

Valdymo įmonių ir investicinių kintamojo kapitalo bendrovių, kurių turto valdymas neperduotas valdymo įmonėms, informacijos rengimo ir pateikimo taisyklių 4 priedas

PENSIJŲ FONDO METINĖS ATASKAITOS TURINYS

I. BENDROSIOS NUOSTATOS

1. Valstybinio socialinio draudimo įmokos dalies kaupimo pensijų fondas **Pensija 2** (toliau – pensijų fondas) veikia pagal 2003 m. rugpjūčio 28 d. Vertybinių popierių komisijos patvirtintas pensijų fondo taisykles, kurioms suteiktas registravimo numeris Nr.PF-V02-K002-007(001).

2. Valdymo įmonės duomenys:

2.1. UAB Hansa Investicijų valdymas, 124815377;

2.2. Savanorių pr. 19, Vilnius;

2.3. tel.: (8-5) 268-44-66, faks.: (8-5) 268-48-19, aurimas.mazdzierius@hansa.lt, <http://www.hansa.lt>

2.4. valdymo įmonės veiklos licencijos Nr.VĮK-002;

2.5. pensijų fondo valdytoja – UAB Hansa Investicijų valdymas fondų valdytoja Daiva Račkauskienė.

3. Asmenys, atsakingi už ataskaitoje pateiktą informaciją:

3.1. už ataskaitą atsakingi įmonės valdymo organų nariai, darbuotojai ir administracijos vadovas:

- valdybos pirmininkas ir valdymo įmonės direktorius Aurimas Maždzierius, tel. 2684466, faks.2684819, aurimas.mazdzierius@hansa.lt;

- valdybos narė ir valdymo įmonės vyriausioji finansininkė Aurelija Žeknienė, tel. 2684467, faks. 2684819, aurelija.zekniene@hansa.lt;

- valdymo įmonės investicijų vadybininkas – Ainis Baradokas, tel.2684496, faks.2684819, ainis.baradokas@hansa.lt

- valdymo įmonės apskaitininkas – Tomas Kivaras, tel.2684464, faks.2684819, tomas.kivaras@hansa.lt;

3.2. jeigu ataskaitą rengia konsultantai arba ji rengiama padedant konsultantams, nurodomi konsultantų vardai, pavardės, telefonų ir faksų numeriai, el.pašto adresai (jeigu konsultantas yra juridinis asmuo, nurodomas jo pavadinimas, telefonų ir faksų numeriai el.pašto adresas bei konsultanto atstovo (-ų) vardas, pavardė); pažymima, kokias konkrečias dalis rengė konsultantai arba kokios dalys parengtos jiems padedant bei nurodomos konsultantų atsakomybės ribos - .

4. AB bankas “Hansabankas”, įmonės kodas 112029657, Savanorių pr. 19, 03502 Vilnius, tel. 2684514, faks. 2684869.

5. Ataskaitinis laikotarpis, už kurį pateikta ataskaita - 2004 metai .

II. GRYNŲJŲ AKTYVŲ, APSKAITOS VIENETŲ SKAIČIAUS IR VERTĖS POKYČIAI

6. Nurodyti grynųjų aktyvų, apskaitos vienetų skaičiaus ir vertės pokyčius:

	Ataskaitinio laikotarpio pradžioje (2003-12-31)	Ataskaitinio laikotarpio pabaigoje (2004-12-31)	Prieš metus (data)	Prieš dvejus metus (data)
GAV	-	18,810,597	-	-
Apskaitos vieneto vertė (Lt)	-	1.0472	-	-
Apskaitos vienetų skaičius	-	17,963,057.218	-	-

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

	Apskaitos vienetų skaičius	Vertė (Lt)
Vienetų skaičius (konvertuojant pinigines lėšas į apskaitos vienetus)	17,979,189.992	18,350,755
Vienetų skaičius (konvertuojant vienetus į pinigines lėšas)	16,132.774	16,361

III. ATSKAITYMAI IŠ PENSIJŲ TURTO

8. Atskaitymai iš pensijų turto (pildoma atitinkama lentelė atsižvelgiant į fondo tipą):

Atskaitymai iš pensijų turto valstybinio socialinio draudimo įmokos dalies kaupimo pensijų fondo pensijų turto (jei per ataskaitinį laikotarpį keitėsi mokesčio dydis, atskirai pateikti sumas pagal kiekvieną dydį); jei yra skaičiuojamas sąlyginis tikėtinas bendrasis išlaidų koeficientas, pateikiama papildoma informacija, nurodyta taisyklių 35.6 punkte:

Atskaitymai	Taisyklėse numatyti maksimalūs dydžiai	Faktiškai taikomi atskaitymų dydžiai	Per ataskaitinį laikotarpį priskaičiuota atskaitymų suma	Per ataskaitinį laikotarpį padarytų atskaitymų suma
Nuo įmokų	3%	3%	567,414	567,414
Nuo turto vertės	1%	1%	54,289	19,993
Keitimo mokesčiai:				
<i>Fondo keitimas toje pačioje bendrovėje daugiau kaip kartą per metus</i>	0.2%	-	0	0
<i>Pensijų kaupimo bendrovės keitimas kartą per metus</i>	0.2%	-	0	0
<i>Pensijų kaupimo bendrovės</i>	0.2%	-	0	0

<i>keitimas daugiau kaip kartą per metus</i>				
Iš viso:			621,703	587,407
BIK (bendrasis išlaidų koeficientas):			6.2%	
PAR (portfelio apyvartumo rodiklis):	383			

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

Atskaitymai	Mokesčio dydis	Mokesčio suma (Lt)	% nuo GAV
Valdymo mokestis:			
<i>Nekintantis mokestis</i>			
<i>Sėkmės mokestis</i>			
Depozitoriumo mokestis			
Sandorių sudarymo išlaidos			
Audito išlaidos			
Kitos veiklos išlaidos (nurodyti išlaidų rūšis)			
Išlaidų, įskaičiuojamų į BIK, suma			
BIK % nuo GAV *			
Visų išlaidų suma			
PAR (praėjusio analogiško ataskaitinio laikotarpio PAR)**			

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

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

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

Mokesčių tarpininkams šis fondas nemoka.

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

11. Pateikti konkretų iliustruojantį pavyzdį apie mokesčių įtaką galutinei dalyviui tenkančiai investicijų grąžai (teikiamas tik metų ataskaitoje).

Pavyzdinė dalyvio sąskaita (per 2004 metus):

Įmokėta lėšų	300.00 Lt
Įmokos mokestis (3% nuo įmokėtų lėšų)	9.00 Lt
Valdymo mokestis (1% nuo turto)	0.82 Lt
Sukaupta suma (2004-12-31)	295.22 Lt

Skaičiavimas atliktas remiantis tokiomis prielaidomis: 1) įmoka į pensijų fondą atliekama kiekvieną ketvirtį ir yra lygi 100 Lt (pirma įmoka 2004-06-15); 2) metinė investavimo grąža 6 proc. ir yra tolygi.

