

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

PENSIJŲ FONDO „PENSIJA 2” 2007 METŲ 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(002).

2. Valdymo įmonės duomenys:

2.1. UAB “Hansa investicijų valdymas”, 124815377;

2.2. Juridinis adresas – Savanorių pr. 19, Vilnius, buveinė - Tuskulėnų g. 39, Vilnius;

2.3. tel.: (8-5) 268-44-44, faks.: (8-5) 268-48-19, investicijuvaldymas@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. 2657930, faks.2684819, aurimas.mazdzierius@hansa.lt;

- valdybos narė ir valdymo įmonės vyriausioji finansininkė Aurelija Žeknienė, tel. 2657931, faks. 2684819, aurelija.zekniene@hansa.lt;

- valdymo įmonės ekonomistas – Tomas Kivaras, tel. 2657939, faks.2684819, tomas.kivaras@hansa.lt;

- valdymo įmonės fondų valdytojos asistentė – Vilija Vaicekavičienė, tel. 2657934, faks.2684819, vilija.vaicekaviciene@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 – 2007 metus.

II. GRYNŲJŲ AKTYVŲ, APSKAITOS VIENETŲ SKAIČIAUS IR VERTĖS POKYČIAI

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

	Ataskaitinio laikotarpio pradžioje	Ataskaitinio laikotarpio pabaigoje	Prieš metus (2006.12.31)	Prieš dvejus metus (2005.12.31)
Grynųjų aktyvų vertė, Lt	177,338,919.36	298,874,143.30	177,338,919.36	84,617,808.76
Apskaitos vieneto vertė, Lt	1.1566	1.1919	1.1566	1.1219
Apskaitos vienetų skaičius	153,332,790.005	250,760,477.531	153,332,790.005	75,425,240.574

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)	110,907,452.326	130,212,508.52
Vienetų skaičius (konvertuojant vienetus į pinigines lėšas)	13,479,764.800	15,815,032.49

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, Lt	Per ataskaitinį laikotarpį sumokėtų atskaitymų suma, Lt
Nuo įmokų	3%	3%	3,994,830.64	3,994,830.64
Nuo turto vertės	1%	1%	2,228,055.30	2,008,683.78
Keitimo mokesčiai:				
<i>fondo keitimas toje pačioje bendrovėje daugiau kaip kartą per metus</i>	0.20%	-	-	-
<i>pensijų kaupimo bendrovės keitimas kartą per metus</i>	0.20%	0.20%	3,435.07	3,435.07
<i>pensijų kaupimo bendrovės keitimas daugiau kaip kartą per metus</i>	0.20%	-	-	-
Iš viso			6,226,321.01	6,006,949.49
BAR (nurodomas tik Komisijai skirtame metų ataskaitos egzemplioriuje)				0.03
Sąlyginis BIK ir (arba) Tikėtinas sąlyginis BIK				0.03
PAR (portfelio apyvartumo rodiklis)				136.50

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

Atskaitymai	Mokesčio dydis		Per ataskaitinį laikotarpį priskaičiuotų mokesčių suma (Lt)	Per ataskaitinį laikotarpį sumokėtų mokesčių suma (Lt)	% nuo ataskaitinio laikotarpio vidutinės grynųjų aktyvų vertės
	maksimalus, nustatytas sudarymo dokumentuose	ataskaitiniu laikotarpiu taikytas			

