 710	0,36

PAR (praėjusio analogiško ataskaitinio laikotarpio PAR)*

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

(Žr. 17.3. punktą, 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.

-

IV. Informacija apie pensijų fondo investicinių priemonių portfelį

11. Ataskaitinio laikotarpio pabaigos investicinių priemonių portfelio sudėtis.

(Žr. 17.3. 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	Pelnas/nuostolis EUR	Priemonės panaudojimo tikslas	Pastabos
CME USD/EUR CURRENCY FUTURE	Ateities sandoris (angl. future)	27 636	USD	24 766	Valiutų kursų svyravimo rizikos valdymas	Reguliuojamų rinkų IP
EURO BOBL FUTURE	Ateities sandoris (angl. future)	(2 596)	EUR	(2 596)	Palūkanų normų rizikos valdymas	Reguliuojamų rinkų IP
EURO SCHATZ FUTURE	Ateities sandoris (angl. future)	(1 347)	EUR	(1 347)	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. 17.3. 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 – buvo investuojama į vyriausybės ir įmonių skolos vertybinius popierius, taip pat į šias priemones investuojančius fondus.

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

Ataskaitiniu laikotarpiu fondo investicijų portfelio vertės pokyčiams didžiausią įtaką turėjo:

1. Europos Centrinio Banko (ECB) vykdoma skatinamoji pinigų politika ir nustatyta neigiamą bazinę palūkanų norma. Tai lėmė, kad daugumos trumpo laikotarpio Vakarų Europos vyriausybės obligacijų pajamingumas buvo neigiamas, tad daugumos šių obligacijų kainos smuko. Tai turėjo neigiamą įtaką fondo vieneto vertei;
2. Lietuvos ekonominė ir politinė padėtis išliko stabili, todėl toliau mažėjo šalies kredito rizika, vyriausybės obligacijų pajamingumas ir kilo jų kaina. Tai turėjo teigiamą įtaką fondo vieneto vertei;
3. JAV Federalinio atsargų banko (FED) kelis kartus pakelta palūkanų norma. FED padidintos palūkanos turėjo įtakos ne tik JAV, bet ir likusio pasaulio obligacijų rinkoms, kur palūkanos taip pat kilo. Kilusios palūkanos neigiamai veikė obligacijų kainas. Tai turėjo neigiamą įtaką fondo vieneto vertei;
4. Po JAV prezidento rinkimų 2016 metų pabaigoje išaugę infliacijos lūkesčiai. Metų pradžioje tai lėmė palūkanų kilimą ir smukusias obligacijų kainas. Tai turėjo neigiamą įtaką fondo vieneto vertei;
5. Skatinamoji didžiųjų centrinių bankų pinigų politika. Europos, Japonijos ir Kinijos centriniai bankai toliau vykdė skatinamąją pinigų politiką, o tai išlaikė teigiamus investuotojų lūkesčius ir kėlė rizikingesnių investicijų, visų pirma, akcijų, kainas. Tai turėjo teigiamą įtaką fondo vieneto vertei;
6. Pasaulio ūkio augimas. Daugelyje pasaulio šalių ekonomikos augimas išlieka aukštas, o tai lėmė mažą nedarbą, didesnį vartojimo mastą ir geresnius įmonių rezultatus. Dėl to kilo įmonių akcijų kainos, o tai turėjo teigiamą įtaką fondo vieneto vertei;
7. Žaliavų kainos smukimas. Nors ekonominė situacija pasaulyje išliko gera, tačiau naftos perteklius rinkoje ir sumažėjusi paklausa kitoms žaliavoms sumažino jų kainas. Kritusios žaliavų kainos turėjo neigiamą įtaką fondo vieneto vertei;
8. Euro sustiprėjimas ir pigesnis JAV doleris. Tikėtina, kad ECB pinigų politika per šiuos ar kitus metus turės keistis ir bus griežtinama (didesnės palūkanos, baigta obligacijų supirkimo programa). Aukštesnių palūkanų lūkesčiai kėlė euro vertę daugelio užsienio valiutų atžvilgiu. Tai darė neigiamą įtaką investicijų užsienio valiuta, ypač JAV doleriais, grąžai, o taip pat ir fondo vieneto vertei.

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

VI. Pensijų fondo finansinė būklė

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

17.1. grynųjų aktyvų ataskaitą;

Grynųjų aktyvų ataskaita (EUR)

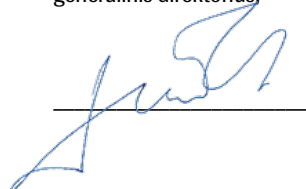
2017 m. birželio 30 d.