IV. INFORMACIJA APIE PENSIJŲ FONDO INVESTICIJŲ PORTFELĮ

12. Ataskaitinio laikotarpio pabaigos investicijų portfelio sudėtis:

Emitento pavadinimas	Šalis	ISIN kodas	Kiekis (vnt.)	Bendra nominali vertė	Bendra įsigijimo vertė	Įsigijimo vertė tenkanti vienetai	Bendra rinkos vertė	Rinka, pagal kurios duomenis nustatyta rinkos vertė (tinklalapio adresas)	Balsų dalis emitente (%)	Dalis GA (%)
Nuosavybės vertybiniai popieriai, įtraukti į Oficialųjį prekybos sąrašą										
HANSAPANK	Estija	EE0000001063	1628	56,211.58	39,322.60	24.15	54,019.33	www.hex.ee	0%	0%
EESTI TELEKOM	Estija	EE310007220	2290	79,069.12	54,402.73	23.76	56,929.77	www.hex.ee	0%	0%
MOL	Vengrija	HU0000068952	309	4,344.54	39,514.56	127.88	55,219.10	www.bet.hu	0%	0%
KGHM Polska Miedz	Lenkija	PLKGM0000017	1731	14,669.19	40,758.62	23.55	45,914.55	www.gpw.com.pl	0%	0%
PKN ORLEN	Lenkija	PLPKN0000018	1659	1,757.38	40,909.83	24.66	53,143.13	www.gpw.com.pl	0%	0%
TELEK. POLSKA	Lenkija	PLTLKPL00017	3836	9,752.34	44,842.75	11.69	64,365.44	www.gpw.com.pl	0%	0%
KOMERCNI BANKA	Čekija	CZ0008019106	141	7,977.78	45,191.99	320.51	52,206.59	www.pse.cz	0%	0%
OTP Bank	Vengrija	HU0000061726	756	1,062.94	44,825.53	59.29	58,886.65	www.bet.hu	0%	0%
GEDEON RICHTER	Vengrija	HU0000067624	139	1,954.34	42,140.22	303.17	43,679.50	www.bet.hu	0%	0%
FHB Bank	Vengrija	HU0000067707	335	4,710.10	42,839.00	127.88	60,760.29	www.bet.hu	0%	0%
CESKY TELECOM	Čekija	CZ0009093209	1188	13,443.41	42,985.79	36.18	49,633.06	www.pse.cz	0%	0%
MERCATOR	Slovėnija	SI0031100082	73	10,512.73	41,754.56	571.98	42,156.05	www.ljse.si	0%	0%
SNAIGĖ	Lietuva	LT0000109274	3038	3,038.00	56,394.18	18.56	53,772.60	www.nse.lt	0%	0%
NORMA AS	Estija	EE3100001850	3728	128,720.38	80,892.36	21.70	84,311.85	www.hex.ee	0%	0%
SAF Tehnika	Latvija	LV0000101129	1050	5,200.34	80,765.94	76.92	80,345.18	www.rfb.lv	0%	0%
LIETUVOS TELEKOMAS	Lietuva	LT0000123911	51636	51,636.00	98,282.01	1.90	111,017.40	www.nse.lt	0%	1%
OLVI Plc A	Suomija	FI0009900401	1789	12,354.12	79,375.90	44.37	81,351.87	www.hex.com	0%	0%
BANK PEKAO	Lenkija	PLPEKAO00016	398	337.28	44,743.12	112.42	46,544.79	www.gpw.com.pl	0%	0%
IS viso:							1,094,257.17			6%

Nuosavybės vertybiniai popieriai, įtraukti į Einamąjį prekybos sąrašą										
RYTŲ SK. TINKLAI	Lietuva	LT0000126385	10465	10,465.00	18,253.86	1.74	28,255.50	www.nse.lt	0%	0%
IS viso:							28,255.50			0%
Nuosavybės vertybiniai popieriai, kuriais prekiaujama kitose reguliuojamose rinkose										
PLIVA	Kroatija	US72917Q2021	1303	330,245.35	56,184.96	43.12	41,280.67	www.londonstockexchange.com	0%	0%
IS viso:							41,280.67			0%
Išleidžiami nauji nuosavybės vertybiniai popieriai										
IS viso:							0.00			0%
IS viso nuosavybės vertybinių popierių:							1,163,793.33			6%

Emitento pavadinimas	Šalis	ISIN kodas	Kiekis (vnt.)	Bendra nominali vertė	Bendra įsigijimo vertė	Įsigijimo vertė tenkanti vienetai	Bendra rinkos vertė	Palūkanų norma	Išpirkimo / konvertavimo data	Dalis GA (%)
Skolos vertybiniai popieriai, įtraukti į Oficialųjį prekybos sąrašą										
IS viso:							0.00			0%
Skolos vertybiniai popieriai, įtraukti į Einamąjį prekybos sąrašą										
LR Vyriausybė	Lietuva	LT0000601726	1504	150,400.00	146,905.20	97.68	148,373.31	0.000%	2005-07-28	1%
LR Vyriausybė	Lietuva	LT0000603177	914	91,400.00	95,161.57	104.12	94,079.76	3.500%	2006-08-31	1%
LR Vyriausybė	Lietuva	LT0000605099	2359	235,900.00	236,152.61	100.11	248,238.51	3.900%	2009-07-16	1%
LR Vyriausybė	Lietuva	LT0000610040	1318	131,800.00	145,563.84	110.44	155,977.66	5.600%	2013-01-24	1%
IS viso:							646,669.24			4%
Skolos vertybiniai popieriai, kuriais prekiaujama kitose reguliuojamose rinkose										
Lenkijos Vyriausybė	Lenkija	XS0176094836	136	469,580.80	469,671.71	3,453.47	470,516.58	2.244%	2006-09-18	3%
Vengrijos Vyriausybė	Vengrija	DE0003536801	135	466,128.00	471,090.88	3,489.56	469,883.16	2.574%	2005-11-10	2%
Prancūzijos Vyriausybė	Prancūzija	FR0106841887	110000	379,808.00	378,749.96	3.44	394,390.03	3.500%	2009-07-12	2%
Italijos Vyriausybė	Italija	IT000367687	146	504,108.80	564,284.68	3,864.96	572,661.14	8.750%	2006-07-01	3%
Vokietijos Vyriausybė	Vokietija	DE0001141455	10500000	362,544.00	364,796.30	0.03	374,352.39	3.500%	2009-10-09	2%
Graikijos Vyriausybė	Graikija	GR0124024580	158	545,542.40	563,050.27	3,563.61	598,993.25	4.500%	2014-05-20	3%
Latvijos Vyriausybė	Latvija	XS0138888689	159	310,752.00	608,842.10	3,829.20	597,321.52	5.375%	2008-11-27	3%
Belgijos Vyriausybė	Belgija	BE0000297060	12400000	428,147.20	465,563.64	0.04	450,061.01	4.750%	2006-09-28	2%
TPSA Eurofinance	Olandija	XS0108724138	91	314,204.80	349,393.77	3,839.49	355,264.48	6.500%	2007-03-13	2%
Zagrebacka Bank	Kroatija	XS0196346042	167	345,280.00	593,104.65	3,551.52	600,710.97	4.250%	2009-07-13	3%
Pan European Credit	Liuksemburgas	XS0203812994	18	621,504.00	622,011.70	34,556.21	629,672.24	3.268%	2009-10-28	3%
Eesti Energia	Estija	XS0151428801	138	476,486.40	534,970.17	3,876.60	536,834.05	6.000%	2009-07-24	3%
Ispanijos Vyriausybė	Ispanija	ES0000012783	104	359,091.20	420,243.36	4,040.80	425,399.35	5.500%	2017-07-30	2%
Prancūzijos Vyriausybė	Prancūzija	FR0106538574	3812000	1,316,207.36	1,313,635.47	3.45	1,314,736.48	0.000%	2005-01-20	7%
Prancūzijos Vyriausybė	Prancūzija	FR0106589445	238000	821,766.40	834,842.64	3.51	836,084.27	2.250%	2006-03-12	4%
Olandijos Vyriausybė	Olandija	NL0000102416	116000	400,524.80	420,095.10	3.62	420,185.77	3.750%	2009-07-15	2%
CEZ Finance BV	Čekija	XS0193834156	146	404,108.80	544,356.29	3,728.47	539,307.06	4.625%	2011-06-08	3%
Vokietijos Vyriausybė	Vokietija	DE0001135267	22500000	776,880.00	789,260.67	0.04	784,171.85	3.750%	2015-01-04	4%
Slovakijos Vyriausybė	Slovakija	DE0001074763	139	479,939.20	600,725.57	4,321.77	599,603.06	7.375%	2010-04-14	3%
Italijos Vyriausybė	Italija	IT0003618383	241	832,124.80	886,245.30	3,677.37	881,057.32	4.250%	2014-08-01	5%
Slovėnijos Vyriausybė	Slovėnija	XS0095561683	157	542,089.60	602,604.24	3,838.24	600,725.13	4.875%	2009-03-18	3%
Lenkijos Vyriausybė	Lenkija	XS0183959914	75	258,960.00	276,014.07	3,680.19	275,225.77	3.875%	2009-01-15	1%
IS viso:							12,727,156.88			68%

Išleidžiami nauji skolos vertybiniai popieriai										
IS viso: 0.00 0%										
IS viso skolos vertybinių popierių: 13,373,826.12 71%										

