

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

PENSIJŲ FONDO 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. Justiniškių g. 64, 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. Depozitoriumo pavadinimas, kodas, adresas, telefono ir fakso numeriai.

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

5. Ataskaitinis laikotarpis, už kurį pateikta ataskaita - 2005 metų I pusmetis.

II. GRYNŲJŲ AKTYVŲ, APSKAITOS VIENETŲ SKAIČIAUS IR VERTĖS POKYČIAI

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

	Ataskaitinio laikotarpio pradžioje (2004-12-31)	Ataskaitinio laikotarpio pabaigoje (2005-06-30)	Prieš metus (2004-06-30)	Prieš dvejus metus (data)
GAV	18,810,597	52,022,978	5,898,719.59	-
Apskaitos vieneto vertė (Lt)	1.0472	1.0946	1.0003	-
Apskaitos vienetų skaičius	17,963,057.218	47,526,115.951	5,896,715.857	-

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)	29,844,492.545	32,033,924.89
Vienetų skaičius (konvertuojant vienetų į pinigines lėšas)	281,433.812	300,079.18

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%	744,290.91	744,290.91
Nuo turto vertės	1%	1%	166,486.35	68,312.36
Keitimo mokesčiai:				
<i>Fondo keitimas toje pačioje bendrovėje daugiau kaip kartą per metus</i>	0.2%	-	0.00	0.00
<i>Pensijų kaupimo bendrovės keitimas kartą per metus</i>	0.2%	-	0.00	0.00
<i>Pensijų</i>	0.2%	-	0.00	0.00

<i>kaupimo bendrovės keitimas daugiau kaip kartą per metus</i>				
Iš viso:			910,777.26	812,603.27
BIK (bendrasis išlaidų koeficientas):			2.77%	
PAR (portfelio apyvartumo rodiklis):	84			

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).