Eil. nr.	Straipsniai	Pastabos Nr.	2017 06 30	2016 12 31
A.	TURTAS		6 796 966	6 700 972
I.	PINIGAI	5	341 849	398 741
II.	TERMINUOTIEJI INDĖLIAI		-	-
III.	PINIGŲ RINKOS PRIEMONĖS		-	-
III.1.	Valstybės išdo vekseliai		-	-
III.2.	Kitos pinigų rinkos priemonės		-	-
IV.	PERLEIDŽIAMIEJI VERTYBINIAI POPIERIAI	4, 5, 6	6 449 237	6 302 231
IV.1.	Ne nuosavybės vertybiniai popieriai		3 512 276	3 400 595
IV.1.1.	Vyriausybės ir centrinių bankų arba jų garantuoti ne nuosavybės vertybiniai popieriai		3 512 276	3 400 595
IV.1.2.	Kiti ne nuosavybės vertybiniai popieriai		-	-
IV.2.	Nuosavybės vertybiniai popieriai		-	-
IV.3.	Kitų kolektyvinio investavimo subjektų investiciniai vienetai ir akcijos		2 936 961	2 901 636
V.	SUMOKĖTI AVANSAI		-	-
VI.	GAUTINOS SUMOS	5, 8	5	-
VI.1.	Investicijų pardavimo sandorių gautinos sumos		-	-
VI.2.	Kitos gautinos sumos		5	-
VII.	INVESTICINIS IR KITAS TURTAS	5, 8	5 875	-
VII.1.	Investicinis turtas		-	-
VII.2.	Išvestinės finansinės priemonės		5 875	-
VII.3.	Kitas turtas		-	-
B.	ĮSIPAREIGOJIMAI	5, 8	7 462	38 941
I.	Mokėtinos sumos		7 462	36 674
I.1.	Už finansinį ir investicinį turtą mokėtinos sumos		-	-
I.2.	Valdymo įmonei ir deponitoriumui mokėtinos sumos	13	5 459	12 502
I.3.	Kitos mokėtinos sumos		2 003	24 172
II.	Sukauptos sąnaudos		-	-
III.	Finansinės skolos kredito įstaigoms		-	-
IV.	Įsipareigojimai pagal išvestinių finansinių priemonių sutartis	8	-	2 267
V.	Kiti įsipareigojimai		-	-
C.	GRYNIJI AKTYVAI	2	6 789 504	6 662 031

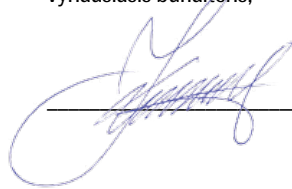
6 - 18 puslapiuose pateiktas aiškinamasis raštas yra neatskiriama šių finansinių ataskaitų dalis.

Šias finansines ataskaitas 2017 m. rugpjūčio 31 d. pasirašė:

Virgilijus Mirkėš,
generalinis direktorius,



Airidas Kuzminskas,
vyriausiasis buhalteris,



17.2. grynujų aktyvų pokyčių ataskaitą;

Grynujų aktyvų pokyčių ataskaita (EUR)

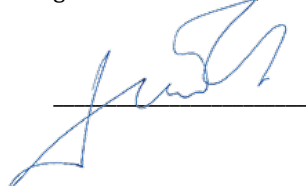
2017 m. birželio 30 d.

Eil. nr.	Straipsniai	Pastabos Nr.	2017 01 01 - 2017 06 30	2016 01 01 - 2016 06 30
I.	GRYNUJŲ AKTYVŲ VERTĖ ATASKAITINIO LAIKOTARPIO PRADŽIOJE		6 662 031	5 734 909
II.	GRYNUJŲ AKTYVŲ VERTĖS PADIDĖJIMAS		440 163	753 716
II.1.	Dalyvių įmokos į fondą	3, 21	232 187	226 323
II.2.	Iš kitų fondų gautos sumos	3, 21	86 241	339 147
II.3.	Garantinės įmokos		-	-
II.4.	Investicinės pajamos		15	6
II.4.1.	Palūkanų pajamos		15	6
II.4.2.	Dividendai		-	-
II.4.3.	Nuomos pajamos		-	-
II.5.	Pelnas dėl investicijų vertės pasikeitimo ir pardavimo	4	83 538	179 961
II.6.	Pelnas dėl užsienio valiutos kursų pokyčio		2 660	2 812
II.7.	Išvestinių finansinių priemonių pelnas		33 182	3 741
II.8.	Kitas grynujų aktyvų vertės padidėjimas	22	2 340	1 726
	PADIDĖJO IŠ VISO:		440 163	753 716
III.	GRYNUJŲ AKTYVŲ VERTĖS SUMAŽĖJIMAS		312 690	520 991
III.1.	Išmokos fondo dalyviams	3, 21	178 374	448 762
III.2.	Išmokos kitiems fondams	3, 21	57 047	23 659
III.3.	Nuostoliai dėl investicijų vertės pasikeitimo ir pardavimo		41 204	14 631
III.4.	Nuostoliai dėl užsienio valiutos kursų pokyčio		4 261	2 808
III.5.	Išvestinių finansinių priemonių sandorių nuostoliai		4 180	6 494
III.6.	Valdymo sąnaudos:		27 624	24 637
III.6.1.	Atlyginimas valdymo įmonei	13, 20	24 857	22 225
III.6.2.	Atlyginimas depozitoriumui	13, 20	1 693	1 442
III.6.3.	Atlyginimas tarpininkams	9, 20	119	41
III.6.4.	Audito sąnaudos	20	955	929
III.6.5.	Palūkanų sąnaudos		-	-
III.6.6.	Kitos sąnaudos		-	-
III.7.	Kitas grynujų aktyvų vertės sumažėjimas		-	-
III.8.	Sąnaudų kompensavimas (-)		-	-
	SUMAŽĖJO IŠ VISO:		312 690	520 991
IV.	Grynujų aktyvų vertės pokytis		127 473	232 725
V.	Pelno paskirstymas		-	-
VI.	GRYNUJŲ AKTYVŲ VERTĖ ATASKAITINIO LAIKOTARPIO PABAIGOJE	2	6 789 504	5 967 634

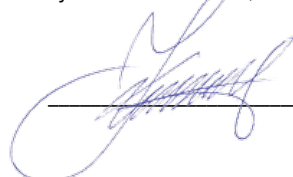
6 - 18 puslapiuose pateiktas aiškinamasis raštas yra neatskiriama šių finansinių ataskaitų dalis.