KIS pavadinimas	Šalis	ISIN kodas	Kiekis (vnt.)	Valdytojas	Bendra įsigijimo vertė	Įsigijimo vertė tenkanti vienetai	Bendra rinkos vertė	Šaltinis, pagal kurio duomenis nustatyta rinkos vertė (tinklalapio adresas)	KIS aktyvų dalis investuota į kitus KIS (%)	Dalis GA (%)
Kolektyvinių investavimo subjektų, atitinkančių Kolektyvinio investavimo subjektų 40 str. 1 d. reikalavimus, vienetai (akcijos)										
BALZAC AUSTRALIA INDEX FUND	Prancūzija	FR0000018111	110.2394	State Street Global Advisors France S.A.	43,022.03	390.26	43,524.73	www.statestreetfrance.com	iki 10%	0%
BALZAC CANADA INDEX FUND	Prancūzija	FR0000018095	118.2889	State Street Global Advisors France S.A.	42,944.74	363.05	43,328.99	www.statestreetfrance.com	iki 10%	0%
BALZAC EUROPE INDEX FUND	Prancūzija	FR0000023194	1717.9877	State Street Global Advisors France S.A.	741,661.44	431.70	740,237.80	www.statestreetfrance.com	iki 10%	4%
BALZAC JAPAN INDEX FUND	Prancūzija	FR0000017931	842.3354	State Street Global Advisors France S.A.	172,047.54	204.25	174,665.58	www.statestreetfrance.com	iki 10%	1%
BALZAC USA INDEX FUND	Prancūzija	FR0000018285	1955.3411	State Street Global Advisors France S.A.	816,506.35	417.58	814,091.24	www.statestreetfrance.com	iki 10%	4%
ISHARES MSCI EMERGING MKT IN	JAV	US4642872349	631	Barclays Global Fund Advisors	298,220.31	472.62	322,812.55	www.amex.com	0%	2%
T. ROWE PRICE-EUROPEAN CORP.BD	Liuksenburgas	LU0133091248	25029.05	T Rowe Price Global Investment Services	1,041,364.65	41.61	1,037,907.85	www.trowepriceglobal.com	iki 10%	6%
Hansa Eastern European Equity Fund	Estija	EE3600073326	7283.761	AS Hansa Investeerimisfondid	294,247.65	40.40	305,061.86	www.hansa.ee	iki 10%	2%
IS viso:							3,481,630.60			19%

Kitų kolektyvinių investavimo subjektų vienetai (akcijos)										
IS viso: 0.00 0%										
IS viso KIS vienetų (akcijų): 3,481,630.60 19%										

Emitento pavadinimas	Šalis	Priemonės pavadinimas	Kiekis (vnt.)	Valiuta	Bendra rinkos vertė	Palūkanų norma	Galiojimo pabaigos data	Dalis GA (%)
Pinigų rinkos priemonės, kuriomis prekiaujama reguliuojamose rinkose								
IS viso: 0.00 0%								
Kitos pinigų rinkos priemonės								
IS viso: 0.00 0%								
IS viso pinigų rinkos priemonių: 0.00 0%								

Kredito įstaigos pavadinimas	Šalis	Valiuta	Bendra rinkos vertė	Palūkanų norma	Indėlio termino pabaiga	Dalis GA (%)
Indėliai kredito įstaigose						
AB Hansabankas	Lietuva	LTL	775,800.00	1.85%	2005-01-03	4%
IS viso:			775,800.00			4%

Priemonės pavadinimas	Emitento pavadinimas	Šalis	Kita sandorio šalis	Valiuta	Investicinis sandoris (pozicija)	Investicinio sandorio (pozicijos) vertė	Bendra rinkos vertė	Rinkos pavadinimas (tinklalapio adresas)	Galiojimo terminas	Dalis GA (%)
Išvestinės investicinės priemonės, kuriomis prekiaujama reguliuojamose rinkose										
IS viso: 0.00 0%										
Kitos išvestinės investicinės priemonės										
EUR/JPY valiutos apskaitimo sandoris (SWAP)	AB Hansabankas	Lietuva	AB Hansabankas	JPY	172,021.55	169,574.95	2,446.60	www.hansa.lt	2005-03-22	0%
LTL/USD valiutos apskaitimo sandoris (SWAP)	AB Hansabankas	Lietuva	AB Hansabankas	USD	1,133,801.81	1,114,577.52	19,224.29	www.hansa.lt	2005-03-22	0%

LTL/AUD valiutos apskaitimo sandoris (SWAP)	AB Hansabankas	Lietuva	AB Hansabankas	AUD	42,525.60	42,268.12	257.48	www.hansa.lt	2005-03-22	0%
LTL/CAD valiutos apskaitimo sandoris (SWAP)	AB Hansabankas	Lietuva	AB Hansabankas	CAD	42,517.82	42,367.89	149.93	www.hansa.lt	2005-03-22	0%
Iš viso:							22,078.30			0%

Banko pavadinimas	Valiuta	Bendra rinkos vertė	Palūkanų norma	Dalis GA (%)
Pinigai				
AB Hansabankas	LTL	25,048.61		0%
AB Hansabankas	USD	2,706.80		0%
AB Hansabankas	EUR	8.53		0%
Iš viso:		27,763.94		0%
Pavadinimas	Trumpas apibūdinimas	Bendra vertė	Paskirtis	Dalis GA (%)
Kitos priemonės, nenumatytos Kolektyvinio investavimo subjektų įstatymo 36 str. 1 d.				
Iš viso:		0.00		0%

13. Investicijų pasiskirstymas pagal investavimo strategiją atspindinčius kriterijus (pavyzdžiui, turto rūšis, pramonės šakas, geografinę zoną, valiutas, rinkas, emitentų tipus (vyriausybė, bendrovės), emitentų kredito reitingus, priemonių galiojimo trukmes bei kt.).

Investicijų pasiskirstymas	Rinkos vertė	Dalis aktyvuose (%)	Rinkos vertė ataskaitinio laikotarpio pradžioje	Dalis aktyvuose ataskaitinio laikotarpio pradžioje (%)
Pagal investavimo objektus				
Vyriausybių vertybiniai popieriai	12,289,252	65%	0	0%
Kiti skolos vertybiniai popieriai ir jų fondai	2,122,482	11%	0	0%
Akcijos ir jų fondai	3,607,516	19%	0	0%
Terminuoti indėliai ir grynieji pinigai	803,564	4%	0	0%
Išvestiniai sandoriai	22,078	0%	0	0%
Iš viso:	18,844,892	100%	0	0%

14. Per ataskaitinį laikotarpį įvykdyti sandoriai su išvestinėmis investicinėmis priemonėmis, išskyrus tuos, kurie nurodyti 12 punkte (pagal išvestinių investicinių priemonių rūšis, nurodyti sandorių vertes, išvestinių investicinių priemonių panaudojimo tikslus (valiutų keitimo, palūkanų normos, susiję su nuosavybe ir kt.), sandorius reguliuojamose rinkose ir šalių tarpusavio sandorius bei kitą svarbią informaciją). -.

15. Aprašyti 12 punkte nurodytų išvestinių priemonių rūšis, dėl jų kylančią riziką, kiekybines ribas ir metodus, kuriais vertinama su išvestinių investicinių priemonių sandoriais susijusi pensijų fondo rizika, ir nurodyti, kaip panaudojama išvestinė investicinė priemonė gali apsaugoti investicinį sandorį (investicinę poziciją) nuo rizikos.

Išvestinės priemonės nurodytos 12 punkte- tai valiutos apsikeitimo sandoriai, sudaryti su tikslu apsidrausti nuo Australijos dolerio, Japonijos jenu, JAV dolerio, Kanados dolerio valiutų kursų svyravimų įtakos pensijų turtui. Kiekvienas valiutos apsikeitimo sandoris yra pagrįstas konkrečia investicine pozicija.

16. Bendra išsipareigojimų, kylančių iš sandorių su išvestinėmis investicinėmis priemonėmis, vertė ataskaitinio laikotarpio pabaigoje (atskirai nurodyti sumas pagal skirtingas įsigytų išvestinių investicinių priemonių kategorijas).