1	Nuosavybės vertybiniai popieriai		ISIN kodas																	
1.1.	įtraukti į Oficialųjį prekybos sąrašą																			
	Erste Bank	Austrija	AT0000652011	EUR	2,724.00		9,405.43			474,574.34	456,163.22		www.wienerboerse.at		0%					0%
	NORMA AS	Estija	EE3100001850	EEK	9,247.00		2,040.54			171,092.94	159,631.09		www.omxgroup.com		0%					0%
	TALLINK GRUPP	Estija	EE3100004466	EEK	50,824.00		11,215.33			742,546.19	184,267.5		www.omxgroup.com		0%					0%
	OTP	Vengrija	HU0000061726	HUF	3,810.00		51.91			363,793.35	456,299.89		www.bet.hu		0%					0%
	SAF Tehnika	Latvija	LV0000101129	LVL	5,457.00		27,048.71			320,995.64	31,106.02		www.omxgroup.com		0%					0%
	PROKOM SOFTWARE	Lenkija	PLPROKM00013	PLN	3,230.00		3,091.53			410,102.37	410,246.02		www.gpw.com.pl		0%					0%
	Olympic Entertainment Group AS	Estija	EE3100084021	EEK	25,000.00		5,167.50			717,167.63	302,114.33		www.omxgroup.com		0%					0%
	Vneshtorgbank GDR	Rusija	US46630Q2021	USD	4,000.00		9,428.80			114,884.42	96,173.76		www.lse.co.uk		0%					0%
	EAST CAPITAL EXPLORER	Suomija	SE0002158568	SEK	8,546.00		3,113.91			318,124.85	311,390.60		www.eastcapital.ru		0%					0%
	Iš viso				112,838					3,633,281.73	2,407,392.84									
1.2.	įtraukti į Einamąjį prekybos sąrašą																			
	Iš viso				0						0.00									
1.3.	kuriais prekiaujama reguliuojamose rinkose, kurios specializuojasi mažų ir vidutinių įmonių srityje																			
	Iš viso				0						0.00									
1.4.	kuriais prekiaujama kitose reguliuojamose rinkose																			
	GAZPROM ADR	Rusija	US3682872078	USD	2,032.00		4,789.83			223,057.09	271,583.38		www.londonstockexchange.com		0%					0%
	LUKOIL HOLDING ADR	Rusija	US6778621044	USD	980.00		2,310.06			218,911.50	199,819.84		www.londonstockexchange.com		0%					0%
	Iš viso				3,012					441,968.59	471,403.22									
1.5.	išleidžiami nauji nuosavybės vertybiniai popieriai																			
	Iš viso				0					0.00	0.00									
	Iš viso nuosavybės vertybinių popierių					115,850				4,075,250.33	2,878,796.06									1%
2	Skolos vertybiniai popieriai		ISIN kodas																	
2.1.	įtraukti į Oficialųjį prekybos sąrašą																			
	Iš viso				0					0.00	0.00									
2.2.	įtraukti į Einamąjį prekybos sąrašą																			
	Lietuvos Vyriausybė	Lietuva	LT0000607046	LTL	13700		1,370,000.			860,884.40	1,436,082.38	5.10%							2010.02.11	0%
	Lietuvos Vyriausybė	Lietuva	LT0000610040	LTL	13900		1,390,000.			1,482,684.76	1,499,008.93	5.60%							2013.01.24	1%
	Iš viso				27600					2,343,569.16	2,935,091.31									
2.3.	kuriais prekiaujama kitose reguliuojamose rinkose																			
	Belgijos Vyriausybė	Belgija	BE0000301102	EUR	235,300,000		8,124,438.4			8,086,371.18	8,211,087.95	4.25%							2013.09.28	3%
	Belgijos Vyriausybė	Belgija	BE0000295049	EUR	139,000,000		4,799,392.			5,003,406.55	5,069,443.06	5.75%							2010.09.28	2%
	EIB	Turkija	XS0282939767	TRY	1,525		3,062,352.5			3,092,987.34	3,584,216.68	18.50%							2009.03.20	1%
	Graikijos Vyriausybė	Graikija	GR0124015497	EUR	1,970		6,802,016.			7,436,991.26	7,247,083.42	5.35%							2011.05.18	2%
	Ispanijos Vyriausybė	Ispanija	ES0000012932	EUR	1,492		5,151,577.6			5,149,820.58	4,924,304.82	4.20%							2037.01.31	2%
	Italijos Vyriausybė	Italija	IT0004220627	EUR	1,307		4,512,809.6			4,445,726.69	4,504,755.59	4.00%							2012.04.15	2%
	Italijos Vyriausybė	Italija	IT0004019581	EUR	3,160		10,910,848.			10,434,606.52	10,527,758.63	3.75%							2016.08.01	4%
	Italijos Vyriausybė	Italija	IT0001086567	EUR	177,100,000		6,114,908.8			8,473,740.81	7,997,081.07	7.25%							2026.11.01	3%
	Latvijos Vyriausybė	Latvija	LV0000580017	LVL	2,770		1,373,005.9			1,431,343.27	1,394,345.98	5.13%							2013.02.14	0%