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 portfelyje/ grynose aktyvuose (%)
Nuosavybės vertybiniai popieriai, įtraukti į Oficialųjį prekybos sąrašą										
MOL	Vengrija	HU0000068952	562	7,841.59	87,685.23	156.02	134,365.58	www.bet.hu	0%	0%
KGHM Polska Miedz	Lenkija	PLKGHM000017	6441	54,860.57	165,028.69	25.62	186,525.95	www.gpw.com.pl	0%	0%
PKN Orlen	Lenkija	PLPKN0000018	3569	3,799.83	112,215.43	31.44	153,208.95	www.gpw.com.pl	0%	0%
Telekom Polska	Lenkija	PLTLKPL00017	9067	23,168.18	128,967.59	14.22	159,860.44	www.gpw.com.pl	0%	0%
OTP Bank	Vengrija	HU0000061726	1589	2,217.13	119,279.78	75.07	153,447.68	www.bet.hu	0%	0%
Gedeon Richter	Vengrija	HU0000067624	434	6,055.60	156,224.03	359.96	181,819.45	www.bet.hu	0%	0%
FHB Bank	Vengrija	HU0000078175	7821	0.00	129,397.73	16.54	156,050.77	www.bet.hu	0%	0%
CEZ AS	Čekija	CZ0005112300	2847	32,751.89	123,437.58	43.36	154,195.89	www.pse.cz	0%	0%
Mercator	Slovėnija	SI0031100082	103	14,853.63	60,073.04	583.23	49,759.66	www.ljse.si	0%	0%
Snaigė	Lietuva	LT0000109274	13053	13,053.00	227,621.11	17.44	214,069.20	www.nse.lt	0%	0%
Norma AS	Estija	EE3100001850	8825	304,709.60	203,895.83	23.10	221,206.61	www.hex.ee	0%	0%
SAF Tehnika	Latvija	LV0000101129	2952	14,640.74	218,213.59	73.92	185,205.35	www.rfb.lv	0%	0%
Lietuvos Telekomas	Lietuva	LT0000123911	101524	101,524.00	212,310.49	2.09	221,322.32	www.nse.lt	0%	0%
OLVI Plc A	Suomija	FI0009900401	2722	18,797.04	127,313.54	46.77	167,857.60	www.hex.com	0%	0%
BANK PEKAO	Lenkija	PLPEKAO00016	1427	1,215.43	168,479.99	118.07	175,022.35	www.gpw.com.pl	0%	0%
SWEDBANK	Švedija	SE0000242455	3438	1,259.82	222,593.92	64.75	216,059.25	www.omxgroup.com	0%	0%
Raiffeisen International	Austrija	AT0000060306	1117	3,856.78	150,992.84	135.18	203,676.43	www.wienerboerse.at	0%	0%
PKO Bank Polski	Lenkija	PLPKO0000016	6320	5,383.00	146,169.05	23.13	145,879.21	www.gpw.com.pl	0%	0%
Tallinn Water	Estija	EE3100026436	5820	1,284.30	215,581.59	37.04	227,680.60	www.hex.ee	0%	0%
IS viso:							3,307,213.29			6%
Nuosavybės vertybiniai popieriai, įtraukti į Einamąjį prekybos sąrašą										
IS viso:							0.00			0%
Nuosavybės vertybiniai popieriai, kuriais prekiaujama kitose reguliuojamose rinkose										
PLIVA	Kroatija	US72917Q2021	4977	1,427,353.83	181,904.55	36.55	182,701.29	www.londonstockexchange.com	0%	0%
IS viso:							182,701.29			0%
Išleidžiami nauji nuosavybės vertybiniai popieriai										
IS viso:							0.00			0%
IS viso nuosavybės vertybinių popierių:										
							3,489,914.58			
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 portfelyje/ grynose aktyvuose (%)
Skolos vertybiniai popieriai, įtraukti į Oficialųjį prekybos sąrašą										
IS viso:							0.00			0%
Skolos vertybiniai popieriai, įtraukti į Einamąjį prekybos sąrašą										
Lietuvos Vyriausybė	Lietuva	LT0000603177	1294	91,400.00	134,380.76	103.85	135,048.93	3.500%	2006-08-31	0%
Lietuvos Vyriausybė	Lietuva	LT0000605099	3340	235,900.00	340,339.52	101.90	362,589.38	3.900%	2009-07-16	1%
Lietuvos Vyriausybė	Lietuva	LT0000610040	1860	131,800.00	207,316.77	111.46	220,203.10	5.600%	2013-01-24	0%
IS viso:							717,841.42			1%
Skolos vertybiniai popieriai, kuriais prekiaujama kitose reguliuojamose rinkose										
Vengrijos Vyriausybė	Vengrija	DE0002918232	468	1,615,910.40	1,698,837.61	3,629.99	1,745,121.15	4.375%	2009-02-16	3%
Prancūzijos Vyriausybė	Prancūzija	FR0106841887	430000	379,808.00	1,530,962.35	3.56	1,596,427.00	3.500%	2009-07-12	3%
Vokietijos Vyriausybė	Vokietija	DE0001141455	38500000	362,544.00	1,369,700.49	0.04	1,423,879.25	3.500%	2009-10-09	3%
Latvijos Vyriausybė	Latvija	XS0138888689	311	310,752.00	1,184,725.98	3,809.41	1,209,295.04	5.375%	2008-11-27	2%
TPSA Eurofinance	Olandija	XS0108724138	129	314,204.80	498,194.06	3,861.97	484,033.25	6.500%	2007-03-13	1%
Zagrebacka Bank	Kroatija	XS0196346042	237	345,280.00	847,474.79	3,575.84	890,477.64	4.250%	2009-07-13	2%
Pan European Credit	Liuksemburgas	XS0203812994	26	621,504.00	903,622.62	34,754.72	925,218.68	3.268%	2009-10-28	2%
Eesti Energia	Estija	XS0151428801	196	676,748.80	762,783.73	3,891.75	791,697.83	6.000%	2009-07-24	2%
CEZ Finance BV	Čekija	XS0193834156	207	714,729.60	772,892.98	3,733.78	771,327.38	4.625%	2011-06-08	1%
Slovakijos Vyriausybė	Slovakija	DE0001074763	260	897,728.00	1,125,365.28	4,328.33	1,100,038.37	7.375%	2010-04-14	2%
Italijos Vyriausybė	Italija	IT0003618383	342	1,180,857.60	1,260,952.45	3,687.00	1,293,267.07	4.250%	2014-08-01	2%
Slovėnijos Vyriausybė	Slovėnija	XS0095561683	222	766,521.60	852,955.52	3,842.14	841,863.32	4.875%	2009-03-18	2%
Lenkijos Vyriausybė	Lenkija	XS0183959914	111	383,260.80	404,437.65	3,643.58	407,451.12	3.875%	2009-01-15	1%
Prancūzijos Vyriausybė	Prancūzija	FR0105760112	975000	3,366,480.00	3,513,923.68	3.60	3,542,256.30	3.000%	2008-07-12	7%
Italijos Vyriausybė	Italija	IT0003080402	240	828,672.00	938,878.99	3,912.00	958,698.20	5.250%	2011-08-01	2%
Belgijos Vyriausybė	Belgija	BE0000296054	28500000	984,048.00	1,121,618.98	0.04	1,146,289.18	5.000%	2011-09-28	2%
Graikijos Vyriausybė	Graikija	GR0110015170	269	928,803.20	978,738.22	3,638.43	949,609.74	3.250%	2007-06-21	2%
SEB Vilniaus Bankas	Lietuva	LT0000403057	2169	216,900.00	218,147.40	100.58	220,881.78	3.100%	2008-02-20	0%
Pan European Credit	Liuksemburgas	XS0218046810	29	1,001,312.00	1,001,312.00	34,528.00	1,021,359.16	2.97%	2010-04-21	2%
Vokietijos Vyriausybė	Vokietija	DE0001141463	68200000	2,354,809.60	2,440,815.02	0.04	2,449,243.86	3.250%	2010-04-09	5%
Belgijos Vyriausybė	Belgija	BE0000306150	35000000	1,208,480.00	1,257,074.15	0.04	1,273,967.96	3.750%	2015-09-28	2%
Prancūzijos Vyriausybė	Prancūzija	FR0010163543	285000	984,048.00	1,010,641.78	3.55	1,016,057.89	3.500%	2015-04-25	2%
Ispanijos Vyriausybė	Ispanija	ES0000012908	849	2,931,427.20	3,059,726.14	3,603.92	3,067,493.56	3.000%	2007-07-30	6%
Lietuvos Vyriausybė	Lietuva	XS0163880502	160	552,448.00	606,483.84	3,790.52	612,291.73	4.500%	2013-03-05	1%
Portugalijos Vyriausybė	Portugalija	PTPBT7GE0008	250000	863,200.00	862,000.15	3.45	862,336.80	0.000%	2005-07-22	2%
Bulgarijos Vyriausybė	Bulgarija	XS0145624432	270	932,256.00	1,220,601.50	4,520.75	1,217,908.18	7.500%	2013-01-15	2%
IS viso:							31,818,491.43			61%

