

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 I PUSMEČIO ATASKAITA

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

2.3. tel.: (8-5) 265-79-30, faks.: (8-5) 268-48-19, [aurimas.mazdzierius@hansa.lt](mailto: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. 2657930, faks.2684819, [aurimas.mazdzierius@hansa.lt](mailto:aurimas.mazdzierius@hansa.lt);

- valdybos narė ir valdymo įmonės vyriausioji finansininkė Aurelija Žeknienė, tel. 2657931, faks. 2684819, [aurelija.zekniene@hansa.lt](mailto:aurelija.zekniene@hansa.lt);

- valdymo įmonės fondo valdytojos asistentė – Vilija Vaicekavičienė, tel. 2657934, faks. 2684819, [vilija.vaicekaviciene@hansa.lt](mailto:vilija.vaicekaviciene@hansa.lt)

- valdymo įmonės ekonomistas – Tomas Kivaras, tel.2657939, faks.2684819, [tomas.kivaras@hansa.lt](mailto: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 - 2007 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 (2006-12-31)	Ataskaitinio laikotarpio pabaigoje (2007-06-30)	Prieš metus (2006-06-30)	Prieš dvejus metus (2005-06-30)
<b>GAV</b>	177,339,777.95	229,354,335.28	117,064,928.69	52,022,978.01
<b>Apskaitos vieneto vertė (Lt)</b>	1.1566	1.1746	1.0689	1.0946
<b>Apskaitos vienetų skaičius</b>	153,332,790.01	195,255,132.11	109,516,836.77	47,526,115.95

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

	Apskaitos vienetų skaičius	Vertė (Lt)
<b>Vienetų skaičius (konvertuojant pinigines lėšas į apskaitos vienetus)</b>	51,509,854.61	60,030,660.63
<b>Vienetų skaičius (konvertuojant vienetus į pinigines lėšas)</b>	9,587,512.511	11,209,480.79

## 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
<b>Nuo įmokų</b>	3%	3%	1,833,107.81	1,833,107.81
<b>Nuo turto vertės</b>	1%	1%	946,357.77	452,005.61
<b>Keitimo mokesčiai:</b>				
<i>Fondo keitimas toje pačioje bendrovėje daugiau kaip kartą per metus</i>	0.2%	0.2%	2,178.86	2,178.86
<i>Pensijų kaupimo bendrovės keitimas kartą per metus</i>	0.2%	-	0.00	0.00

<i>Pensijų kaupimo bendrovės keitimas daugiau kaip kartą per metus</i>	0.2%	-	0.00	0.00
<b>Iš viso:</b>			<b>2,781,644.44</b>	<b>2,287,292.28</b>
<b>BIK (bendrasis išlaidų koeficientas):</b>				
<b>PAR (portfelio apyvartumo rodiklis):</b>				