Šias finansines ataskaitas 2017 m. rugpjūčio 31 d. pasirašė:

Virgilijus Mirkėš,
generalinis direktorius



Airidas Kuzminskas,
vyriausiasis buhalteris,



Aiškinamasis raštas

Bendroji informacija

Papildomo savanoriško pensijų kaupimo fondo Pensija 1 plius taisyklės Nr. PF-S01-K001-017(001) patvirtino Lietuvos Respublikos vertybinių popierių komisija 2004 m. spalio 21 d. (paskutiniai pakeitimai įsigaliojo – 2017 m. gegužės 24 d.). 2006 m. vasario 9 d. pensijų fondo pavadinimas pakeistas į SEB pensija 1 plius.

Pensijų fondą SEB pensija 1 plius (toliau - Fondas) valdo UAB SEB investicijų valdymas (toliau - Bendrovė), įsteigta ir registruota 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. VJK – 001. Duomenys apie bendrovę kaupiami juridinių asmenų registre. Buveinės adresas J. Balčikonio g.3, Vilnius. Kontaktinė informacija:

Telefono numeris (8 5) 268 1528

Fakso numeris (8 5) 268 1575

El. paštas info@seb.lt

Interneto adresas www.seb.lt

Pensijų fondo valdytojai – Ignas Pliušky, Investicijų valdymo grupės vadovas.

Pensijų fondo *SEB pensija 1 plius* depozitoriumas yra AB SEB bankas, įmonės kodas 112021238, adresas 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 ataskaitos parengtos vadovaujantis Verslo apskaitos standartais, bei kitais Lietuvos Respublikoje finansinę apskaitą reglamentuojančiais teisės aktais.

Fondas pirmąsias įmokas ir pajamas gavo 2004 m. spalio 27 d.

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

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

Finansiniai Fondo metai sutampa su kalendoriniais metais.

Sumos šiose finansinėse ataskaitose pateiktos Lietuvos Respublikos nacionaline valiuta – eurai (EUR). 2015 m. sausio 1 d. Lietuva prisijungė prie euro zonos narė 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 suejūs terminui išpirkti emisiją. Kuo mažesnis emitentui suteiktas kredito reitingas, tuo didesnė rizika, kad emitentas neįvykdys savo įsipareigojimų fondo dalyviams. VP kreditingumo rizika taip pat priklauso ir nuo banko, laiduojančio už konkrečius skolos VP, finansinio pajėgumo. Valdydama šią riziką, bendrovė gali naudoti išvestines finansines priemones, kurių vertė kinta kartu su emitento kreditingumo kokybe;
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) t.y. 1 litas.

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 mažą sumą. 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.

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

Reikšmingų pokyčių finansinių ataskaitų sumose nebuvo.

2 Pastaba. Grynyjų 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 (2016 12 31)	Ataskaitinio laikotarpio pabaigoje (2017 06 30)	Prieš metus (2016 06 30)	Prieš dujus metus (2015 06 30)
Grynyjų aktyvų vertė, Eur	6 662 031	6 789 504	5 967 634	5 356 804
Apskaitos vieneto vertė, Eur	0,4057	0,4086	0,4042	0,3983
Apskaitos vienetų skaičius	16 422 039	16 617 907	14 764 729	13 449 902

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

2017 m. birželio 30 d.

	Apskaitos vienetų skaičius	Vertė, Eur**
Apskaitos vienetų skaičius (konvertuojant pinigines lėšas į apskaitos vienetus)*	773 152	318 428
Apskaitos vienetų skaičius (konvertuojant apskaitos vienetus į pinigines lėšas)	577 284	235 421
Skirtumas	195 868	83 007

2016 m. birželio 30 d.

	Apskaitos vienetų skaičius	Vertė, Eur
Apskaitos vienetų skaičius (konvertuojant pinigines lėšas į apskaitos vienetus)*	1 417 771	565 470
Apskaitos vienetų skaičius (konvertuojant apskaitos vienetus į pinigines lėšas)	1 189 616	472 421
Skirtumas	228 155	93 049

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

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

2017 m. birželio 30 d.

Investicijos	Pokytis					
	praėjusio ataskaitinio laikotarpio pabaigoje	įsigyta	parduota (išpirkta)	teigiamas vertės pokytis	neigiamas vertės pokytis	ataskaitinio laikotarpio pabaigoje
Vyriausybių ir centrinių bankų arba jų garantuoti ne nuosavybės vertybiniai popieriai	3 400 595	492 202	(349 720)	4 350	(35 150)	3 512 276
Kitų kolektyvinio investavimo subjektų investiciniai vienetai ir akcijos	2 901 636	399 034	(436 843)	79 188	(6 054)	2 936 961
Iš viso:	6 302 231	891 236	(786 563)	83 538	(41 204)	6 449 237

2016 m. birželio 30 d.

Investicijos	Pokytis					
	praėjusio ataskaitinio laikotarpio pabaigoje	įsigyta	parduota (išpirkta)	teigiamas vertės pokytis	neigiamas vertės pokytis	ataskaitinio laikotarpio pabaigoje
Vyriausybių ir centrinių bankų arba jų garantuoti ne nuosavybės vertybiniai popieriai	2 849 845	521 728	(415 630)	45 702	(1 358)	3 000 287
Kitų kolektyvinio investavimo subjektų investiciniai vienetai ir akcijos	2 399 470	436 076	(387 470)	134 259	(13 273)	2 569 062
Iš viso:	5 249 315	957 804	(803 100)	179 961	(14 631)	5 569 349

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.

2017 m. birželio 30 d.