Išleidžiami nauji skolos vertybiniai popieriai										
IS viso:							0,00			0%
IS viso skolos vertybinių popierių:							32,536,332.85			63%

KIS pavadinimas	Šalis	ISIN kodas	Kiekis (vnt.)	Valdytojas (pavadinimas, įmonės kodas)	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 portfelyje/ grynuose aktyvuose (%)
Kolektyvinių investavimo subjektų, atitinkančių Kolektyvinio investavimo subjektų 40 str. 1 d. reikalavimus, vienetai (akcijos)										
BALZAC AUSTRALIA INDEX FUND	Prancūzija	FR0000018111	235.2447	State Street Global Advisors France S.A.	99,272.16	422.00	112,161.88	www.statestreetfrance.com	iki 10%	0%
BALZAC CANADA INDEX FUND	Prancūzija	FR0000018095	260.0181	State Street Global Advisors France S.A.	100,535.85	386.65	115,853.04	www.statestreetfrance.com	iki 10%	0%
BALZAC EUROPE INDEX FUND	Prancūzija	FR0000023194	4083.0621	State Street Global Advisors France S.A.	1,828,314.35	447.78	1,977,807.97	www.statestreetfrance.com	iki 10%	4%
BALZAC JAPAN INDEX FUND	Prancūzija	FR0000017931	2025.2082	State Street Global Advisors France S.A.	430,735.52	212.69	451,896.32	www.statestreetfrance.com	iki 10%	1%
BALZAC USA INDEX FUND	Prancūzija	FR0000018285	4541.9496	State Street Global Advisors France S.A.	1,952,672.12	429.92	2,133,895.94	www.statestreetfrance.com	iki 10%	4%
T. ROWE PRICE-EUROPEAN CORP.BD	Liuksemburgas	LU0133091248	72579.93	T Rowe Price Global Investment Services	3,051,689.83	42.05	3,122,525.62	www.trowepriceglobal.com	iki 10%	6%
Hansa Eastern European Equity Fund	Estija	EE3600073326	16906.345	Investeerimisfondid AS Hansa	751,551.70	44.45	846,426.31	www.hansa.ee	iki 10%	2%
Hansa Eastern European Bond Fund	Latvija	LV0000400166	665	Investment company Hansa Fondi	2,484,550.39	3,736.17	2,539,063.61	www.hansa.lv	0%	5%
T. ROWE PRICE-GLOBAL EMERG.M.EQ	Liuksemburgas	LU0133084979	15194.65	T Rowe Price Global Investment Services	537,008.19	35.34	634,041.52	www.trowepriceglobal.com	iki 10%	1%
J.Baer Multibond - Euro Corporate Bond Fund	Liuksemburgas	LU0159197010	7884.081	Julius Baer	3,066,084.75	388.90	3,117,481.18	www.juliusbaer.com	iki 10%	6%
IS viso:							15,051,153.38			29%
Kitų kolektyvinių investavimo subjektų vienetai (akcijos)										
IS viso:							0.00			0%
IS viso KIS vienetų (akcijų):										

Emitento pavadinimas	Šalis	Priemonės pavadinimas	Kiekis (vnt.)	Valiuta	Bendra rinkos vertė	Palūkanų norma	Galiojimo pabaigos data	Dalis portfelyje/ grynuose aktyvuose (%)
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 portfelyje/ grynuose aktyvuose (%)
Indėliai kredito įstaigose						
Hansabankas	Lietuva	LTL	1,038,393.12	1.85%	2005-07-01	2%
IS viso:			1,038,393.12			2%