Sumos nurodytos 12-ame punkte ataskaitinio laikotarpio pabaigos investicijų portfelio sudėties lentelėje (Investicinio sandorio pozicijos vertė).

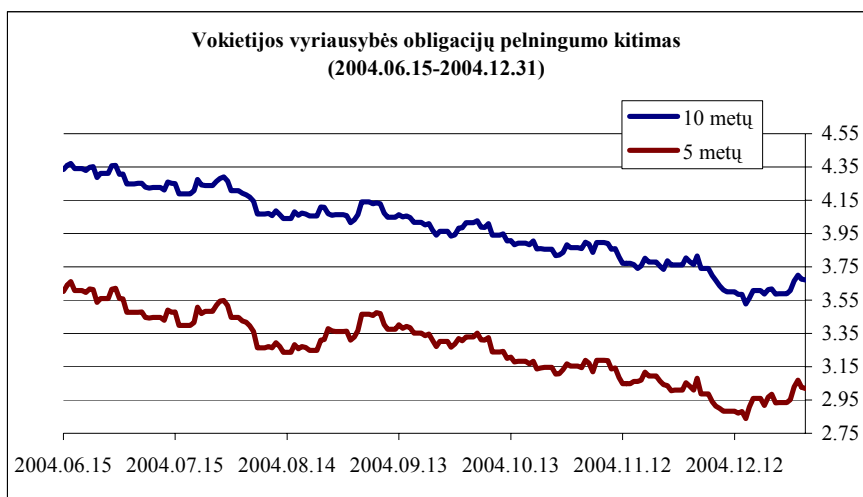
17. Pateikti analizę, kaip turimas investicijų portfelis atitinka (neatitinka) pensijų fondo investavimo strategiją (investicijų kryptis, investicijų specializaciją, geografinę zoną ir pan.).

Tai mišraus investavimo pensijų fondas, kurio lėšos pagal fondo investavimo strategiją gali būti investuotos į fiksuoto pajamingumo instrumentus (obligacijas, indėlius, ir pan.) ir akcijas (iki 20 proc. fondo turto). Kolektyvinio investavimo subjektai, į kuriuos investuoja pensijų fondas, priskiriami vienai iš aukščiau paminėtų turto klasių pagal jo investavimo kryptį (kolektyvinio investavimo subjektai, investuojantys į obligacijas priskiriami fiksuoto pajamingumo instrumentų klasei, o kolektyvinio investavimo subjektai, investuojantys į akcijas – akcijų turto klasei). Pensijų fondo investavimo strategijoje nėra numatyta apribojimų pagal geografinę zoną, ekonominės veiklos sritis ir pan. Ataskaitinio laikotarpio pabaigoje skolos vertybiniai popieriai ir kolektyvinio investavimo subjektų, investuojančių į skolos vertybinius popierius, vienetai sudarė apie 76 % investicijų portfelio. Akcijos ir jų fondai sudarė apie 19 proc. Tokio tipo fondai yra skirti investuotojams, kurie nori prisiimti nedidelę investavimo riziką ir (arba) kurių investavimo horizontas yra bent 5-10 metų. Todėl "Pensija 2" fondo valdymo tikslas – siekti aukštesnio investicijų pelningumo per vidutinį laikotarpį. Investicijos parenkamos pagal laukiamą vertės augimo perspektyvą. Fondas gali prisiimti valiutos (iki 15 proc. atvira valiutos pozicija), kredito ir palūkanų normos riziką. Valiutos rizika valdoma sudarinėjant valiutų apsikeitimo, išankstinio pirkimo (pardavimo) sandorius toms valiutomis, kurioms sudaryti tokie sandorius ekonomiškai apsimoka. Tokiu būdu pilnai arba iš dalies buvo apsidrausta nuo JAV dolerio, Kanados dolerio, Australijos dolerio ir Japonijos jenos kurso svyravimų. Kitais atvejais investicija įvertinama tiek jos vertės augimo potencialo, tiek valiutos rizikos aspektu. Kredito rizika mažinama, diversifikuojant investicijas pagal regionus, emitentų ekonominės veiklos rūšis ir pan. Palūkanų normos rizikos valdymas įgyvendinamas per investicijų portfelio vidutinės finansinės trukmės valdymą (kylant palūkanoms, vidutinė finansinė trukmė trumpinama, palūkanoms krentant – ilginama).

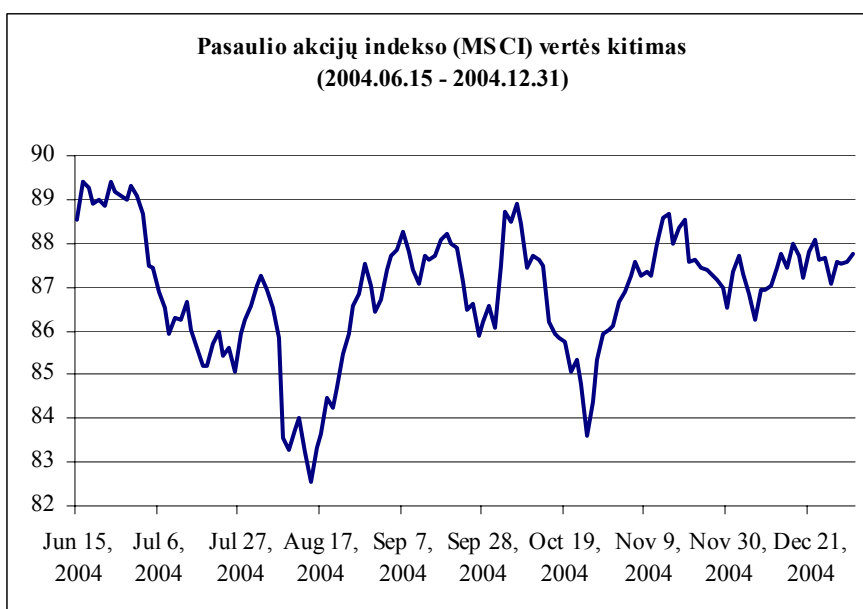
18. Nurodyti veiksniai, kurie turėjo didžiausią įtaką per ataskaitinį laikotarpį investicijų portfelio struktūros ir jo vertės pokyčiams.

Investicijų portfelio vertės kitimui įtaką daro pokyčiai valiutų, akcijų ir palūkanų rinkoje. Nuo 2004 m. birželio Lietuvos ir kitose ES rinkose vyravo palūkanų kritimo tendencija (žr. iliustraciją žemiau – Vokietijos vyriausybės obligacijų pelningumo grafikas), todėl investicijų portfelio vertė augo ne tik dėl jį sudarančių obligacijų sukauptų atkarpų, bet ir grynosios kainos augimo (palūkanoms krentant, obligacijų kainos kyla). Akcijų rinkoje svyravimai būna didesni (ne išimtis ir 2004 metai), nemažą įtaką turi sezoniškumo faktorius – pavyzdžiui, vasarą akcijų kainos paprastai krenta (žr. iliustraciją – Pasaulio akcijų indekso, perskaičiuoto eurais, vertės kitimo istorija). Atsižvelgus į minėtą sezoniškumo faktorių, į akcijas pradėta investuoti tik rugpjūčio mėnesį, kai akcijų indeksai pasiekė žemiausią lygį nuo metų pradžios ir pradėjo vėl augti. Priimant investicinius sprendimus, taip pat atsižvelgiama į skirtingų geografinių regionų vystymosi perspektyvas. Todėl didelę įtaką portfelio vertės augimui turėjo sprendimas didesnę dėmesį skirti sparčiai augančiam Rytų ir Centrinės Europos akcijų rinkai. Valiutų kursų svyravimų įtaka portfelio vertės kitimui buvo palyginti nedidelė, nes portfelyje neapdraustų valiutinių pozicijų buvo tik nedidelė dalis (iki 5 proc.)