Kodas	Emitento (KIS, kredito įstaigos, banko pavadinimas)	Šalis	ISIN kodas / Priemonės pavadinimas	Va-liuta	Kiekis, vnt.	Valdytojas	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)	KIS tipas	Balsų dalis emitente, %	Išpirkimo / konvertavimo data / terminas	Dalis GA / dalis portfelyje, %	
1	Akcijos																		
1.1	Nuosavybės vertybiniai popieriai, kuriais prekiaujama reguliuojamose rinkose																		
	Iš viso:																		
1.2	Išleidžiami nauji nuosavybės vertybiniai popieriai																		
	Iš viso:																		
	Iš viso Akcijos:																		
2	Obligacijos																		
2.1	Ne nuosavybės vertybiniai popieriai, kuriais prekiaujama reguliuojamose rinkose																		
	Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT1000607010	EUR	827		82 700				87 388	90 931	0,13				2021.08.28	1,34	
	Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT0000607053	EUR	11 819 393		118 194				127 054	124 347	(0,01)				2018.03.28	1,83	
	Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT0000610057	EUR	1 940 454		19 405				24 412	24 441	0,27				2022.05.17	0,36	
	Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT0000607061	EUR	18 795 783		187 958				213 711	208 810	0,00				2019.10.25	3,08	
	Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT0000605149	EUR	27 149 235		271 492				286 254	285 748	(0,04)				2018.10.31	4,21	
	Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT0000605131	EUR	15 205 051		152 050				159 413	155 989	0,06				2017.08.31	2,30	
	Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT0000650012	EUR	4 140		414 000				416 380	422 471	0,02				2020.05.27	6,22	
	Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT0000630022	EUR	1 300		130 000				131 202	131 649	(0,04)				2019.03.30	1,94	
	Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT0000630030	EUR	27		2 700				2 697	2 702	(0,03)				2019.06.01	0,04	
	Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT0000630048	EUR	2 937		293 700				293 682	293 676	0,00				2020.03.29	4,32	
	Lenkijos Respublika	PL	XS0210314299	EUR	320		320 000				361 642	360 031	(0,04)				2020.04.15	5,30	
	Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	XS0485991417	USD	213		213 000				222 081	216 902	2,10				2020.02.11	3,19	
	Belgijos Karalyste	BE	BE0000315243	EUR	110		110 000				114 201	119 846	(0,51)				2019.03.28	1,77	
	Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	XS0541528682	USD	152		152 000				117 706	136 161	1,74				2017.09.14	2,01	
	Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	XS0602546136	USD	57		57 000				60 300	57 433	2,38				2021.03.09	0,85	
	Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	XS0739988086	USD	40		40 000				30 107	42 264	2,49				2022.02.01	0,62	
	Vokietijos Federacine Respublika	DE	DE0001135358	EUR	55		55 000				66 140	60 041	(0,63)				2018.07.04	0,88	
	Nyderlandų Karalystė	NL	NL0010060257	EUR	50		50 000				52 337	57 115	(0,14)				2022.07.15	0,84	
	Prancūzijos Respublika	FR	FR0010604983	EUR	75		75 000				87 512	78 346	(0,54)				2018.04.25	1,15	
	Vokietijos Federacine Respublika	DE	DE0001135499	EUR	10		10 000				10 770	11 000	(0,18)				2022.09.04	0,16	
	Vokietijos Federacine Respublika	DE	DE0001135457	EUR	30		30 000				31 769	33 825	(0,34)				2021.09.04	0,50	
	Austrijos Respublika	AT	AT0000A0N9A0	EUR	90		90 000				101 461	106 916	(0,10)				2022.04.20	1,58	
	Nyderlandų Karalystė	NL	NL0006227316	EUR	25		25 000				28 533	27 161	(0,59)				2018.07.15	0,40	
	Latvijos Respublika	LV	LV0000570125	EUR	190		190 000				204 353	200 471	0,05				2019.11.21	2,95	
	Prancūzijos Respublika	FR	FR0012517027	EUR	150		150 000				142 929	150 512	0,46				2025.05.25	2,22	
	Prancūzijos Respublika	FR	FR0011337880	EUR	100		100 000				116 183	113 488	0,00				2022.10.25	1,67	
	Iš viso:					74 920 814		3 339 199			3 490 217	3 512 276						51,73	