	Latvijos Vyriausybė	Latvija	LV0000570059	LVL	1,500		743,505.			747,586.18	725,566.25	5.00%					2011.11.03	0%
	Lenkijos Vyriausybė	Lenkija	PL0000104287	PLN	1,300		1,244,269.			1,182,926.31	1,205,463.44	4.25%					2011.05.24	0%
	Lenkijos Vyriausybė	Lenkija	PL0000104709	EUR	4,167		14,387,817.6			3,581,018.49	3,629,807.08	0.00%					2009.07.25	1%
	Pan European Credit	Liuksemburgas	XS0203812994	EUR	26		897,728.			898,461.34	892,040.31	3.27%					2009.10.21	0%
	Pan European Credit	Liuksemburgas	XS0218046810	EUR	29		1,001,312.00			1,002,463.27	982,461.52	2.96%					2010.04.21	0%
	SEB Vihniaus Bankas	Lietuva	LT0000403057	LTL	3,259		325,900.00			330,116.12	333,472.21	3.10%					2008.02.20	0%
	Vengrijos Vyriausybė	Vengrija	HU0000402375	HUF	3,200		436,000.00			441,848.02	451,032.74	6.75%					2017.02.24	0%
	Vengrijos Vyriausybė	Vengrija	HU0000402359	HUF	14,000		1,907,500.00			1,896,148.64	1,924,173.43	6.50%					2009.08.12	1%
	Vengrijos Vyriausybė	Vengrija	HU0000402276	HUF	15,200		2,071,000.00			2,557,199.78	2,170,035.11	7.25%					2008.04.24	1%
	Vokietijos Vyriausybė	Vokietija	DE0001137180	EUR	294,000,000		10,151,232.00			10,356,402.08	10,460,195.59	4.50%					2009.06.12	3%
							845,454,905			76,549,164.41	76,234,324.88							
2.4.	išleidžiami nauji																	
	Iš viso				0					0.00	0.00							
	Iš viso skolos vertybinių popierių				845,482,505					78,892,733.57	79,169,416.19							26%
3	Kolektyvinio investavimo subjektų vienetai (akcijos)	ISIN kodas																
3.1.	Kolektyvinio investavimo subjektų, atitinkančių Kolektyvinio investavimo subjektų įstatymo 40 str. 1 d. reikalavimus, vienetai (akcijos)																	
	AIG GLOBAL EMERGING MARKETS FUND	Airija	IE0004897173	USD	4,644.087					5,987,500.65	5,830,153.67		www.aigig.com	iki 10%				2%
	AVIVA MORLEY EURO CONV EQ FUND I	Liuksemburgas	LU0160773130	EUR	3,754.628					5,766,175.91	5,788,798.01		www.avivafunds.com	iki 10%				2%
	BALZAC (I) EUROPE INDEX FUND	Prancūzija	FR0010204040	EUR	6,176.4986					4,237,041.40	4,125,342.91		www.statestreetfrance.com	iki 10%				1%
	BALZAC AUSTRALIA INDEX FUND	Prancūzija	FR0000018111	AUD	483.5960					317,308.14	357,750.38		www.statestreetfrance.com	iki 10%				0%
	BALZAC CANADA INDEX FUND	Prancūzija	FR0000018095	CAD	617.8028					375,583.91	411,071.18		www.statestreetfrance.com	iki 10%				0%
	BALZAC JAPAN INDEX FUND	Prancūzija	FR0000017931	JPY	7,758.8925					2,217,923.54	1,885,224.94		www.statestreetfrance.com	iki 10%				1%
	BALZAC USA INDEX FUND	Prancūzija	FR0000018285	USD	12,458.7644					6,525,089.71	6,100,279.30		www.statestreetfrance.com	iki 10%				2%
	BLUEBAY EMMK LOCAL CUR BD I EUR B	Liuksemburgas	LU0240777309	EUR	22,097.222					9,112,218.35	9,550,131.55		www.bluebayinvest.com	iki 10%				3%
	BlueBay Investment Grade Bond Fund	Liuksemburgas	LU0225310423	EUR	9,791.594					3,456,456.01	3,477,871.73		www.bluebayinvest.com	iki 10%				1%
	DANSKE CAPITAL-BALKAN FUND	Suomija	FI0008808043	EUR	13,050.571					1,381,120.00	1,320,693.19		www.danskecapital.fi	iki 10%				0%
	DWS INVEST-EUROPEAN EQ-S(FC)	Liuksemburgas	LU0145635479	EUR	2,610.000					1,474,583.34	1,556,429.36		www.dws-belgium.com	iki 10%				1%