Emitento pavadinimas	Šalis	Priemonės pavadinimas	Kita sandorio šalis	Valiuta	Investicinis sandoris (pozicija)	Investicinio sandorio (pozicijos) vertė	Bendra rinkos vertė	Rinkos pavadinimas (tinklapio adresas)	Galiojimo terminas	Dalis portfelyje/ grynuose aktyvuose (%)
Išvestinės investicinės priemonės, kuriomis prekiaujama reguliuojamose rinkose										
Iš viso:							0.00			0%
Kitos išvestinės investicinės priemonės										
Iš viso:							0.00			0%
Banko pavadinimas				Valiuta	Bendra rinkos vertė		Palūkanų norma	Dalis portfelyje/ grynuose aktyvuose (%)		
Pinigai										
Hansabankas				LTL	3,482.41			0%		
Hansabankas				EUR	1.24			0%		
Hansabankas				AUD	0.02			0%		
Hansabankas				HUF	1,874.40			0%		
Hansabankas				JPY	0.00			0%		
Iš viso:							5,358.07			0.00%
Pavadinimas	Trumpas apibūdinimas			Bendra vertė		Paskirtis			Dalis portfelyje/ grynuose aktyvuose (%)	
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	27,431,337	53%	12,289,252	65%
Kiti skolos vertybiniai popieriai ir jų fondai	13,884,066	27%	2,122,482	11%
Akcijos ir jų fondai	9,761,998	19%	3,607,516	19%
Terminuotieji indėliai ir gryniesi pinigai	1,043,751	2%	803,564	4%
Išvestiniai sandoriai	0	0%	22,078	0%
Iš viso:	52,121,152	100%	18,844,892	100%

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. -

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

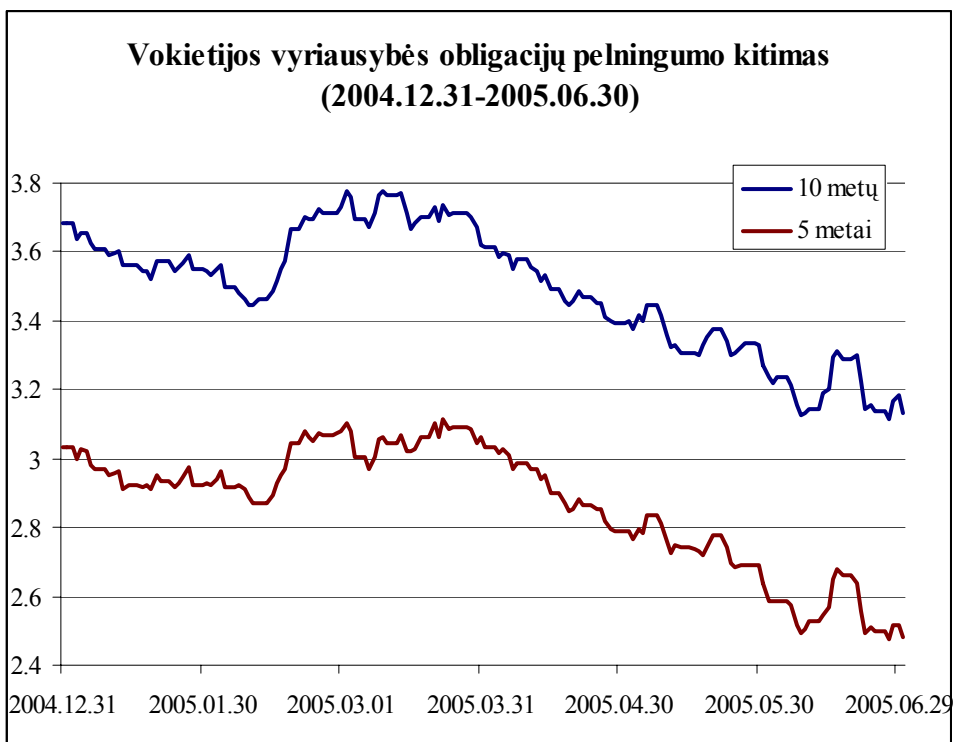
17. Pateikti analizę, kaip turimas investicijų portfelis atitinka (neatitinka) pensijų fondo investavimo strategiją (investicijų kryptis, investicijų specializaciją, geografinę zoną ir pan.).

Tai mišraus investavimo pensijų fondas, kurio lėšos pagal fondo investavimo strategiją gali būti investuotos į fiksuoto pajamingumo instrumentus (obligacijas, indėlius, ir pan.) ir nuosavybės vertybinius popierius (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 – nuosavybės vertybinių popierių 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 skolas vertybinius popierius, vienetai sudarė apie 80 % 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 - Subalansuotas" 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. 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 buvo įgyvendinamas per investicijų portfelio vidutinės finansinės trukmės valdymą (kylant palūkanoms, vidutinė finansinė trukmė trumpinama, palūkanoms krentant – ilginama).