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

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

\*Bendrasis išlaidų koeficientas (BIK) – procentinis dydis, kuris parodo, kokia vidutinė fondo grynujų 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	Bendra rinkos vertė	Rinka, pagal kurios duomenis nustatyta rinkos vertė (tinklalo adresas)	Balsų dalis emitente, %	Dalis GA, %
Nuosavybės vertybiniai popieriai, įtraukti į Oficialųjį ar jį atitinkantį prekybos sąrašą									
Erste Bank	Austrija	AT0000652011	2724	9405.4272	474,574.34	543633.69	http://www.wienerboers.e.at	0%	0%
NORMA AS	Estija	EE3100001850	9247	20405.355	171092.9361	150387.47	www.omxgroup.com	0	0%
TALLINK GRUPP	Estija	EE3100004466	50824	112153.32	742546.191	252681.43	www.omxgroup.com	0	0%
OTP	Vengrija	HU0000061726	3810	5326.38	363,793.35	564596.28	www.bet.hu	0%	0%
SNAIGE	Lietuva	LT0000109274	22130	22130	190,318.00	226832.5	www.lt.omxgroup.com	0%	0%
SAF Tehnika	Latvija	LV0000101129	5457	5457	320,995.64	161037.24	www.omxgroup.com	0%	0%
PROKOM SOFTWARE	Lenkija	PLPROKM00013	3230	2952.5753	410,102.37	442886.3	www.gpw.com.pl	0%	0%
Olympic Entertainment Group AS	Estija	EE3100084021	25000	51675	717,167.63	517910.28	www.omxgroup.com	0%	0%
Vneshtorgbank GDR	Rusija	US46630Q2021	4000	10256.8	114,884.42	112619.66	www.lse.co.uk	0%	0%
Iš viso					3,505,474.88	2972584.85			1%
Nuosavybės vertybiniai popieriai, įtraukti į Einamąjį ar jį atitinkantį prekybos sąrašą									
Iš viso									
Nuosavybės vertybiniai popieriai, kuriais prekiaujama reguliuojamose rinkose, kurios specializuojasi mažų ir vidutinių įmonių srityje									
Iš viso									
Nuosavybės vertybiniai popieriai, kuriais prekiaujama kitose reguliuojamose rinkose									
GAZPROM ADR	Rusija	US3682872078	2032	5210.4544	223,057.09	218318.04	www.londonstockexchange.com	0%	0%
LUKOIL HOLDING ADR	Rusija	US6778621044	980	2512.916	218,911.50	191484.2	www.londonstockexchange.com	0%	0%
Iš viso					441968.59	409802.24			0%
Išleidžiami nauji nuosavybės vertybiniai popieriai									
Iš viso									
Iš viso nuosavybės vertybinių popierių						<b>3382387.09</b>			<b>1%</b>
Emitento pavadinimas	Šalis	ISIN kodas	Kiekis, vnt.	Bendra nominali vertė	Bendra įsigijimo vertė	Bendra rinkos vertė	Palūkanų norma	Išpirkimo / konvertavimo data	Dalis GA, %
Skolos vertybiniai popieriai, įtraukti į Oficialųjį ar jį atitinkantį prekybos sąrašą									
Iš viso									
Skolos vertybiniai popieriai, įtraukti į Einamąjį ar jį atitinkantį prekybos sąrašą									