Kodas	Emitento (KIS, kredito įstaigos, banko pavadinimas)	Šalis	ISIN kodas / Priemonės pavadinimas	Va-liuta	Kiekis, vnt.	Valdytojas	Bendra nominali vertė, EUR	Investicinis sandoris (pozicija)	Sandorio (pozicijos) vertė	Kita sandorio šalis	Bendra įsigijimo vertė, EUR	Bendra rinkos vertė, EUR	Palū-kanų norma, %	Rinka (šaltinis), pagal ku-rios duomenis nustatyta rinkos vertė (tinklalapio adresas)	KIS ti-pas	Balsų dalis emiten-te, %	Išpirkimo / konverta-vimo data / terminas	Dalis GA / dalis portfely-je, %
Išleidžiami nauji ne nuosavybės vertybiniai popieriai																		
Iš viso:																		
Iš viso Obligacijos:																		
					74 920 814		3 339 199				3 490 217	3 512 276						51,73
3	KIS																	
3.1	Kolektyvinių investavimo subjektų, atitinkančių Kolektyvinių investavimo subjektų 61 str. 1d. reikalavimus, vienetai (akcijos)																	
	Goldman Sachs Asset Management	LU	LU0234688595	EUR	60 494	Goldman Sachs Asset Management					819 073	888 049		IS Bloomberg	KIS 1			13,08
	J O Hambro Capital Management Limited	IE	IE00B3DBRP41	EUR	32 700	J O Hambro Capital Management Limited					80 017	78 153		IS Bloomberg	KIS 3			1,15
	PIMCO Global Advisors (Ireland) Limited	IE	IE00B2R34Y72	EUR	27 679	PIMCO Global Advisors (Ireland) Limited					563 838	619 179		IS Bloomberg	KIS 1			9,12
	PIMCO Global Advisors (Ireland) Limited	IE	IE0032876397	EUR	47 657	PIMCO Global Advisors (Ireland) Limited					793 759	892 151		IS Bloomberg	KIS 1			13,14
	JPMorgan Asset Management Europe SAR	LU	LU0332400828	USD	15 822	JPMorgan Asset Management Europe SAR					193 139	203 790		IS Bloomberg	KIS 1			3,00
	SEB Investment Management AB	LU	LU0389150375	USD	110 000	SEB Asset Management SA					133 658	130 693		IS Bloomberg	KIS 3			1,92
	SEB Asset Management SA	LU	LU0957649758	EUR	484	SEB Asset Management SA					64 246	68 888		IS Bloomberg	KIS 3			1,02
	DB Platinum Advisors	LU	IE00BJOKDQ92	EUR	1 194	DB Platinum Advisors					57 283	56 058		IS Bloomberg	KIS 3			0,83
					296 030						2 705 013	2 936 961						43,26
3.2	Kitų kolektyvinių investavimo subjektų vienetai																	
Iš viso:																		
Iš viso KIS:																		
					296 030						2 705 013	2 936 961						43,26
4	Pinigų rinkos priemonės																	
4.1	Pinigų rinkos priemonės, kuriomis prekiaujama reguliuojamose rinkose																	
Iš viso:																		
4.2	Kitos pinigų rinkos priemonės																	
Iš viso:																		
Iš viso Pinigų rinkos priemonės:																		
5	Indėliai kredito įstaigose																	
Iš viso:																		
Iš viso Indėliai kredito įstaigose:																		
6	Išvestinės investicinės priemonės																	
6.1	Išvestinės investicinės priemonės, kuriomis prekiaujama reguliuojamose rinkose																	

Kodas	Emitento (KIS, kredito įstaigos, banko pavadinimas)	Šalis	ISIN kodas / Priemonės pavadinimas	Va-liuta	Kiekis, vnt.	Valdytojas	Bendra nominali vertė, EUR	Investicinis sandoris (pozicija)	Sandorio (pozicijos) vertė	Kita sandorio šalis	Bendra įsigijimo vertė, EUR	Bendra rinkos vertė, EUR	Palū-kanų norma, %	Rinka (šaltinis), pagal ku-rios duomenis nustatyta rinkos vertė (tinklalapio adresas)	KIS ti-pas	Balsų dalis emiten-te, %	Išpirkimo / konverta-vimo data / terminas	Dalis GA / dalis portfely-je, %
	EURO-SCHATZ FUTURE_EUX_EUR_2017.09.07	CH	DUU7	EUR				LV0000570125, FRO010604983, DE0001135358, BE0000315243, NL0006227316	(559 250)	EUREX		1 735		SEB Futures ataska-ita, IS Bloomberg			2017.09.07	0,03
	CME USD/EUR CURR FUT_2017.09.18	US	ECU7	USD				XS0541528682, XS0485991417, XS0739988086	376 561	Chicago Mer-cantile Exchange		4 140		IS Bloomberg (t-1) dienos 15 val.			2017.09.18	0,06
	Iš viso:											5 875						0,09
6.2	Kitos išvestinės investicinės priemonės																	
	Iš viso:											5 875						0,09
7	Pinigai																	
	SEB LONDON	GB		EUR								5 939						0,09
	SEB LONDON	GB		USD								25 188						0,37
	AB SEB bankas	LT		EUR								303 797						4,47
	AB SEB bankas	LT		USD								6 925						0,10
	Iš viso:											341 849						5,03
	Iš viso Pinigai:											341 849						5,03
8	Kitos priemonės, nenumatytos Kolektyvinio investavimo subjektų įstatymo 57 str. 1 d.																	
	Gautinos sumos											5						0,00
	Mokėtinos sumos											(7 462)						(0,11)
	Iš viso:											(7 457)						(0,11)
	Iš viso Kitos priemonės, nenumatytos Kolektyvinio investavimo subjektų įstatymo 57 str. 1 d.:																	
9	IŠ VISO:											6 789 504						100,00

2016 m. birželio 30 d.