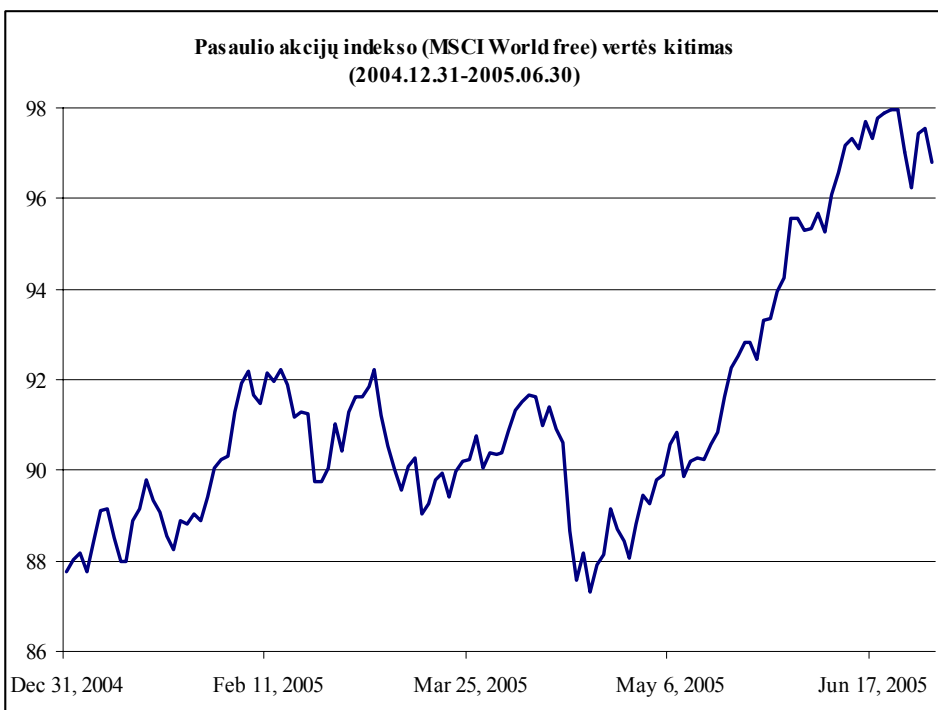
18. Nurodyti veiksniai, kurie turėjo didžiausią įtaką per ataskaitinį laikotarpį investicijų portfelio struktūros ir jo vertės pokyčiams.

Investicijų portfelio vertės kitimui įtaką daro pokyčiai valiutų, akcijų ir palūkanų rinkoje. 2005 m. I pusmetį Lietuvos ir kitose ES rinkose išliko 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 (žr. iliustraciją – Pasaulio akcijų indekso, perskaičiuoto eurais, vertės kitimo istorija). Priimant investicinius sprendimus, atsižvelgiama į skirtingų geografinių regionų vystymosi perspektyvas, todėl didelę įtaką portfelio vertės augimui turėjo didesnis svoris, suteiktas sparčiai augančiai Rytų ir Centrinės Europos akcijų rinkai.

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 rinkti (Vyriausybės obligacijas ar bendrovių), kokio termino, akcijas ar kolektyvinio investavimo subjektus, investuojančius į jas, ir t.t., kaip ir ar drausti tam tikras investicijų portfelio rizikas. Rinkoje vyraujant palūkanų mažėjimo tendencijoms, buvo ilginama investicijų vidutinė finansinė trukmė. Tendencijai keičiantis, investicijų portfelio vidutinė finansinė trukmė bus trumpinama - ilgesnio termino vertybiniai popieriai keičiami į trumpesnio termino.



Šaltinis: Bloomberg L.P.



Šaltinis: MSCI Inc.

V. PENSIJŲ FONDO INVESTICIJŲ GRAŽA IR RIZIKOS RODIKLIAI

19. Orientacinis indeksas ir trumpas jo apibūdinimas.

20. To paties laikotarpio pensijų fondo investicijų portfelio metinės investicijų gražos 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 graža. 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 graža				
Grynosios investicijų gražos 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				

grąža				
Vidutinės bendrosios investicijų grąžos 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 2005 m. birželio 30 d. duomenis

(litas)

Eil. Nr.	Turtas	Pastabų Nr.	Ataskaitinis laikotarpis 2005 06 30	Praėjęs atask. laikotarpis 2004 06 30
I.	PINIGAI IR PINIGŲ EKVIVALENTAI		5358	2332971
II.	TERMINUOTI INDĖLIAI		1038393	0
III.	INVESTICIJOS		51077401	3568048
1.	Skolos vertybiniai popieriai		32536333	3568048
1.1.	Vyriausybių ir centrinių bankų arba jų garantuoti skolos vertybiniai popieriai		1330133	1410418
1.2.	Kiti skolos vertybiniai popieriai		31206200	2157630
2.	Nuosavybės vertybiniai popieriai		3489915	0
3.	Kolektyvinio investavimo subjektų investiciniai vienetai ir akcijos		15051153	0
4.	Kitos investicijos			
IV.	GAUTINOS SUMOS		0	0
1.	Investicijų pardavimo sandorių gautinos sumos			
2.	Kitos gautinos sumos		0	0
	TURTAS, IŠ VISO		52121152	5901019