Sprendimai dėl portfelio struktūros galimų pokyčių priimami reguliariai (ne rečiau kaip kartą per metus) ir atsižvelgiant į situaciją rinkoje: kuriame regione daugiau investuoti, kokio tipo vertybinius popierius rinktis (Vyriausybės obligacijas ar bendrovių? Kokio termino? Akcijas ar kolektyvinio investavimo subjektus, investuojančius į jas? Ir t.t.), ar ir kaip drausti tam tikras investicijų portfelio rizikas. 2004 m., kai rinkoje vyravo palūkanų mažėjimo tendencijos, rinkomės ilgesnio termino skolos vertybinius popierius, tendencijai keičiantis investicijų portfelio vidutinė finansinė trukmė trumpinama - ilgesnio termino vertybiniai popieriai keičiami trumpesnio termino.



Šaltinis: Bloomberg L.P.



Šaltinis: MSCI Inc.

V. PENSIJŲ FONDO INVESTICIJŲ GRAŽA IR RIZIKOS RODIKLIAI

19. Orientacinis indeksas ir trumpas jo apibūdinimas.

Orientacinio indekso šis fondas neturi.

20. To paties laikotarpio pensijų fondo investicijų portfelio metinės investicijų grąžos ir orientacinio indekso (jei jis pasirinktas) reikšmės pokyčio rodikliai per paskutinius dešimt fondo veiklos metų išdėstyti palyginamojoje lentelėje. Jeigu fondas veikia trumpiau nei dešimt metų, tai skelbiama to laikotarpio, kai portfelis buvo valdomas, metinė investicijų grąža. Pildoma atitinkama lentelė atsižvelgiant į fondo tipą:

Valstybinio socialinio draudimo įmokos dalies kaupimo pensijų fondas:

	Per ataskaitinį laikotarpį	Prieš metus	Prieš 2 metus	Prieš X metų
Orientacinio indekso reikšmės pokytis	-	-	-	-
Metinė grynoji investicijų grąža	-	-	-	-
Grynosios investicijų grąžos standartinis nuokrypis	-	-	-	-

Papildomo savanoriško pensijų kaupimo fondas:

	Per ataskaitinį laikotarpį	Prieš metus	Prieš 2 metus	Prieš X metų
Orientacinio indekso reikšmės pokytis				
Metinė bendroji investicijų graža				
Metinė grynoji investicijų graža				
Bendrosios investicijų gražos standartinis nuokrypis				

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

22. Vidutinė investicijų graža ir orientacinio indekso reikšmės pokytis per paskutinius trejus, penkerius, dešimt metų. Vidutinė investicijų graža apskaičiuojama kaip geometrinis metinių investicijų gražų vidurkis. Pildoma atitinkama lentelė atsižvelgiant į fondo tipą:

Valstybinio socialinio draudimo įmokos dalies kaupimo pensijų fondas:

	Per paskutinius 3 metus	Per paskutinius 5 metus	Per paskutinius 10 metų	Nuo veiklos pradžios
Vidutinis orientacinio indekso reikšmės pokytis				
Vidutinė investicijų graža				
Vidutinės grynosios investicijų gražos standartinis nuokrypis*				

*Investicijų gražos standartinis nuokrypis – statistinis rizikos rodiklis, apibūdinantis investicijų portfelio gražos kintamumą. Jei investicijų gražos standartinis nuokrypis yra lygus nuliui, vadinasi, investicijų portfelis turi pastovią nekintančią investicijų gražą (pvz., banko indėlis su nekintama palūkanų norma).

Papildomo savanoriško pensijų kaupimo fondas:

	Per paskutinius 3 metus	Per paskutinius 5 metus	Per paskutinius 10 metų	Nuo veiklos pradžios
Vidutinis orientacinio indekso reikšmės pokytis				
Vidutinė bendroji investicijų graža				
Vidutinė grynoji investicijų graža				
Vidutinės bendrosios investicijų gražos standartinis nuokrypis				

23. Kiti rodikliai, atskleidžiantys investicijų portfelio riziką. Atskleidžiant investicijų rizikos rodiklius, turi būti pateikiami jų paaiškinimai ir apskaičiavimo metodika -.

VI. PENSIJŲ FONDO FINANSINĖ BŪKLĖ

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

24.1. paskutinių 3 finansinių metų balansus, išdėstytus palyginamojoje lentelėje;

BALANSAS PAGAL 2004 M. GRUODŽIO 31 D. DUOMENIS

(litas)

Eil. Nr.	Turtas	Ataskaitinis laikotarpis	Praėjęs ataskaitinis laikotarpis
I.	PINIGAI IR PINIGŲ EKVIVALENTAI	27,764	-
II.	TERMINUOTI INDĖLIAI	775,800	-
III.	INVESTICIJOS	18,019,249	-
1	Skolos vertybiniai popieriai	13,373,825	-
1.1.	Vyriausybės ir centrinių bankų arba jų garantuoti skolos vertybiniai popieriai	646,669	-
1.2.	Kiti skolos vertybiniai popieriai	12,727,156	-
2	Nuosavybės vertybiniai popieriai	1,163,793	-
3	Kolektyvinio investavimo subjektų investiciniai vienetai ir akcijos	3,481,631	-
4	Kitos investicijos	-	-
IV.	GAUTINOS SUMOS	22,079	-
1	Investicijų pardavimo sandorių gautinos sumos	-	-
2	Kitos gautinos sumos	22,079	-
	TURTAS, IŠ VISO	18,844,892	-

Eil. Nr.	Įsipareigojimai ir gryniesi aktyvai	Ataskaitinis laikotarpis	Praėjęs ataskaitinis laikotarpis
V.	ĮSIPAREIGOJIMAI	34,295	-
1.	Investicijų pirkimo įsipareigojimai	-	-
2.	Mokėtinos sumos kaupimo bendrovei ir depozitoriumui	34,295	-
3.	Kitos mokėtinos sumos ir įsipareigojimai	-	-
VI.	GRYNIEJI AKTYVAI (I+II+III+IV-V)	18,810,597	-
	ĮSIPAREIGOJIMAI IR GRYNIEJI AKTYVAI, IŠ VISO	18,844,892	-

Direktorius

Aurimas Maždžierius

24.2. paskutinių 3 finansinių metų grynujų aktyvų pokyčių ataskaitos, išdėstytos palyginamojoje lentelėje;

**GRYNUJŲ AKTYVŲ POKYČIŲ ATASKAITA
PAGAL 2004 M. GRUODŽIO 31 D. DUOMENIS**

(litas)

Eil. Nr.	Straipsniai	Ataskaitinis laikotarpis	Praėjęs ataskaitinis laikotarpis
I.	GRYNIJAI AKTYVAI ATASKAITINIO LAIKOTARPIO PRADŽIOJE	-	-
II.	PADIDĖJIMAS, IŠ VISO	19,518,614	-
1.	Pensijų įmokos	18,912,433	-
2.	Iš kitų pensijų fondų pervestos sumos	3,617	-
3.	Kaupimo bendrovės garantinės įmokos	-	-
4.	Palūkanos ir dividendai	112,606	-
5.	Investicijų pardavimo pelnas	126,268	-
6.	Investicijų vertės padidėjimo suma	261,545	-
7.	Turto vertės padidėjimas dėl užsienio valiutų kursų pasikeitimo	102,145	-
8.	Kitos pajamos	-	-
III.	SUMAŽĖJIMAS, IŠ VISO	708,017	-
1.	Pensijų išmokos	3,919	-
2.	Į kitus pensijų fondus pervestos sumos	10,353	-
3.	Investicijų pardavimo nuostoliai	2,267	-
4.	Investicijų vertės sumažėjimo suma	63,613	-
5.	Turto vertės sumažėjimas dėl užsienio valiutų kursų pasikeitimo	6,162	-
6.	Valdymo sąnaudos	621,703	-
7.	Kitos sąnaudos (3% įmokos)	-	-
IV.	GRYNIJAI AKTYVAI ATASKAITINIO LAIKOTARPIO PABAIGOJE	18,810,597	-
		Ataskaitinio laikotarpio pabaigoje	Prieš metus
V.	APSKAITOS VIENETO VERTĖ	1,0472	-
VI.	APSKAITOS VIENETŲ SKAIČIUS	17963057.218	-

Direktorius

Aurimas Maždžierius

24.3. aiškinamąjį raštą.