Lietuvos Vyriausybė	Lietuva	LT0000607046	13700	1370000	851,109.45	1410177.93	5.10%	2010.02.11	1%
Lietuvos Vyriausybė	Lietuva	LT0000610040	13900	1390000	1,482,684.76	1476355.69	5.60%	2013.01.24	1%
Iš viso						2886533.62			1%
Skolos vertybiniai popieriai, kuriais prekiaujama kitose reguliuojamose rinkose									
Austrijos Vyriausybė	Austrija	AT0000385356	2034	7022995.2	7,635,311.96	7490082.12	5.00%	2012.07.15	3%
Čekijos Vyriausybė	Čekija	CZ0001000764	1079	13027846	1,586,617.56	1486911.49	6.55%	2011.10.05	1%
EIB	Turkija	XS0282939767	2035	3941184.5	3,977,609.90	4184363.14	18.50%	2009.03.20	2%
Graikijos Vyriausybė	Graikija	GR0124015497	2893	9988950.4	10,925,424.93	10303495.89	5.35%	2011.05.18	4%
Ispanijos Vyriausybė	Ispanija	ES0000012932	2038	7036806.4	7,105,310.32	6519919.27	4.20%	2037.01.31	3%
Italijos Vyriausybė	Italija	IT0004086226	1500	5179200	5,161,435.34	5171741.95	0.00%	2007.07.16	2%
Italijos Vyriausybė	Italija	IT0003844534	2140	7388992	7,342,514.64	7045267.09	3.75%	2015.08.01	3%
Italijos Vyriausybė	Italija	IT0001086567	87100000	3007388.8	4,304,151.58	3906218.03	7.25%	2026.11.01	2%
Latvijos Vyriausybė	Latvija	LV0000580017	2770	1373836.9	1,431,343.27	1391322.74	5.13%	2013.02.14	1%
Latvijos Vyriausybė	Latvija	LV0000570059	1500	743955	747,586.18	768007.59	5.00%	2011.11.03	0%
Lenkijos Vyriausybė	Lenkija	PL0000103735	4312	3941642.32	4,037,083.81	4046644.01	5.75%	2010.03.24	2%
Lenkijos Vyriausybė	Lenkija	PL0000104543	2150	7423520	2,011,685.48	1977870.23	5.25%	2017.10.25	1%
Lenkijos Vyriausybė	Lenkija	PL0000101937	2618	9039430.4	2,525,149.31	2521463.1	6.00%	2010.11.24	1%
Pan European Credit	Liuksemburgas	XS0203812994	26	897728	898,461.34	887032.89	3.27%	2009.10.21	0%
Pan European Credit	Liuksemburgas	XS0218046810	29	1001312	1,002,463.27	974412.69	2.96%	2010.04.21	0%
SEB Vilniaus Bankas	Lietuva	LT0000403057	3259	325900	330,116.12	325920.91	3.10%	2008.02.20	0%
Suomijos Vyriausybė	Suomija	FI0001006066	1207	4167529.6	4,218,866.62	4047793.03	3.88%	2017.09.15	2%
Vengrijos Vyriausybė	Vengrija	HU0000402359	20	2796	290,464.21	295405.25	6.50%	2009.08.12	0%
Vengrijos Vyriausybė	Vengrija	HU0000402318	17400	2432520	2,169,778.06	2299750.23	5.50%	2016.02.12	1%
Vengrijos Vyriausybė	Vengrija	HU0000402276	15200	2124960	2,557,199.78	2153272.48	7.25%	2008.04.24	1%
Vokietijos Vyriausybė	Vokietija	DE0001141455	114200000	3943097.6	3,952,854.45	3960522.85	3.50%	2009.10.09	2%
Vokietijos Vyriausybė	Vokietija	DE0001137149	267900000	9250051.2	9,540,877.88	9166530.3	3.25%	2008.06.13	4%
Iš viso					83,752,306.02	80,923,947.28			35%
Išleidžiami nauji skolos vertybiniai popieriai									
Iš viso									
Iš viso skolos vertybinių popierių						<b>83,810,480.90</b>			<b>36%</b>
KIS pavadinimas	Šalis	ISIN kodas	Kiekis, vnt.	Valdy-tojas	Bendra įsigijimo vertė	Bendra rinkos vertė	Rinkos vertės nustatymo šaltinis (tinklalapio adresas)	KIS aktyvų dalis, investuota į kitus KIS, %	Dalis GA, %
Kolektyvinio investavimo subjektų, atitinkančių Kolektyvinio investavimo subjektų įstatymo 40 str. 1 d. reikalavimus, vienetai (akcijos)									