	East Cap Lux Russia Fund C EUR	Rusija	LU0272829465	EUR	9,054,909	East Capital Asset Management					3,205,333.65	3,445,692.48	www.eastcapita.ru	iki 10%				1%
	Hansa Centrinės Azijos Akcijų Fondas	Estija	EE3600082335	EUR	37,812,026	AS Hansa Investee rimisfondid					1,397,163.25	1,333,708.75	www.hansa.ee	iki 10%				0%
	HANSA PRIVATE DEBT BOND FUND	Estija	EE3600090668	EUR	4,052,866	AS Hansa Investee rimisfondid					14,432,701.73	14,583,015.63	www.hansa.ee	iki 10%				5%
	Hansa Rytų Europos Akcijų Fondas	Estija	EE3600073326	EUR	42,006,550	AS Hansa Investee rimisfondid					4,086,116.67	3,771,988.73	www.hansa.ee	iki 10%				1%
	Hansa Rytų Europos Nėkilnojamo Turto Akcijų Fondas	Estija	EE3600082343	EUR	29,267,019	AS Hansa Investee rimisfondid					1,528,771.29	1,452,174.38	www.hansa.ee	iki 10%				0%
	Hansa Rytų Europos Obligacijų Fondas	Estija	EE3600077608	EUR	394,150,927	AS Hansa Investee rimisfondid					13,394,111.86	14,294,468.78	www.hansa.ee	iki 10%				5%
	Hansa Rusijos Akcijų Fondas	Estija	EE3600073318	EUR	33,389,744	AS Hansa Investee rimisfondid					2,898,936.97	3,163,517.21	www.hansa.ee	iki 10%				1%
	HSBC GIF EURO CORP BOND (IC) EUR	Liuksemburgas	LU0213954638	EUR	51,262,855	HSBC Investments Ltd.					1,845,052.02	1,787,703.90	www.hsbcinvestments.com.hk	iki 10%				1%
	J.Baer Global High Yield Bond FDC	Liuksemburgas	LU0159159432	EUR	11,910,362	Julius Baer					6,270,897.57	6,318,306.40	www.juliusbaer.com	iki 10%				2%
	J.BAER MULTIBD-ABSOL.RET.BD.FD-B	Liuksemburgas	LU0186678784	EUR	35,844,308	Julius Baer					13,811,199.73	14,258,761.34	www.juliusbaer.com	iki 10%				5%
	JP Morgan Emerging Markets Bond	Liuksemburgas	LU0087089594	USD	10,630.73	JP Morgan Assets Management					9,297,236.20	9,095,576.94	www.jpmorgan.com	iki 10%				3%
	LYXOR ETF EASTERN EUROPE	Prancūzija	FR0010204073	EUR	5,000.00	Lyxor Asset Management					478,896.45	486,154.24	www.lyxoretf.de	iki 10%				0%
	LYXOR ETF MSCI EMU GROWTH	Prancūzija	FR0010168765	EUR	6,800.00	Lyxor Asset Management					2,489,092.31	2,463,655.67	www.lyxoretf.de	iki 10%				1%
	PICTET EMRG LOCAL CUR DEBT 1 USD	Liuksemburgas	LU0255798018	USD	29,744,035.12	Pictet Funds					12,770,796.09	9,413,322.99	www.pictetfunds.com	iki 10%				3%
	PICTET FIXED INC EUR HIGH Y (I)	Liuksemburgas	LU0133806785	EUR	12,405,124.27	Pictet Funds					6,641,088.71	6,297,649.70	www.pictetfunds.com	iki 10%				2%
	Pimco Euro Bond Fund	Airija	IE0004931386	EUR	583,310,437	Pimco Europe Ltd.					29,393,513.79	29,445,473.53	http://europe.pimco.com	iki 10%				10%
	T.Rowe Price FDS-GL.EMMKTS BD	Liuksemburgas	LU0207127753	USD	262,828,230	T Rowe Price Global Investment Services					8,677,146.62	8,140,738.57	www.trowepriegllobal.com	iki 10%				3%
	T.Rowe Price Global Equity Fund 1	Liuksemburgas	LU0143563046	USD	122,935.58	T Rowe Price Global Investment Services					3,701,025.08	4,030,891.95	www.trowepriegllobal.com	iki 10%				1%
	T. ROWE PRICE-EUROPEAN CORP.BD	Liuksemburgas	LU0133091248	EUR	96,767.33	T Rowe Price Global Investment Services					4,143,386.23	4,096,289.59	www.trowepriegllobal.com	iki 10%				1%

-

15. Aprašyti šio priedo 12 punkte nurodytų išvestinių priemonių rūšis, su jomis susijusią 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.

Valiutos kurso rizikos valymo tikslais buvo sudaryti keli JAV dolerio bei Japonijos jenos apskaitimo sandoriai, t.y. atsižvelgiant į konkrečias išsilyjamas investicines priemones, kurios yra nominuotos JAV doleriais (Japonijos jenomis), buvo nupirkti JAV doleriai (Japonijos jenos) ir sudaryti išankstiniai sandoriai juos parduoti sutartu laiku už sutartą kainą. Tokiu būdu, jei apskaitimo sandorio pabaigoje mes parduotume išsilytą investicinę priemonę, gautus JAV dolerius (Japonijos jenas) galėtume panaudoti apskaitimo sandorio išsipareigojimų įvykdymui. Nepardavus investicinės priemonės, gali būti sudarytas naujas apskaitimo sandoris, pratęsiantis pirmąjį. Rizikos, susijusios su išvestinio sandorio sudarymu, yra kelios: 1) jei investicinės priemonės vertė JAV doleriais (Japonijos jenomis) sumažėtų, tai išsipareigojimų vykdymo momentu turėtume papildomai išsilyti JAV dolerių (Japonijos jenu) tuo metu esančia rinkos kaina; 2) jei apskaitimo sandorio kita šalis atsisako vykdyti prisiimtus išsipareigojimus (neatperka JAV dolerių (Japonijos jenu) sutarta kaina).

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

JAV dolerio ir lito apskaitimo bei Japonijos jenos ir euro sandoriai (rinkos vertė 2007.12.29) – (135,808) Lt