AIŠKINAMASIS RAŠTAS

1. Bendroji dalis.

Valstybinio socialinio draudimo įmokos dalies kaupimo pensijų fondas **Pensija 2** (toliau – pensijų fondas) buvo įsteigtas 2003 m. rugpjūčio 28 d. Pensijų fondo veikla neterminuota.

Kaupimo bendrovė - UAB Hansa Investicijų valdymas, įmonės kodas 124815377, adresas Savanorių pr.19, Vilnius.

Depozitoriumas, kuris saugo pensijų fondo turtą – AB bankas “Hansabankas”, adresas Savanorių pr.19, Vilnius, įmonės kodas 112029657.

Audito įmonė – UAB “Deloitte & Touche”, adresas Aludarių g. 2, Vilnius, įmonės kodas 111525237.

2. Apskaitos politika.

Finansinės ataskaitos yra parengtos vadovaujantis Pensijų kaupimo, Papildomo savanoriško pensijų kaupimo ir Buhalterinės apskaitos įstatymais, Pensijų fondų buhalterinės apskaitos ir finansinės atskaitomybės tvarka bei kitais Lietuvos Respublikos Vyriausybės patvirtintais poįstatyminiais aktais. Ataskaitos pateiktos Lietuvos nacionaline valiuta – litais (“LTL”).

Investavimo politika – pagrįsta tikslu užtikrinti ilgalaikį pensijų fondo dalyvių turto augimą minimizuojant riziką investicijų diversifikavimo dėka. Didžioji dalis Pensijų fondo lėšų yra investuojama į skolos vertybinius popierius, o į akcijas investuojama ne daugiau kaip 20 procentų pensijų turtą sudarančių grynujų aktyvų. Iš akcijų dalies tikėtinas aukštesnis pajamingumas ilgu laikotarpiu. Investuojant turtą, nėra siekiama specializuotis konkrečiuose geografiniuose regionuose.

Pensijų fondo turtas investuojamas į vertybinius popierius ar pinigų rinkos priemones, kuriais prekiaujama reguliuojamose rinkose veikiančiose Lietuvos Respublikoje ir Europos Sąjungos valstybėse, taip pat į vertybinius popierius ar pinigų rinkos priemones, kurie yra įtraukti į šių vertybinių popierių biržų, esančių Ekonominio bendradarbiavimo ir plėtros valstybėse narėse, oficialųjį prekybos sąrašą arba kuriais prekiaujama šiose Ekonominio Bendradarbiavimo ir plėtros organizacijos valstybėse narėse pripažintose ir visuomenei prieinamose reguliuojamose rinkose, veikiančiose pagal nustatytas taisykles. Pensijų fondo turtas investuojamas laikantis įstatymuose nurodytų diversifikavimo reikalavimų.

Finansinės rizikos valdymo politika - rizika yra apibrėžiama kaip investicinio proceso eigoje atsirandanti pensijų turto vertės sumažėjimo tikimybė. Pensijų turtas gali būti investuotas į šias išvestines investicines priemones tik nurodytų rizikų valdymo tikslais:

išankstiniai sandoriai pirkti / parduoti valiutą (FX forwards) – siekiant apsidrausti nuo valiutų kursų svyravimų įtakos pensijų turtui;

valiutų apsikeitimo sandoriai (FX swaps) - siekiant apsidrausti nuo valiutų kursų svyravimų įtakos pensijų turtui;

pasirinkimo sandoriai pirkti / parduoti valiutą (FX Options) - siekiant apsidrausti nuo valiutų kursų svyravimų įtakos pensijų turtui;

palūkanų normos išankstiniai sandoriai (Forward rate agreements) – siekiant apsidrausti nuo palūkanų normos svyravimo įtakos pensijų fondo turtui;

palūkanų normos ateities sandoriai (Interest rate futures) – siekiant apsidrausti nuo palūkanų normos svyravimo įtakos pensijų fondo turtui;

palūkanų normos apsikeitimo sandoriai (Interest rate swaps) – siekiant apsidrausti nuo palūkanų normos svyravimo įtakos pensijų fondo turtui.

Kiekviena išvestinė investicinė priemonė turi būti pagrįsta konkrečiu investiciniu sandoriu (investicine pozicija).

Investuojant pensijų fondo turtą, yra išskiriamos kelios rizikų rūšys:

Kredito rizika

emitento rizika – rizika patirti nuostolius dėl emitento nesugebėjimo įvykdyti savo skolinius įsipareigojimus. Siekiant sumažinti emitento riziką, fondo lėšos investuojamos į žemos rizikos (aukšto reitingo) emitentų vertybinius popierius;

sandorio šalies rizika – rizika patirti nuostolius dėl sandorio šalies nesugebėjimo įvykdyti savo įsipareigojimus susijusius su savalaikiu sandorio įvykdymu. Siekiant sumažinti sandorio šalies riziką sandoriai sudaromi su žemos rizikos kredito institucijomis, o jų nesant, su patikimais sandorių partneriais besispecializuojančiais atitinkamoje srityje;

atsiskaitymų rizika – rizika patirti nuostolius, kai atsiskaitymo už sandorį metu, sandorio šalis dėl tam tikrų priežasčių negali pervesti lėšų ar vertybinių popierių nors tos sandorio šalies atžvilgiu įgyti įsipareigojimai jau yra patenkinti. Siekiant sumažinti atsiskaitymų riziką, investavimo procese naudojamosi mokėjimų agento paslaugomis arba prekybinė veikla vykdoma organizuotose rinkose, kuriose atsiskaitymams taikomi visuotinai pripažinti principai.

Rinkos rizika

akcijų rizika – rizika patirti nuostolius dėl akcijos kainos pokyčio, akcijos kainos svyravimo amplitudės pokyčio, santykinio skirtumo tarp akcijos kainos ir akcijų indekso pokyčio, o taip pat dėl dividendų mokėjimų pokyčių. Siekiant sumažinti akcijų riziką, valdymo įmonė analizuoja akcijų rinkas ir atskirus emitentus.

palūkanų normos rizika - rizika patirti nuostolius dėl palūkanų normos pokyčio, palūkanų normos svyravimų amplitudės pokyčio, palūkanų kreivės formos pokyčio, skirtingos rizikos palūkaninių instrumentų palūkanų santykio pokyčio, išankstinio skolinių įsipareigojimų padengimo (išpirkimo). Siekiant sumažinti palūkanų normos riziką, valdymo įmonė analizuoja obligacijų rinkas ir atskirus emitentus;

valiutos kursų rizika – rizika patirti nuostolius dėl nepalankaus užsienio valiutų kurso pokyčio lito atžvilgiu. Siekiant sumažinti valiutos kursų riziką, didesnę pensijų turto dalis bus investuojama litais ar bazine valiuta, analizuojant valiutų rinkas.

Likvidumo rizika – rizika patirti nuostolius dėl mažo rinkos likvidumo, kuris neleidžia parduoti pensijų turta norimu laiku ir už norimą kainą arba eliminuoja galimybę parduoti norimą turta. Siekiant sumažinti likvidumo riziką atliekamos investicijos į vertybinius popierius ar pinigų rinkos priemonės pasižyminčius aukštu likvidumu.

Valdymo procese, rizikos skirstomos į sandorių rizikas ir investicines rizikas. Sandorio rizikos yra valdomos valdymo įmonės lygmenyje, o investicinės rizikos valdomos Pensijų fondo lygmenyje. Valdant sandorių rizikas, valdymo įmonė teikia pirmenybę žemos kredito rizikos institucijoms, o taip pat organizuotoms rinkoms su standartizuotomis atsiskaitymo procedūromis. Valdant investicines rizikas, valdymo įmonė atsižvelgia į pensijų turto profilį, diversifikavimo reikalavimus, ir numatomą Pensijų fondo išipareigojimų trukmę.