Eil. Nr.	Įsipareigojimai ir gryniesi aktyvai	Pastabų Nr.	Ataskaitinis laikotarpis 2005 06 30	Praėjęs atask. laikotarpis 2004 06 30
V.	ĮSIPAREIGOJIMAI		98174	2299
1.	Investicijų pirkimo įsipareigojimai			
2.	Mokėtinos sumos kaupimo bendrovei ir depozitoriumui		98174	2299
3.	Kitos mokėtinos sumos ir įsipareigojimai		0	
VI.	GRYNIEJI AKTYVAI (I+II+III+IV-V)		52022978	5898720
	ĮSIPAREIGOJIMAI IR GRYNIEJI AKTYVAI, IŠ VISO		52121152	5901019

24.2. paskutinių 3 finansinių metų grynujų aktyvų pokyčių ataskaitas, išdėstytas palyginamojoje lentelėje;

GRYNUJŲ AKTYVŲ POKYČIŲ ATASKAITA
pagal 2005 m. birželio 30 d. duomenis

(litas)

Eil. Nr.	Straipsniai	Pastabų Nr.	Ataskaitinis laikotarpis 2005 06 30	Praėjęs atask. laikotarpis 2004 06 30
I.	GRYNIEJI AKTYVAI ATASKAITINIO LAIKOTARPIO PRADŽIOJE		18810597	0
II.	PADIDĖJIMAS, IŠ VISO		35148432	6083744
1.	Pensijų įmokos		24806345	6079101
2.1.	Iš kitų pensijų fondų pervestos sumos		32085	
2.2.	Iš fondų sujungimo gautos sumos		7887870	
3.	Kaupimo bendrovės garantinės įmokos			
4.	Palūkanos ir dividendai		479303	1750
5.	Investicijų pardavimo pelnas		225560	2283
6.	Investicijų vertės padidėjimo suma		1706527	610
7.	Turto vertės padidėjimas dėl užsienio valiutų kursų pasikeitimo		10742	
8.	Kitos pajamos			
III.	SUMAŽĖJIMAS, IŠ VISO		1936051	185024
1.	Pensijų išmokos		11940	
2.	Į kitus pensijų fondus pervestos sumos		290303	
3.	Investicijų pardavimo nuostoliai		37080	
4.	Investicijų vertės sumažėjimo suma		418442	119
5.	Turto vertės sumažėjimas dėl užsienio valiutų kursų pasikeitimo		267509	233
6.	Valdymo sąnaudos		910777	184672
7.	Kitos sąnaudos			
IV.	GRYNIEJI AKTYVAI ATASKAITINIO LAIKOTARPIO PABAIGOJE		52022978	5898720
V.	APSKAITOS VIENETO VERTĖ		1.0946	1.0003
VI.	APSKAITOS VIENETŲ SKAIČIUS		47526115.951	5896715.857

24.3. aiškinamąjį raštą.

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 Justiniškių g. 64, Vilnius.

Depozitoriumas, kuris saugo pensijų fondo turta – 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 atskaitos 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. Atskaitos 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 apsikaitimo 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 apsikaitimo 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 visuotiniai 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, didesnė 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 įsipareigojimų 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 neprekiuojama 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.

Pinigų ekvivalentai – pinigų ekvivalentus sudaro gryniesi 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.

(litas)

Balanso straipsniai	Pokytis						
	praėjusio ataskaitinio laikotarpio pabaigoje	įsigyta	parduota (išpirkta)	sukauptos palūkanos	vertės padidėjimas	vertės sumažėjimas	ataskaitinio laikotarpio pabaigoje
Skolos vertybiniai popieriai	13373825	33303318	14853322	381714	463968	133170	32536333
<i>Vyriausbių ir centrinių bankų arba jų garantuoti skolos vertybiniai popieriai</i>	646669	873503	219194	13279	20441	4565	1330133
<i>Kiti skolos vertybiniai popieriai</i>	12727156	32429815	14634128	368435	443527	128605	31206200
Nuosavybės vertybiniai popieriai	1163793	2462212	412884	0	450034	173240	3489915
Kolektyvinio investavimo subjektų investiciniai vienetai ir akcijos	3481631	11225994	398911	0	877692	135253	15051153
Kitos investicijos							
Iš viso	18019249	46991524	15665117	381714	1791694	441663	51077401

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.