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 67% investicijų portfelio. Akcijos ir jų fondai sudarė apie 20 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 apskaitimo, išankstinio pirkimo (pardavimo) sandorius toms valiutoms, kurioms sudaryti tokius sandorius ekonomiškai apsimoka. Tokiu būdu iš dalies buvo apsidrausta nuo JAV 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. 2007 m. pirmoje pusėje Lietuvos ir kitose ES rinkose vyravo palūkanų kilimo tendencija, todėl investicijų portfelio vertė augo lėčiau (palūkanoms kylant, obligacijų kainos krenta). Daugiau vertės priaugio buvo gauta akcijų rinkoje. Antrąjį metų pusmetį situacija kardinaliai pasikeitė,

prasidėjus nekilnojamojo turto ir kredito rinkų krizei. Kadangi „Pensija 2“ fondo didžiąją dalį sudaro investicijos obligacijų rinkoje, kylanti jų vertė didesne dalimi kompensavo krentančias akcijų kainas. Pakilus terminuotųjų indėlių palūkanoms, dalis Fondo lėšų buvo nukreipta į trumpalaikius indėlius. Priimant investicinius sprendimus, taip pat atsižvelgiama į skirtingų geografinių regionų vystymosi perspektyvas. Todėl didelę įtaką portfelio vertės augimui turėjo sprendimas didesnę dėmesį skirti sparčiai augančioms besivystančių šalių akcijų bei obligacijų rinkoms. Valiutų kursų svyravimų įtaka portfelio vertės kitimui buvo palyginti nedidelė, nes portfelyje neapdraustų valiutinių pozicijų buvo tik nedidelė dalis.

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.

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 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, kurį portfelis buvo valdomas, metinė investicijų grąža. Prie palyginamosios lentelės pridodamas joje pateiktų rodiklių grafikas.

Kiekvienam fondo tipui pildoma lentelė:

Valstybinio socialinio draudimo įmokos dalies kaupimo pensijų fondas

	Per ataskaitinį laikotarpį	Prieš metus	Prieš 2 metus	Prieš 10 metų
Orientacinio indekso reikšmės pokytis	-	-	-	-
Apskaitos vieneto vertės pokytis*, %	3.09	3.06	7.28	-
Metinė grynoji investicijų grąža, %	3.03	3.09	2.96	-
Apskaitos vieneto vertės pokyčio standartinis nuokrypis, %	3.53	2.91	0.13	-
Grynosios investicijų grąžos standartinis nuokrypis, %	3.53	2.9	2.94	-

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

Papildomo savanoriško pensijų kaupimo fondas

	Per ataskaitinį laikotarpį	Prieš metus	Prieš 2 metus	Prieš 10 metų
Orientacinio indekso reikšmės pokytis	-	-	-	-
Metinė bendroji investicijų grąža	-	-	-	-
Metinė grynoji investicijų grąža	-	-	-	-
Bendrosios investicijų grąžos standartinis nuokrypis	-	-	-	-

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

22. Vidutinė investicijų grąža ir orientacinio indekso reikšmės pokytis per paskutinius trejus, penkerius, dešimt metų. Vidutinė investicijų grąža apskaičiuojama kaip geometrinis metinių investicijų grąžų vidurkis. Kiekvienam fondo tipui pildoma lentelė:

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 nekintamą 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;

(litais)

Eil. Nr.	Turtas	Pastabų Nr.	Ataskaitinis laikotarpis	Praėjęs ataskaitinis laikotarpis	Prieš dvejus metus
I.	PINIGAI IR PINIGŲ EKVIVALENTAI	2	39,155,854	9,028,471	343,462
II.	TERMINUOTI INDĖLIAI	2	0	0	0
III.	INVESTICIJOS	1	259,250,757	168,828,647	84,451,625
1.	Skolos vertybiniai popieriai	1	79,169,417	77,455,987	54,049,706
1.1.	Vyriausybės ir centrinių bankų arba jų garantuoti skolos vertybiniai popieriai	1	2,935,091	0	3,710,436
1.2.	Kiti skolos vertybiniai popieriai	1	76,234,326	77,455,987	50,339,270
2.	Nuosavybės vertybiniai popieriai	1	5,517,215	5,708,837	5,232,777
3.	Kolektyvinio investavimo subjektų investiciniai vienetai ir akcijos	1	174,564,125	85,663,823	25,169,142
4.	Kitos investicijos				
IV.	GAUTINOS SUMOS	2	686,904	0	0
1.	Investicijų pardavimo sandorių gautinos sumos				
2.	Kitos gautinos sumos	2	686,904	0	0
	TURTAS, IŠ VISO	2	299,093,515	177,857,118	84,795,087

Eil. Nr.	Įsipareigojimai ir gryniesi aktyvai	Pastabų Nr.	Ataskaitinis laikotarpis	Praėjęs ataskaitinis laikotarpis	Praėjęs ataskaitinis laikotarpis
V.	ĮSIPAREIGOJIMAI		219,372	517,341	175,834
1.	Investicijų pirkimo įsipareigojimai				
2.	Mokėtinos sumos kaupimo bendrovei ir depozitoriumui		219,372	381,533	172,255
3.	Kitos mokėtinos sumos ir įsipareigojimai			135,808	3,579
VI.	GRYNIJI AKTYVAI (I+II+III+IV-V)		298,874,143	177,339,777	84,619,253
	ĮSIPAREIGOJIMAI IR GRYNIJI AKTYVAI, IŠ VISO		299,093,515	177,857,118	84,795,087

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

(litas)