Turto padidėjimo ir sumažėjimo pripažinimo principai - pensijų fondo turto vertės padidėjimą ar sumažėjimą lemia vertybinių popierių kainų pokyčiai ir investavimo objektų valiutos kursų pokyčiai. Turto padidėjimas pripažįstamas gaunant: naujas pensijų įmokas, iš kitų pensijų fondų pervestas sumas, investicijų pardavimo pajamas, palūkanas už vertybinius popierius, pajamas dėl investicijų vertės padidėjimo ir dėl užsienio valiutų kursų pasikeitimo. Turto sumažėjimas pripažįstamas atliekant galimus atskaitymus: sumokant turto valdymo ir įmokos mokesčių, vykdant pensijų išmokas ar pervedant sumas į kitus pensijų fondus. Turto sumažėjimą lemia investicijų pardavimo nuostoliai, investicijų vertės sumažėjimas bei neigiami valiutų kursų pokyčiai.

Atskaitymų kaupimo bendrovei ir depozitoriumui taisyklės – iš pensijų fondo turto vykdomi tik tie atskaitymai, kurie susiję su pensijų fondo valdymu ir yra numatyti pensijų fondo taisyklėse. Šių išlaidų suma negali viršyti pensijų fondo taisyklėse numatytų dydžių. Visos kitos pensijų fondo taisyklėse nenumatytos arba nustatytas ribas viršijančios išlaidos yra dengiamos iš valdymo įmonės lėšų.

Investicijų įvertinimo metodai:

vertybiniai popieriai, kuriais prekiaujama reguliuojamose rinkose, vertinami rinkos verte;

vertybiniai popieriai, kuriais neprekaujama reguliuojamose rinkose, vertinami vadovaujantis valdymo įmonės valdybos patvirtintomis grynųjų aktyvų skaičiavimo procedūromis;

terminuoti indėliai bankuose vertinami pagal amortizuotos savikainos verte;

grynieji pinigai ir lėšos bankuose vertinami pagal nominalią verte;

išvestinės investicinės priemonės vertė nustatoma pagal paskutinę anksčiau sudaryto analogiško sandorio rinkos verte, vertinant šias priemones, iš pensijų fondo turto vertės yra atimami dėl išvestinės investicinės priemonės naudojimo susidarę kaštai arba pridedamos susidariusios pajamos;

kolektyvinio investavimo subjektų vienetai (akcijos) vertinami pagal paskutinę viešai paskelbtą išpirkimo kainą; *aktyvai denominuoti užsienio valiuta* vertinami taip pat, kaip aktyvai, denominuoti Lietuvos Respublikos valiuta. Tokiu būdu nustatyta vertė, išreikšta užsienio valiuta, Lietuvos Respublikos valiuta išreiškiama vėliausia valiutų supirkimo verte, kurią nustato Pensijų fondo depozitoriumas. Jei vertinimo metu Pensijų fondo depozitoriumas nėra nustatęs tam tikros valiutos kainos, vertinimas atliekamas pagal Lietuvos Banko nustatytą vėliausią kursą.

Investicijų pervertinimo periodiškumas- investicijų vertinimas, skaičiuojant grynųjų aktyvų verte, atliekamas kiekvieną dieną. Finansinėse ataskaitose investicijų pervertinimas vykdomas kiekvieno mėnesio paskutinę darbo dieną.

Apskaitos vieneto vertės nustatymo taisyklės - pensijų fondo grynųjų aktyvų vertė ir apskaitos vieneto vertė nustatoma kiekvieną darbo dieną. Kartą per mėnesį apskaičiuojama vidutinė praėjusio mėnesio apskaitos vieneto vertė. Pensijų fondo grynieji aktyvai įvertinami jų tikrąją verte, vadovaujantis grynųjų aktyvų vertės skaičiavimo metodika. Apskaitos vieneto vertė nustatoma pensijų fondo grynųjų aktyvų verte dalinant iš apskaitos vienetų skaičiaus. Apskaitos vienetų vertė nustatoma keturių skaičių po kablelio tikslumu, o apskaitos vienetų skaičius nustatomas dviejų skaičių po kablelio tikslumu.

P pinigų ekvivalentai – pinigų ekvivalentus sudaro grynieji pinigai ir lėšos kredito įstaigose bei terminuoti indėliai iki 3 mėn.

Investicijų portfelio struktūra pateikiama lentelėje “Investicijų portfelio sudėtis”.

3. Pastabos.

1. *Pastaba.* Pateikiama "Investicijų vertės pokyčio" lentelė, kur parodomi investicijų vertės pokyčiai per ataskaitinį laikotarpį dėl jų įsigijimo, pardavimo arba išpirkimo ir tikrosios vertės pasikeitimo.

Investicijų vertės pokytis

1 pastaba

(litas)

Balanso straipsniai	Pokytis						
	praėjusio ataskaitinio laikotarpio pabaigoje	įsigyta	parduota (išpirkta)	sukauptos palūkanos	vertės padidėjimas	vertės sumažėjimas	ataskaitinio laikotarpio pabaigoje
Skolos vertybiniai popieriai		32774592	19551397	113727	75274	38371	13373825
Vyriausybių ir centrinių bankų arba jų garantuoti skolos vertybiniai popieriai		2033592	1416162	11683	17556	0	646669
Kiti skolos vertybiniai popieriai		30741000	18135235	102044	57718	38371	12727156
Nuosavybės vertybiniai popieriai		1159866	125485	0	147359	17947	1163793
Kolektyvinio investavimo subjektų investiciniai vienetai ir akcijos		4631524	1181509	0	38912	7296	3481631
Kitos investicijos							
Iš viso		38565982	20858391	113727	261545	63614	18019249

2. *Pastaba.* Pateikiama "Turto struktūros ataskaitinio laikotarpio pabaigoje" lentelė, kur pagal turto rūšis ir investicijų emitentus pateikiama turto ir investicijų tikroji vertė ataskaitinio laikotarpio pabaigoje, atitinkamo turto ir investicijos lyginamoji dalis, palyginti su balanso straipsniu "Turtas iš viso", išreikšta procentais, ir priklausomai nuo turto ir investicijos rūšies- nominali vertė, jeigu investicija ją turi, palūkanų norma, jeigu ji yra, investicijos pabaigos terminas, jeigu ji terminuota.

Turto struktūra ataskaitinio laikotarpio pabaigoje

2 pastaba

(litas)

Turto arba emitento pavadinimas	Valstybės, į kurios vertybinius popierius investuota,	Valiutos, kuria denominuotas turtas, pavadinimas	Nominali vertė (jeigu ji yra)	Metinė palūkanų norma % (jeigu ji yra)	Indėlio, investicijos pabaigos terminas (jeigu ji)	Tikroji vertė	Turto, investicijos lyginamoji dalis (procentais)
Pinigai a/s Hansabanke		LTL				25049	0.13%
Pinigai a/s Hansabanke		USD				2707	0.01%
Pinigai a/s Hansabanke		EUR				9	0.00%
Terminuotas indėlis		LTL		185.00%	38355	775800	4.12%
Kitos gautinos sumos		USD				19224	0.10%
Kitos gautinos sumos		CAD				150	0.00%
Kitos gautinos sumos		AUD				257	0.00%
Kitos gautinos sumos		JPY				2447	0.01%