Kodas	Emitento (KIS, kredito įstaigos, banko pavadinimas)	Šalis	ISIN kodas / Priemonės pavadinimas	Va-liuta	Kiekis, vnt.	Valdytojas	Bendra nominali vertė, EUR	Investicinis sandoris (pozicija)	Sandorio (pozicijos) vertė	Kita sandorio šalis	Bendra įsigijimo vertė, EUR	Bendra rinkos vertė, EUR	Palū-kanų norma, %	Rinka (šaltinis), pagal ku-rios duomenis nustatyta rinkos vertė (tinklalapio adresas)	KIS ti-pas	Balsų dalis emiten-te, %	Išpirkimo / konverta-vimo data / terminas	Dalis GA / dalis portfely-je, %	
1	Akcijos																		
1.1	Nuosavybės vertybiniai popieriai, kuriais prekiaujama reguliuojamose rinkose																		
	Iš viso:																		
1.2	Išleidžiami nauji nuosavybės vertybiniai popieriai																		
	Iš viso:																		
	Iš viso Akcijos:																		
2	Obligacijos																		
2.1	Ne nuosavybės vertybiniai popieriai, kuriais prekiaujama reguliuojamose rinkose																		
	Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT1000607010	EUR	827		82 700				87 388	91 575	0,34				2021.08.28	1,53	
	Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT0000605115	EUR	2 896 200		28 962				31 844	30 344	(0,08)				2016.10.20	0,51	
	Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT0000607053	EUR	11 819 393		118 194				127 054	130 396	0,01				2018.03.28	2,19	
	Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT0000610057	EUR	1 940 454		19 405				24 412	25 193	0,45				2022.05.17	0,42	
	Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT0000607061	EUR	18 795 783		187 958				213 711	215 182	0,08				2019.10.25	3,61	
	Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT0000605123	EUR	13 756 951		137 569				149 928	144 009	(0,03)				2017.06.07	2,41	
	Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT0000605149	EUR	27 149 235		271 492				286 254	292 316	0,04				2018.10.31	4,90	
	Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT0000603276	EUR	1 401 761		14 018				13 993	14 229	(0,04)				2017.02.27	0,24	
	Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT0000605131	EUR	15 205 051		152 050				159 413	159 925	(0,01)				2017.08.31	2,68	
	Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT0000650012	EUR	4 140		414 000				416 380	423 407	0,13				2020.05.27	7,09	
	Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT0000630022	EUR	1 300		130 000				131 202	132 169	0,05				2019.03.30	2,21	
	Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	LT0000630030	EUR	27		2 700				2 697	2 695	0,06				2019.06.01	0,05	
	Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	XS0327304001	EUR	30		30 000				32 385	32 967	(0,14)				2018.02.07	0,55	
	Prancūzijos Respublika	FR	FR0000187361	EUR	100		100 000				113 177	105 135	(0,58)				2016.10.25	1,76	
	Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	XS0485991417	USD	20		18 034				14 264	21 818	2,12				2020.02.11	0,37	
	Belgijos Karalystė	BE	BE0000315243	EUR	110		110 000				114 201	125 090	(0,59)				2019.03.28	2,10	
	Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	XS0541528682	USD	152		137 060				117 706	145 717	1,05				2017.09.14	2,44	
	Lietuvos Respublikos Vyriausybė	LT	XS0739988086	USD	40		36 069				30 107	44 655	2,55				2022.02.01	0,75	
	Vokietijos Federacine Respublika	DE	DE0001135358	EUR	55		55 000				66 140	62 762	(0,66)				2018.07.04	1,05	
	Nyderlandų Karalystė	NL	NL0010060257	EUR	50		50 000				52 337	59 188	(0,40)				2022.07.15	0,99	
	Prancūzijos Respublika	FR	FR0010604983	EUR	75		75 000				87 512	81 767	(0,55)				2018.04.25	1,37	
	Vokietijos Federacine Respublika	DE	DE0001135499	EUR	10		10 000				10 770	11 375	(0,49)				2022.09.04	0,19	
	Vokietijos Federacine Respublika	DE	DE0001135457	EUR	30		30 000				31 769	34 999	(0,57)				2021.09.04	0,59	
	Austrijos Respublika	AT	AT0000A0N9A0	EUR	90		90 000				101 461	111 614	(0,33)				2022.04.20	1,87	
	Nyderlandų Karalystė	NL	NL0006227316	EUR	25		25 000				28 533	28 315	(0,60)				2018.07.15	0,47	
	Latvijos Respublika	LV	LV0000570125	EUR	190		190 000				204 353	203 567	0,10				2019.11.21	3,41	
	Lenkijos Respublika	PL	XS0543882095	EUR	96		96 000				112 272	113 864	0,26				2021.03.23	1,91	

Kodas	Emitento (KIS, kredito įstaigos, banko pavadinimas)	Šalis	ISIN kodas / Priemonės pavadinimas	Valiuta	Kiekis, vnt.	Valdytojas	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)	KIS tipas	Balsų dalis emitente, %	Išpirkimo / konvertavimo data / terminas	Dalis GA / dalis portfelyje, %		
	Prancūzijos Respublika	FR	FR0012517027	EUR	150		150 000				142 928	156 014	0,05				2025.05.25	2,61		
	Iš viso:					92 972 345	2 761 211				2 904 191	3 000 287						50,27		
2.2	Išleidžiami nauji ne nuosavybės vertybiniai popieriai																			
	Iš viso:																			
	Iš viso Obligacijos:					92 972 345	2 761 211				2 904 191	3 000 287							50,27	
3	KIS																			
3.1	Kolektyvinių investavimo subjektų, atitinkančių Kolektyvinių investavimo subjektų 61 str. 1d. reikalavimus, vienetai (akcijos)																			
	PIMCO GIS Global Investment Grade Credit Fund Inst	IE	IE0032876397	EUR	43 807	PIMCO Global Advisors (Ireland) Limited					724 008	796 422		IS Bloomberg	KIS 1				13,35	
	PIMCO GIS Global High Yield Bond Fund EUR (Hdg) A	IE	IE00B2R34Y72	EUR	17 759	PIMCO Global Advisors (Ireland) Limited					353 106	361 395		IS Bloomberg	KIS 1				6,06	
	JOHCM Global Select B EUR	IE	IE00B3DBRM10	EUR	59 411	J O Hambro Capital Management Limited					123 005	127 911		IS Bloomberg	KIS 3				2,14	
	GS Global Credit Portfolio (Hedged) I	LU	LU0234688595	EUR	54 494	Goldman Sachs Asset Management					733 296	791 250		IS Bloomberg	KIS 1				13,26	
	SEB Fund 1 - SEB Global Fund EUR	LU	LU0957649758	EUR	844	SEB Asset Management SA					102 576	109 100		IS Bloomberg	KIS 3				1,83	
	JPMorgan Funds - Emerging Markets Local Currency D	LU	LU0332400828	USD	30 622	JPMorgan Asset Management Europe SAR					362 531	382 984		IS Bloomberg	KIS 1				6,42	
	Iš viso:					206 937					2 398 522	2 569 062							43,06	
3.2	Kitų kolektyvinių investavimo subjektų vienetai																			
	Iš viso:																			
	Iš viso KIS:					206 937					2 398 522	2 569 062							43,06	
4	Pinigų rinkos priemonės																			
4.1	Pinigų rinkos priemonės, kuriomis prekiaujama reguliuojamose rinkose																			
	Iš viso:																			
4.2	Kitos pinigų rinkos priemonės																			
	Iš viso:																			
	Iš viso Pinigų rinkos priemonės:																			
5	Indėliai kredito įstaigose																			
	AB SEB bankas																			
	Iš viso:																			
	Iš viso Indėliai kredito įstaigose:																			