Eil. Nr.	Straipsniai	Pastabų Nr.	Ataskaitinis laikotarpis	Praėjęs ataskaitinis laikotarpis	Prieš dvejus metus
I.	GRYNEJI AKTYVAI ATASKAITINIO LAIKOTARPIO PRADŽIOJE		177,339,777	84,619,253	18,810,597
II.	PADIDĖJIMAS, IŠ VISO		166,187,251	111,124,133	69,917,109
1.	Pensijų įmokos		133,155,548	92,725,071	57,140,490
2.1.	Iš kitų pensijų fondų pervestos sumos		1,018,200	417,847	48,087
2.2.	Iš fondų sujungimo gautos sumos		0	0	7,939,042
3.	Kaupimo bendrovės garantinės įmokos		0	0	
4.	Palūkanos ir dividendai		4,850,868	2,570,889	1,256,667
5.	Investicijų pardavimo pelnas		8,423,940	3,134,834	579,000
6.	Investicijų vertės padidėjimo suma		13,794,045	10,824,983	2,924,017
7.	Turto vertės padidėjimas dėl užsienio valiutų kursų pasikeitimo		4,820,925	1,356,495	17,652
8.	Kitos pajamos		123,725	94,014	12,154
III.	SUMAŽĖJIMAS, IŠ VISO		44,652,885	18,403,609	4,108,453
1.	Pensijų išmokos		341,571	104,416	29,415
2.	Iš kitų pensijų fondus pervestos sumos		15,436,960	3,796,909	478,430
3.	Investicijų pardavimo nuostoliai		2,757,892	2,528,552	55,853
4.	Investicijų vertės sumažėjimo suma		18,619,743	7,554,542	1,079,758
5.	Turto vertės sumažėjimas dėl užsienio valiutų kursų pasikeitimo		1,270,399	481,784	278,083
6.	Valdymo sąnaudos		6,226,320	3,937,406	2,186,914
7.	Kitos sąnaudos				
IV.	GRYNEJI AKTYVAI ATASKAITINIO LAIKOTARPIO PABAIGOJE		298,874,143	177,339,777	84,619,253
V.	APSKAITOS VIENETO VERTĖ		1.1919	1.1566	1.1219
VI.	APSKAITOS VIENETŲ SKAIČIUS		250760477.531	153332790.005	75425240.574

24.3. aiškinamąjį raštą (pateikiamas tik metų ir pusmečio ataskaitose).

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 Tuskulėnų g. 39, Vilnius.

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

Audito įmonė – UAB “Deloitte & Touche”, adresas Jogailos g. 4, 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 turta, 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 turta, 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, 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 turtą norimu laiku ir už norimą kainą arba eliminuoja galimybę parduoti norimą turtą. 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 atsiskaitymus: sumokant turto valdymo ir įmokos mokestį, 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 išreiškia 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 vertę 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	isigyta	parduota (išpirkta)	vertės padidėjimas	vertės sumažėjimas	ataskaitinio laikotarpio pabaigoje
Skolos vertybiniai popieriai	77,455,987	104,112,599	105,452,396	7,580,789	4,527,562	79,169,417
<i>Vyriausybių ir centrinių bankų arba jų garantuoti skolos vertybiniai popieriai</i>	0	3,307,673	419,987	107,114	59,709	2,935,091
<i>Kiti skolos vertybiniai popieriai</i>	77,455,987	100,804,926	105,032,409	7,473,675	4,467,853	76,234,326
Nuosavybės vertybiniai popieriai	5,708,837	3,363,411	2,953,127	1,328,997	1,930,903	5,517,215
Kolektyvinio investavimo subjektų investiciniai vienetai ir akcijos	85,663,823	161,634,381	74,830,583	17,015,674	14,919,170	174,564,125
Kitos investicijos						
Iš viso	168,828,647	269,110,391	183,236,106	25,925,460	21,377,635	259,250,757