Vyriausybės VP emisija Nr.60317	Lietuva	LTL	91400	3.50%	38960	94080	0.50%
Vyriausybės VP emisija Nr.60509	Lietuva	LTL	235900	3.90%	40010	248239	1.32%
Vyriausybės VP emisija Nr.60172	Lietuva	LTL	150400		38561	148373	0.79%
Vyriausybės VP emisija Nr.61004	Lietuva	LTL	131800	5.06%	41298	155978	0.83%
Vengrijos Vyriausybė	Vengrija	EUR	466128	2.67%	38666	469883	2.49%
Lenkijos Vyriausybė	Lenkija	EUR	469581	2.30%	38978	470517	2.50%
Prancūzijos Vyriausybė	Prancūzija	EUR	379808	3.50%	40154	394390	2.09%
Italijos Vyriausybė	Italija	EUR	504109	8.75%	38928	572661	3.04%
Graikijos Vyriausybė	Graikija	EUR	545542	4.50%	41779	598993	3.18%
Vokietijos Vyriausybė	Vokietija	EUR	362544	3.50%	40095	374352	1.99%
TPSA Eurofinance	Olandija	EUR	314205	6.50%	39154	355264	1.89%
Latvijos Vyriausybė	Latvija	EUR	310752	5.38%	39779	597322	3.17%
Belgijos Vyriausybė	Belgija	EUR	428147	4.75%	38988	450061	2.39%
Zagrebacka Bank	Kroatija	EUR	345280	4.25%	40007	600711	3.19%
PAN European Credit	Liuksemburgas	EUR	621504	3.27%	40106	629672	3.34%
Ispanijos Vyriausybė	Ispanija	EUR	359091	5.50%	42946	425399	2.26%
Prancūzijos Vyriausybė	Prancūzija	EUR	1316207		38372	1314737	6.98%
Prancūzijos Vyriausybė	Prancūzija	EUR	821766	2.25%	38788	836084	4.44%
CEZ Finance BV	Čekija	EUR	504109	4.63%	40702	539307	2.86%
Eesti Energia	Estija	EUR	158829	6.00%	40018	536834	2.85%
Vokietijos Vyriausybė	Vokietija	EUR	776880	3.74%	42008	784172	4.16%
Slovakijos Vyriausybė	Slovakija	EUR	479939	7.38%	40282	599603	3.18%
Olandijos Vyriausybė	Olandija	EUR	127754	3.75%	40009	420186	2.23%
Lenkijos Vyriausybė	Lenkija	EUR	258960	3.88%	39828	275226	1.46%
Slovenijos Vyriausybė	Slovėnija	EUR	542090	4.88%	39890	600725	3.19%
Italijos Vyriausybė	Italija	EUR	832125	4.26%	41852	881057	4.68%
Rytų skirst. Tinklai	Lietuva	LTL				28256	0.15%
AB Snaigė	Lietuva	LTL				53773	0.29%
Liet.Telekom	Lietuva	LTL				111017	0.59%
TPSA	Lenkija	PLN				64365	0.34%
PKN	Lenkija	PLN				53143	0.28%
KGHM	Lenkija	PLN				45915	0.24%
HP	Estija	EEK				54019	0.29%
EST.TEL	Estija	EEK				56930	0.30%
MOL	Vengrija	HUF				55219	0.29%
PLIVA	Kroatija	USD				41281	0.22%
BANK KOM	Čekija	CZK				52206	0.28%
OTP	Vengrija	HUF				58887	0.31%
GDRB	Vengrija	HUF				43679	0.23%
FHB	Vengrija	HUF				60760	0.32%
TELECOM	Čekija	CZK				49633	0.26%
MERCATOR	Slovėnija	SIT				42156	0.22%
NORMA	Estija	EEK				84312	0.45%
SAF TEHNIKA	Latvija	LVL				80345	0.43%
OLVY OYJ	Suomija	EUR				81352	0.43%
PEKAO	Lenkija	PLN				46545	0.25%
EEM	JAV	USD				322812	1.71%
TRPEURBD	Liuksemburgas	EUR				1037908	5.51%
HIEAFEUR	Estija	EUR				305062	1.62%
BALZACEUR	Prancūzija	EUR				740238	3.93%
BALZACAUS	Prancūzija	AUD				43525	0.23%
BALZACCAN	Prancūzija	CAD				43329	0.23%
BALZACJPN	Prancūzija	JPY				174665	0.93%
BALZACUSA	Prancūzija	USD				814091	4.32%
Iš viso	X	X	X	X	X	18844892	100.00%

VII. INFORMACIJA APIE PENSIJŲ FONDO DALYVIUS

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

Dalyvių skaičius ataskaitinio laikotarpio pradžioje		67667
Dalyvių skaičius ataskaitinio laikotarpio pabaigoje	<i>Dalyviai, pasinaudoję teise nukelti pensijų išmokos mokėjimą</i>	0
	<i>Dalyviai, gaunantys periodines pensijų išmokas</i>	0
	Iš viso:	92951
Dalyvių skaičiaus pokytis		25284

26. Per ataskaitinį laikotarpį prisijungusių dalyvių skaičius:

Bendras prisijungusių dalyvių skaičius		25516
Dalyviai, pensijų kaupimo sutartis sudarę pirmą kartą		25450
Iš kitų pensijų fondų atėję dalyviai	<i>Iš tos pačios pensijų kaupimo bendrovės</i>	66
	<i>Iš kitos pensijų kaupimo bendrovės</i>	0

27. Per ataskaitinį laikotarpį pasitraukusių dalyvių skaičius:

Bendras pasitraukusių dalyvių skaičius		232
I kitus pensijų fondus išėjusių dalyvių skaičius	Valdomus tos pačios pensijų kaupimo bendrovės	165
	Valdomus kitos pensijų kaupimo bendrovės	0
Baigusią dalyvavimą dalyvių skaičius	Išstojusią	61
	Sulaukusią nustatyto pensijos amžiaus ir pasinaudojusią teise į pensijų išmoką (vienkartinę išmoką, anuitetą ir jų derinį)	0
	Mirusių dalyvių	6

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

Bendras dalyvių skaičius	Dalyviai iki 30 m.				Dalyviai nuo 30 m. iki 45 m				Dalyviai nuo 45 m. iki 60 m.				Dalyviai, vyresnių kaip 60 m.			
	vyrų		moterų		vyrų		moterų		vyrų		moterų		vyrų		moterų	
	skaičius	%	skaičius	%	skaičius	%	skaičius	%	skaičius	%	skaičius	%	skaičius	%	skaičius	%
92951	3871	4%	4346	5%	32248	35%	41271	44%	5414	6%	5800	6%	1	0%	0	0%

VIII. PINIGŲ SRAUTAI

29. Per ataskaitinį laikotarpį faktiškai gautos lėšos:

Bendra gautų lėšų suma		18,916,050
Periodinės įmokos į pensijų fondą	Iš Valstybinio socialinio draudimo fondo	18,912,433
	Pačio dalyvio įmokėtos lėšos (pildoma tik papildomo savanoriško pensijų kaupimo pensijų fondo atveju)	0
	Darbdavių ir kitų trečiųjų asmenų įmokėtos lėšos (pildoma tik papildomo savanoriško pensijų kaupimo pensijų fondo atveju)	0
Valstybinio socialinio draudimo fondo sumokėti delspinigiai		0
Iš garantijų rezervo sumokėtos lėšos		0
Iš kitų pensijų fondų pervestos lėšos	Iš tos pačios pensijų kaupimo bendrovės	3,617
	Iš kitos pensijų kaupimo bendrovės	0
Kitos gautos lėšos (nurodyti šaltinį ir gautų lėšų sumą)		0

30. Išmokėtos lėšos:

Bendra išmokėtų lėšų suma		14,272
Pensijų išmokos	Vienkartinės išmokos dalyviams	0
	Periodinės išmokos dalyviams	0
	Išmokos anuiteto įsigijimui	0
Į kitus pensijų fondus pervestos lėšos	Valdomus tos pačios pensijų kaupimo bendrovės	10,353
	Valdomus kitos pensijų kaupimo bendrovės	0
Išstojusiems dalyviams išmokėtos lėšos		2,176
Paveldėtojams išmokėtos lėšos		1,743
Kitais pagrindais išmokėtos lėšos		0

IX. INFORMACIJA APIE GARANTIJŲ REZERVĄ

31. Jei pensijų fondo taisyklėse numatytas įsipareigojimas garantuoti tam tikrą pajamingumą, nurodyti garantuojamo pajamingumo dydį, per ataskaitinį laikotarpį į garantinį rezervą įmokėtų įmokų sumą, pateikti jo investicijų 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

32. Pensijų fondas neturėjo pasiskolintų lėšų ataskaitinio laikotarpio pabaigoje,

XI. KITOS NUOSTATOS

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

34. Konsultantų, kurių paslaugomis buvo naudotasi rengiant ataskaitą (FMĮ, auditoriai, kt.), vardai, pavardės (juridinių asmenų pavadinimai), adresai, leidimų verstis atitinkama veikla pavadinimas ir numeris. -.

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

36. 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.

Tvirtiname:

UAB Hansa Investicijų valdymas

Administracijos vadovas

A.Maždzierius

UAB Hansa Investicijų valdymas

Vyriausioji finansininkė

A.Žeknienė

UAB Hansa Investicijų valdymas

Investicijų vadybininkas

A.Baradokas

UAB Hansa Investicijų valdymas

Apskaitininkas

T.Kivaras