(litas)

Turto arba emitento pavadinimas	Valstybės, į kurios vertybinius popierius investuota, pavadinimas	Valiutos, kuria denominuotas turtas, pavadinimas	Nominali vertė (jeigu ji yra)	Metinė palūkanų norma % (jeigu ji yra)	Indėlio, investicijos pabaigos terminas (jeigu ji terminuota)	Tikroji vertė	Turto, investicijos lyginamoji dalis (procentais)
Pinigai a/s HB*		LTL				3483	0.01%
Pinigai a/s HB*		EUR				1	0.00%
Pinigai a/s HB*		HUF				1874	0.00%
Terminuotas indėlis		LTL		1.85	2005.07.01	1038393	1.99%
Vyriausybės VP emisija Nr.60317	Lietuva	LTL	129400	3.50%	2006.08.31	135049	0.26%
Vyriausybės VP emisija Nr.60509	Lietuva	LTL	207800	3.90%	2009.07.16	362589	0.70%
Vyriausybės VP emisija Nr.61004	Lietuva	LTL	186000	5.06%	2013.01.24	220203	0.42%
SEB Vilniaus bankas	Lietuva	LTL	216900	3.10%	2008.02.20	220882	0.42%
Vengrijos Vyriausybė	Vengrija	EUR	1615910	4.38%	2009.02.16	1745121	3.35%
Prancūzijos Vyriausybė	Prancūzija	EUR	1484704	3.50%	2009.07.12	1596427	3.06%
Vokietijos Vyriausybė	Vokietija	EUR	1329328	3.50%	2009.10.09	1423879	2.73%
TPSA Eurofinance	Olandija	EUR	445411	6.50%	2007.03.13	484033	0.93%
Latvijos Vyriausybė	Latvija	EUR	1073821	5.38%	2008.11.27	1209295	2.32%
Zagrebacka Bank	Kroatija	EUR	818314	4.25%	2009.07.13	890478	1.71%
PAN European Credit	Liuksemburgas	EUR	897728	3.27%	2009.10.20	925219	1.78%
CEZ Finance BV	Čekija	EUR	714730	4.63%	2011.06.08	771327	1.48%
Eesti Energia	Estija	EUR	676749	6.00%	4067.08.04	791698	1.52%
Vokietijos Vyriausybė	Vokietija	EUR	2354810	3.25%	2010.04.09	2449244	4.70%
Slovakijos Vyriausybė	Slovakija	EUR	897728	7.38%	2010.04.14	1100038	2.11%
Lenkijos Vyriausybė	Lenkija	EUR	383261	3.88%	2009.01.15	407451	0.78%
Slovėnijos Vyriausybė	Slovėnija	EUR	766522	4.88%	2009.03.18	841863	1.62%
Italijos Vyriausybė	Italija	EUR	1180858	4.25%	2014.08.01	1293267	2.48%
Graikijos Vyriausybė	Graikija	EUR	928803	3.25%	2007.06.21	949610	1.82%
Ispanijos Vyriausybė	Ispanija	EUR	2931427	3.00%	2007.07.30	3067494	5.89%
Prancūzijos Vyriausybė	Prancūzija	EUR	3366480	3.00%	2008.07.12	3542256	6.80%
Italijos Vyriausybė	Italija	EUR	828672	5.25%	2011.08.01	958698	1.84%
Belgijos Vyriausybė	Belgija	EUR	984048	5.00%	2011.09.28	1146289	2.20%
PAN European Credit	Liuksemburgas	EUR	1001312	2.96%	2010.04.21	1021359	1.96%
Prancūzijos Vyriausybė	Prancūzija	EUR	984048	3.50%	2015.04.25	1016058	1.95%
Belgijos Vyriausybė	Belgija	EUR	1208480	3.75%	2015.09.28	1273968	2.44%
Lietuvos Vyriausybė	Lietuva	EUR	552448	4.50%	2013.03.05	612292	1.17%
Portugalijos Vyriausybė	Portugalija	EUR	863200		2005.07.22	862337	1.65%
Bulgarijos Vyriausybė	Bulgarija	EUR	932256	7.50%	2013.01.15	1217908	2.34%

AB Snaigė	Lietuva	LTL				214069	0.41%
Liet.Telekom	Lietuva	LTL				221322	0.42%
TPSA	Lenkija	PLN				159860	0.31%
PKN	Lenkija	PLN				153209	0.29%
KGHM	Lenkija	PLN				186526	0.36%
MOL	Vengrija	HUF				134366	0.26%
PLIVA	Kroatija	USD				182701	0.35%
OTP	Vengrija	HUF				153448	0.29%
GDRB	Vengrija	HUF				181820	0.35%
FHB	Vengrija	HUF				156051	0.30%
MERCATOR	Slovėnija	SIT				49760	0.10%
NORMA	Estija	EEK				221207	0.42%
SAF TEHNIKA	Latvija	LVL				185205	0.36%
OLVY OYJ	Suomija	EUR				167858	0.32%
PEKAO	Lenkija	PLN				175022	0.34%
Swedbank	Švedija	SEK				216059	0.41%
Raiffeisen	Austrija	EUR				203676	0.39%
CEZ	Čekija	CZK				154196	0.30%
Tallinna Vesi	Estija	EEK				227681	0.44%
PKO	Lenkija	PLN				145879	0.28%
TRPEURBD	Liuksemburgas	EUR				3122526	5.99%
HIEAFEUR	Estija	EUR				846426	1.62%
BALZACEUR	Prancūzija	EUR				1977808	3.79%
BALZACAUS	Prancūzija	AUD				112162	0.22%
BALZACCAN	Prancūzija	CAD				115853	0.22%
BALZACJPN	Prancūzija	JPY				451896	0.87%
BALZACUSA	Prancūzija	USD				2133896	4.09%
TRPGEMI	Liuksemburgas	USD				634042	1.22%
OBLIFOND	Latvija	EUR				2539064	4.87%
JBMBCB	Liuksemburgas	EUR				3117481	5.98%
Iš viso	X	X	X	X	X	52121152	100%