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,	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
Lėšos a/s		LTL				30	0.00%
Lėšos a/s		USD				731	0.00%
Terminuotas indėlis		LTL		6.75%	2008.01.07	10,039,375	3.36%
Terminuotas indėlis		EUR		3.94%	2008.01.01	19,264,574	6.44%
Terminuotas indėlis		LTL		3.94%	2008.01.01	9,851,144	3.29%
SW(JPY)		JPY				14,347	0.00%
SW(USD)		USD				672,557	0.22%
Belgijos Vyriausybė	Belgija	EUR	4,799,392	5.75%	2010.09.28	5,069,443	1.69%
Belgijos Vyriausybė	Belgija	EUR	8,124,438	4.25%	2013.09.28	8,211,088	2.75%
Vokietijos Vyriausybė	Vokietija	EUR	10,151,232	4.50%	2009.06.12	10,460,196	3.50%
Ispanijos Vyriausybė	Ispanija	EUR	5,151,578	4.20%	2037.01.31	4,924,305	1.65%
Graikijos Vyriausybė	Graikija	EUR	6,802,016	5.35%	2011.05.18	7,247,083	2.42%
Vengrijos Vyriausybė	Vengrija	HUF	2,064,616	7.25%	2008.04.24	2,170,035	0.73%
Vengrijos Vyriausybė	Vengrija	HUF	1,901,620	6.50%	2009.08.12	1,924,174	0.64%
Vengrijos Vyriausybė	Vengrija	HUF	434,656	6.75%	2017.02.24	451,033	0.15%
Italijos Vyriausybė	Italija	EUR	6,114,909	7.25%	2026.11.01	7,997,081	2.67%
Italijos Vyriausybė	Italija	EUR	10,910,848	3.75%	2016.08.01	10,527,759	3.52%
Italijos Vyriausybė	Italija	EUR	4,512,810	4.00%	2012.04.15	4,504,756	1.51%
SEB Vilniaus bankas	Lietuva	LTL	325,900	3.10%	2008.02.20	333,472	0.11%
Lietuvos Vyriausybės VP	Lietuva	LTL	1,370,000	5.10%	2010.02.11	1,436,082	0.48%
Lietuvos Vyriausybės VP	Lietuva	LTL	1,390,000	5.60%	2013.01.24	1,499,009	0.50%
Latvijos Vyriausybė	Latvija	LVL	741,330	5.00%	2011.11.03	725,566	0.24%
Lenkijos Vyriausybė	Lenkija	PLN	1,231,828	4.25%	2011.05.24	1,205,463	0.40%
Lenkijos Vyriausybė	Lenkija	PLN	3,948,483	0.00%	2009.07.25	3,629,807	1.21%
PAN EUROPEAN CREDIT S.A	Liuksemburgas	EUR	897,728	0.00%	2009.10.28	892,040	0.30%
PAN EUROPEAN CREDIT S.A	Liuksemburgas	EUR	1,001,312	0.00%	2010.04.21	982,462	0.33%
EUROPEAN INVESTMENT BANK	Didžioji Britanija	TRY	2,992,812	18.50%	2009.03.20	3,584,217	1.20%
Latvijos Vyriausybė	Latvija	LVL	1,368,989	5.13%	2013.02.14	1,394,346	0.47%
ERSTE BANK	Austrija	EUR				456,163	0.15%
NORMA AS	Estija	EEK				159,631	0.05%
TALLINK GRUPP AS	Estija	EEK				184,268	0.06%
OLYMPIC ENTERTAINMENT GROUP AS	Estija	EEK				302,114	0.10%
OJPEŠ KERESKEDELM BANK NYRT	Vengrija	HUF				456,300	0.15%
SAF TEHNKA AS	Latvija	LVL				31,106	0.01%
PROKOM SOFTWARE SA	Lenkija	PLN				410,246	0.14%
EAST CAPITAL EXPLORER AB	Švedija	SEK				311,391	0.10%
GAZPROM	Rusija	USD				271,583	0.09%
VNESHTORG BANK	Rusija	USD				96,174	0.03%

LUKOIL HOLDING	Rusija	USD				199,820	0.07%
HANSA INVESTIERIMISFONDID	Estija	EUR				3,163,517	1.06%
HANSA INVESTIERIMISFONDID	Estija	EUR				3,771,988	1.26%
HANSA INVESTIERIMISFONDID	Estija	EUR				14,294,469	4.78%
HANSA INVESTIERIMISFONDID	Estija	EUR				1,333,709	0.45%
HANSA INVESTIERIMISFONDID	Estija	EUR				1,452,174	0.49%
HANSA INVESTIERIMISFONDID	Estija	EUR				4,915,163	1.64%
DANSKE CAPITAL	Suomija	EUR				1,320,693	0.44%
STATE STREET GLOBAL ADVISORS	Prancūzija	JPY				1,885,224	0.63%
STATE STREET GLOBAL ADVISORS	Prancūzija	CAD				411,069	0.14%
STATE STREET GLOBAL ADVISORS	Prancūzija	AUD				357,753	0.12%
STATE STREET GLOBAL ADVISORS	Prancūzija	USD				6,100,277	2.04%
LYXOR ASSET MANAGEMENT	Prancūzija	EUR				2,463,656	0.82%
STATE STREET GLOBAL ADVISORS	Prancūzija	EUR				4,125,344	1.38%
LYXOR ASSET MANAGEMENT	Prancūzija	EUR				486,154	0.16%
AIG GLOBAL FUNDS	Airija	USD				5,830,157	1.95%
PIMCO FUNDS GLOBAL INVESTORS	Didžioji Britanija	EUR				29,445,474	9.84%
JP MORGAN FLEMING ASSET MANAGE	Liuksemburgas	USD				9,095,577	3.04%
T-ROWE PRICE GLBL EMERG INV SE	Liuksemburgas	USD				5,970,128	2.00%
T-ROWE PRICE GLBL EMERG INV SE	Liuksemburgas	EUR				4,096,290	1.37%
PICTET FUNDS SA	Liuksemburgas	EUR				6,297,648	2.11%
T-ROWE PRICE GLBL EMERG INV SE	Liuksemburgas	USD				4,030,892	1.35%
DWS INVESTMENT GMBH	Liuksemburgas	EUR				1,556,429	0.52%
JULIUS BAER INVESTMENT FUNDS	Liuksemburgas	EUR				6,318,305	2.11%
AVIVA MORLEY FM	Liuksemburgas	EUR				5,788,801	1.94%
T-ROWE PRICE GLBL EMERG INV SE	Liuksemburgas	USD				2,617,429	0.88%
JULIUS BAER INVESTMENT FUNDS	Liuksemburgas	EUR				14,258,762	4.77%
T-ROWE PRICE GLBL EMERG INV SE	Liuksemburgas	USD				8,140,739	2.72%
HSBC GLOBAL INVESTMENT FUNDS	Liuksemburgas	EUR				1,787,704	0.60%
BLUBAY ASSET MANAGEMENT	Liuksemburgas	EUR				3,477,870	1.16%
BLUBAY ASSET MANAGEMENT	Liuksemburgas	EUR				9,550,131	3.19%
PICTET FUNDS SA	Liuksemburgas	USD				9,413,325	3.15%
EAST CAPITAL ASSET MANAGEMENT	Švedija	EUR				3,445,693	1.15%
Iš viso	X	X	X	X	X	299,093,515	100%