Kodas	Emitento (KIS, kredito įstaigos, banko pavadinimas)	Šalis	ISIN kodas / Priemonės pavadinimas	Va-liuta	Kiekis, vnt.	Valdytojas	Bendra nominali vertė, EUR	Investicinis sandoris (pozicija)	Sandorio (pozicijos) vertė	Kita sandorio šalis	Bendra įsigijimo vertė, EUR	Bendra rinkos vertė, EUR	Palū-kanų norma, %	Rinka (šaltinis), pagal kurios duomenis nustatyta rinkos vertė (tinklalapio adresas)	KIS ti-pas	Balsų dalis emitente, %	Išpirkimo / konvertavimo data / terminas	Dalis GA / dalis portfelyje, %		
6	"Išvestinės investicinės priemonės"																			
6.1	Išvestinės investicinės priemonės, kuriomis prekiaujama reguliuojamose rinkose																			
	EURO SCHATZ FUTURE	CH	DUU6	EUR				FR0000187361, FR0010604983, DE0001135358, BE0000315243, NL0006227316	(336 195)	EUREX		(675)		SEB Futures ataskaita, IS Bloomberg			2016.09.08	(0,01)		
	CME USD/EUR CURRENCY FUTURE	US	ECU6	USD				XS0541528682, XS0485991417, XS0739988086	125 355	Chicago Mercantile Exchange		(2 801)		IS Bloomberg (t-1) dienos 15 val.			2016.09.19	(0,05)		
	Iš viso:											(3 476)				(0,06)				
6.2	Kitos išvestinės investicinės priemonės																			
	Iš viso:																			
	Iš viso išvestinės investicinės priemonės:											(3 476)								(0,06)
7	Pinigai																			
	AB SEB bankas	LT		EUR								361 245						6,05		
	SEB LONDON	GB		EUR								2 294						0,04		
	AB SEB bankas	LT		USD								4 418						0,07		
	SEB LONDON	GB		USD								8 750						0,15		
	Iš viso:											376 707					6,31			
	Iš viso Pinigai:											376 707					6,31			
8	Kitos priemonės, nenumatytos Kolektyvinio investavimo subjektų įstatymo 57 str. 1 d.																			
	Gautinos sumos											30 981						0,52		
	Mokėtinos sumos											(5 927)						(0,10)		
	Iš viso:											25 054						0,42		
	Iš viso Kitos priemonės, nenumatytos Kolektyvinio investavimo subjektų įstatymo 57 str. 1 d.:																			
9	IŠ VISO:											5 967 634						100,00		

* – nurodyti KIS tipų:

KIS 1 – KIS, kurių investavimo strategijoje numatyta iki 100 proc. grynųjų aktyvų investuoti į ne nuosavybės vertybinių popierių;

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

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

KIS 4 – KIS, kurių investavimo strategijoje numatyta iki 100 proc. grynųjų 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

6 Pastaba. Investicijų paskirstymas pagal investavimo strategiją atitinkančius kriterijus.

Investicijų pasiskirstymas	Ataskaitinio laikotarpio pabaigoje 2017 06 30		Ataskaitinio laikotarpio pradžioje 2016 12 31	
	Rinkos vertė, Eur	Dalis aktyvuose, %	Rinkos vertė, Eur	Dalis aktyvuose, %
Pagal turto rūšis				
Išsivysčiusių šalių akcijos	333 793	4,92	311 805	4,68
Besivystančių šalių akcijos	-	-	-	-
Išsivysčiusių šalių įmonių obligacijos	2 399 378	35,34	2 327 639	34,94
Išsivysčiusių šalių vyriausybės obligacijos	758 250	11,17	774 514	11,62
Besivystančių šalių vyriausybės obligacijos	764 292	11,26	832 563	12,50
Lietuvos obligacijos	2 193 524	32,31	2 055 710	30,86
Žaliavos	-	-	-	-
Kitos alternatyvios investicijos	-	-	-	-
Išvestinės finansinės priemonės	5 875	0,09	(2 267)	(0,03)
Pinigių rinkos priemonės	334 392	4,91	362 067	5,43
Iš viso:	6 789 504	100,00	6 662 031	100,00

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 (bond 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.

Obligacijų ateities sandorių (schatz ir bond futures) rizika priklauso nuo 2 ir 5 metų Vokietijos vyriausybės obligacijų eurais palūkanų kitimo rinkoje. Vokietijos 2 ir 5 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 arba 5 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.

2017 m. birželio 30 d. galioję ateities sandoriai:

Priemonės pavadinimas	Valiutos kodas	Išpirkimo data	Priemonės naudojimo tikslas
EURO SCHATZ FUTURE	EUR	2017 09 07	Palūkanų normų rizikos valdymas
CME USD/EUR CURRENCY FUTURE	USD	2017 09 18	Valiutų kursų svyravimo rizikos valdymas

2016 m. birželio 30 d. galioję ateities sandoriai:

Priemonės pavadinimas	Valiutos kodas	Išpirkimo data	Priemonės naudojimo tikslas
EURO SCHATZ FUTURE	EUR	2016 09 08	Palūkanų normų rizikos valdymas
CME USD/EUR CURRENCY FUTURE	USD	2016 09 19	Valiutų kursų svyravimo rizikos valdymas

9 Pastaba. Atlyginimo tarpininkams sąnaudos.

2017 m. birželio 30 d.