* - AB bankas "Hansabankas"

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		92,951
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:	142,727
Dalyvių skaičiaus pokytis		49,776

26. Per ataskaitinį laikotarpį prisijungusių dalyvių skaičius:

Bendras prisijungusių dalyvių skaičius		50,473
Dalyviai, pensijų kaupimo sutartis sudarę pirmą kartą		18,261
Iš kitų pensijų fondų atėję dalyviai	<i>Iš tos pačios pensijų kaupimo bendrovės</i>	32,212
	<i>Iš kitos pensijų kaupimo bendrovės</i>	0

27. Per ataskaitinį laikotarpį pasitraukusių dalyvių skaičius:

Bendras pasitraukusių dalyvių skaičius		697
Į kitus pensijų fondus išėjusių dalyvių skaičius	Valdomus tos pačios pensijų kaupimo bendrovės	615
	Valdomus kitos pensijų kaupimo bendrovės	0
Baigusią dalyvavimą dalyvių skaičius	Išstojusių	46
	Sulaukusių nustatyto pensijos amžiaus ir pasinaudojusių teise į pensijų išmoką (vienkartinę išmoką, anuitetą ir jų derinį)	1
	Mirusių dalyvių	35

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.			
	vyrai		moterys		vyrai		moterys		vyrai		moterys		vyrai		moterys	
	skaičius	%	skaičius	%	skaičius	%	skaičius	%	skaičius	%	skaičius	%	skaičius	%	skaičius	%
142,727	6,390	4%	6,502	5%	47,039	33%	59,200	41%	11,249	8%	12,331	9%	16	0%	0	0%

VIII. PINIGŲ SRAUTAI

29. Per ataskaitinį laikotarpį faktiškai gautos lėšos:

Bendra gautų lėšų suma		24,838,429.89
Periodinės įmokos į pensijų fondą	Iš Valstybinio socialinio draudimo fondo	24,806,345.13
	Pačio dalyvio įmokėtos lėšos (pildoma tik papildomo savanoriško pensijų kaupimo pensijų fondo atveju)	-
	Darbdavių ir kitų trečiųjų asmenų įmokėtos lėšos (pildoma tik papildomo savanoriško pensijų kaupimo pensijų fondo atveju)	-
Valstybinio socialinio draudimo fondo sumokėti delspinigiai		0
Iš garantijų rezervo sumokėtos lėšos		0
Iš kitų pensijų fondų pervestos lėšos	Iš tos pačios pensijų kaupimo bendrovės	32,084.76
	Iš kitos pensijų kaupimo bendrovės	0
Kitos gautos lėšos (nurodyti šaltinį ir gautų lėšų sumą)		0

30. Išmokėtos lėšos:

Bendra išmokėtų lėšų suma		302,242.71
Pensijų išmokos	Vienkartinės išmokos dalyviams	1,009.32
	Periodinės išmokos dalyviams	0
	Išmokos anuiteto įsigijimui	0
Į kitus pensijų fondus pervestos lėšos	Valdomus tos pačios pensijų kaupimo bendrovės	290,302.98
	Valdomus kitos pensijų kaupimo bendrovės	0
Išstojusiems dalyviams išmokėtos lėšos		0
Paveldėtojams išmokėtos lėšos		10,930.41
Kitais pagrindais išmokėtos lėšos		0

INFORMACIJA APIE GARANTIJŲ REZERVĄ

31. Jei pensijų fondo taisyklėse numatytas išsipareigojimas 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 fondo reikmėms pasiskolintos lėšos ataskaitinio laikotarpio pabaigoje:

Eil. Nr.	Paskolos suma	Paskolos valiuta	Paskolos paėmimo data	Paskolos grąžinimo terminas	Palūkanų dydis	Skolinimosi tikslas	Kreditorius	Skolintų lėšų dalis, lyginant su fondo GA (%)
Iš viso:								

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.Maždžierius

UAB "Hansa investicijų valdymas"
Vyriausioji finansininkė

_____ A.Žeknienė

UAB "Hansa investicijų valdymas"
Investicijų vadybininkas

_____ A.Baradokas

UAB "Hansa investicijų valdymas"
Apskaitininkas

_____ T.Kivaras