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		144,388
Dalyvių skaičius ataskaitinio laikotarpio pabaigoje	dalyviai, pasinaudoję teise nukelti pensijų išmokos mokėjimą	13
	dalyviai, gaunantys periodines pensijų išmokas	-
	kiti dalyviai	-
	Iš viso	139,873
Dalyvių skaičiaus pokytis		-4,515

26. Per ataskaitinį laikotarpį prisijungusių dalyvių skaičius:

Bendras prisijungusių dalyvių skaičius		1,973
Dalyviai, pensijų kaupimo sutartis sudarę pirmą kartą		1,623
Iš kitų pensijų fondų atėję	iš tos pačios pensijų kaupimo bendrovės	319

dalyviai	iš kitos pensijų kaupimo bendrovės	31
----------	------------------------------------	----

27. Per ataskaitinį laikotarpį pasitraukusių dalyvių skaičius:

Bendras pasitraukusių dalyvių skaičius		6,488
Į kitus pensijų fondus išėjusių dalyvių skaičius	valdomus tos pačios pensijų kaupimo bendrovės	5,562
	valdomus kitos pensijų kaupimo bendrovės	646
Baigusių dalyvavimą dalyvių skaičius	išstojusių (pildoma tik papildomo savanoriško pensijų kaupimo pensijų fondo atveju)	-
	sulaukusių nustatyto pensijos amžiaus ir pasinaudojusių teise į pensijų išmoką (vienkartinę išmoką, anuitetą ir jų derinį)	24
	dalyvių, pasinaudojusių Pensijų kaupimo įstatymo suteikta galimybe vienašališkai nutraukti pirmą kartą sudarytą sutartį	119
	mirusių dalyvių	137

28. Pensijų fondo dalyvių struktūra:

28.1. pagal amžių ir lytį ataskaitinio laikotarpio pabaigoje

		Dalyviai pagal amžių				
		iki 30	nuo 30 iki 45	nuo 45 iki 60	nuo 60	iš viso
Dalyvių skaičius	iš viso	6,816	88,474	44,499	84	139,873
	vyrų	3,543	39,308	20,757	74	63,682
	moterų	3,273	49,166	23,742	10	76,191
Dalyvių dalis, %	iš viso	5%	63%	32%	0%	100%
	vyrų	2.53%	28.10%	14.84%	0.05%	45.53%
	moterų	2.34%	35.15%	16.97%	0.01%	54.47%

28.2. pagal įmokas mokančių dalyvių buvimo (*residence*) vietą (tik papildomo savanoriško pensijų kaupimo pensijų fondui):

Valstybė	Dalyvių skaičius	Gautų įmokų suma
Lietuva		
Kitos Europos Sąjungos valstybės		
Kitos Europos ekonominės erdvės valstybės (Islandija, Lichtenšteinas, Norvegija)		
Jungtinės Amerikos Valstijos ir Kanada		
Japonija		
Kitos valstybės		
Iš viso		

VIII. IŠORINIAI PINIGŲ SRAUTAI

29. Per ataskaitinį laikotarpį faktiškai gautos lėšos:

Bendra gautų lėšų suma		134,173,748.03
Periodinės įmokos į pensijų fondą	iš Valstybinio socialinio draudimo fondo	133,155,548.18
	pačio dalyvio įmokėtos lėšos (pildoma tik papildomo savanoriško pensijų kaupimo pensijų fondo atveju)	-

XI. KITI REIKALAVIMAI

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 (finansų maklerio įmonės, 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"
Ekonomistas _____ T.Kivaras

UAB "Hansa investicijų valdymas"
Fondo valdytojos asistentė _____ V.Vaicekavičienė