Tarpininko pavadinimas	Sumokėti mokesčiai, Eur	Ar susijęs su valdymo įmone
AB SEB bankas	44	Taip
Skandinaviska Enskilda Banken AB	75	Taip
Iš viso:	119	

2016 m. birželio 30 d.

Tarpininko pavadinimas	Sumokėti mokesčiai, Eur	Ar susijęs su valdymo įmone
Skandinaviska Enskilda Banken AB	29	Taip
AB SEB bankas	12	Taip
Iš viso:*	41	

* 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.

2017 m. birželio 30 d. ir 2016 m. birželio 30 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	
	2017 01 01 - 2017 06 30	2016 01 01 - 2016 06 30	2017 06 30	2016 06 30
AB SEB bankas				
P 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	-	-
Depozitoriumo mokesčiai	1 693	1 442	846	743
UAB SEB investicijų valdymas				
Atskaitymai nuo įmokų	2 914	3 688	411	486
Atskaitymai nuo turto vertės	21 943	22 714	4 202	3 474
Už pensijų kaupimo bendrovės keitimą	-	-	-	-
Skandinaviska Enskilda Banken AB				
Komisinis mokestis už sandorius	Žr. 9 pastaba	Žr. 9 pastaba	-	-
Valdymo mokesčio į investuojamus fondus nuolaida	1 238	813	-	-
Investicijos į SEB grupės valdomus fondus	Žr. 5 pastaba	Žr. 5 pastaba	Žr. 5 pastaba	Žr. 5 pastaba
P 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“.

Apskaitinių įvertinimų pakeitimų nebuvo.

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.

VII. Informacija apie pensijų fondo dalyvius

-

VIII. Išoriniai pinigų srautai

18. Per ataskaitinį laikotarpį faktiškai gautos lėšos.

Bendra gautų lėšų suma, Eur		318 428
Periodinės įmokos į pensijų fondą	iš Valstybinio socialinio draudimo fondo	-
	pačio dalyvio įmokėtos lėšos (pildoma tik papildomo savanoriško pensijų kaupimo pensijų fondo atveju)	137 713
	darbdavių ir kitų trečiųjų asmenų įmokėtos lėšos (pildoma tik papildomo savanoriško pensijų kaupimo pensijų fondo atveju)	94 474
Valstybinio socialinio draudimo fondo sumokėti delspinigiai		-
Iš garantijų rezervo sumokėtos lėšos		-
Iš kitų pensijų fondų pervestos lėšos	iš tos pačios pensijų kaupimo bendrovės	80 968
	iš kitos pensijų kaupimo bendrovės	5 273
Kitos gautos lėšos		-

19. Išmokėtos lėšos.

Bendra išmokėtų lėšų suma, Eur		235 421
Pensijų išmokos	vienkartinės išmokos dalyviams	130 579
	periodinės išmokos dalyviams	-
	išmokos anuiteto įsigijimui	-
Į kitus pensijų fondus pervestos lėšos	valdomus tos pačios pensijų kaupimo bendrovės	51 708
	valdomus kitos pensijų kaupimo bendrovės	5 339
Išstojusiems dalyviams išmokėtos lėšos (pildoma tik papildomo savanoriško kaupimo pensijų fondų atveju)		43 491
Paveldėtojams išmokėtos lėšos		4 304
Kitos išmokėtos lėšos		-

IX. Informacija apie garantijų rezervą

20. 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.

-

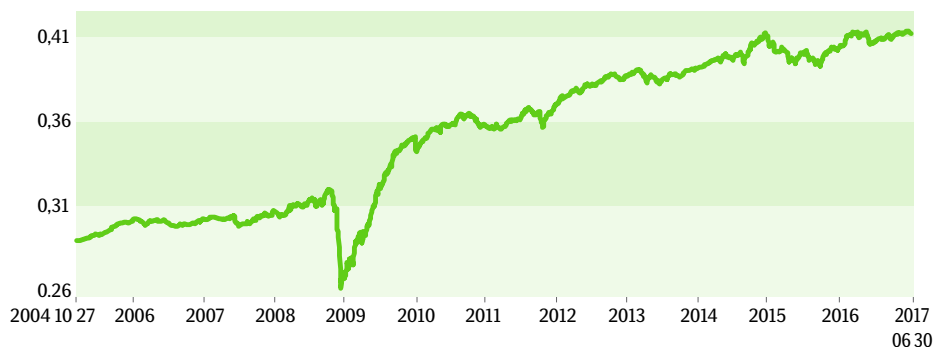
X. Informacija apie pensijų fondo reikmėms pasiskolintas lėšas

21. Pensijų fondo reikmėms pasiskolintos lėšos ataskaitinio laikotarpio pabaigoje.
(Žr. 17.3. punktas, 11 Pastaba)

XI. Kita informacija

22. 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

23. 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.

-

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

-

25. 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.

-

26. Asmenys, atsakingi už ataskaitoje pateiktą informaciją:

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

Tvirtinu _____
Virgilijus Mirkėš,
generalinis direktorius,
tel. (8 5) 268 1528, faks. (8 5) 268 1575,
el. paštas info@seb.lt

Tvirtinu _____
Airidas Kuzminskas,
vyriausiasis buhalteris,
tel. (8 5) 268 1528, faks. (8 5) 268 1575,
el. paštas info@seb.lt

26.2. 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.

-