Hansa Rusijos Akciju Fondas	Estija	EE3600073318	45,214.63	AS Hansa Investeerimisfondid	3,664,701.65	3,957,567.49	www.hansa.ee	iki 10%	2%
Hansa Rytu Europos Akciju Fondas	Estija	EE3600073326	21,993.93	AS Hansa Investeerimisfondid	3,421,294.35	2,281,257.60	www.hansa.ee	iki 10%	1%
Hansa Rytu Europos Obligaciju Fondas	Estija	EE3600077608	488,399.52	AS Hansa Investeerimisfondid	16,043,107.27	16,897,185.58	www.hansa.ee	iki 10%	7%
Hansa Rytu Europos Nekilnojamo Turto Akciju Fondas	Estija	EE3600082343	35,956.37	AS Hansa Investeerimisfondid	1,616,594.12	2,175,607.43	www.hansa.ee	iki 10%	1%
Hansa Centrinės Azijos Akciju Fondas	Estija	EE3600082335	27,948.21	AS Hansa Investeerimisfondid	1,048,276.12	1,091,516.47	www.hansa.ee	iki 10%	0%
BALZAC JAPAN INDEX FUND	Prancūzija	FR0000017931	8,167.66	State Street Global Advisors France S.A.	2,397,758.68	2,330,996.02	www.statestreetfrance.com	iki 10%	1%
BALZAC CANADA INDEX FUND	Prancūzija	FR0000018095	823.83	State Street Global Advisors France S.A.	445,978.86	533,310.47	www.statestreetfrance.com	iki 10%	0%
BALZAC AUSTRALIA INDEX FUND	Prancūzija	FR0000018111	713.596	State Street Global Advisors France S.A.	441,922.87	534,912.22	www.statestreetfrance.com	iki 10%	0%
BALZAC USA INDEX FUND	Prancūzija	FR0000018285	15895.3119	State Street Global Advisors France S.A.	8,207,486.26	8,560,154.52	www.statestreetfrance.com	iki 10%	4%
BALZAC (I) EUROPE INDEX FUND	Prancūzija	FR0010204040	11,286.50	State Street Global Advisors France S.A.	7,242,414.50	8,033,670.11	www.statestreetfrance.com	iki 10%	3%
T.ROWE PRICE-GLOBAL EMERG.MEQ	Liuksemburgas	LU0133084979	57,857.17	T Rowe Price Global Investment Services	3,685,155.83	4,277,142.55	www.trowepriceglobal.com	iki 10%	2%
T.ROWE PRICE-EUROPEAN CORP.BD	Liuksemburgas	LU0133091248	136,267.33	T Rowe Price Global Investment Services	5,844,302.41	5,796,607.27	www.trowepriceglobal.com	iki 10%	3%
T.Rowe Price FDS-GL.EM.MKTS BD	Liuksemburgas	LU0207127753	285,828.23	T Rowe Price Global Investment Services	9,442,818.93	9,366,727.15	www.trowepriceglobal.com	iki 10%	4%
T.Rowe Price Global Equity Fund I	Liuksemburgas	LU0143563046	140,629.39	T Rowe Price Global Investment Services	4,096,105.42	4,655,370.29	www.trowepriceglobal.com	iki 10%	2%
ABN AMRO FD-GL.EM.MARKETS BD FD	Liuksemburgas	LU0191340248	37,636.54	ABN AMRO Investment Funds SA	11,234,856.81	10,979,597.61	www.asset.abnamro.com	iki 10%	5%
J.Baer Global High Yield Bond FD C	Liuksemburgas	LU0159159432	14,486.36	Julius Baer	7,580,765.34	7,718,856.57	www.juliusbaer.com	iki 10%	3%
Pimco Euro Bond Fund	Airija	IE0004931386	159,270.24	Pimco Europe Ltd.	8,056,245.64	7,808,981.74	http://europe.pimco.com	iki 10%	3%

BlueBay Investment Grade Bond Fund	Liuksemburgas	LU0225310423	5,213.02	BlueBay Assets Management	1,833,640.04	1,811,290.55	www.bluebayinvest.com	iki 10%	1%
DWS INVEST-EUROPEAN EQ-S(FC)	Liuksemburgas	LU0145635479	3,310.00	DWS Investments	1,852,067.78	1,995,348.61	www.dws-belgium.com	iki 10%	1%
HSBC GIF EURO CORP BOND (IC) EUR	Liuksemburgas	LU0213954638	52,762.86	HSBC Investments Ltd.	1,899,040.00	1,879,000.25	www.hsbcinvestments.com.hk	iki 10%	1%
PICTET FIXED INC EUR HIGH Y (I)	Liuksemburgas	LU0133806785	16,226.12	Pictet Funds	8,667,028.64	8,662,112.12	www.pictetfunds.com	iki 10%	4%
BLUEBAY EM.MK LOCAL CUR BD I EUR B	Liuksemburgas	LU0240777309	16,752.19	BlueBay Assets Management	6,919,411.28	6,852,536.79	www.bluebayinvest.com	iki 10%	3%
J.BAER MULTIBD-ABSOL.RET.BD.FD-B	Liuksemburgas	LU0186678784	20,729.17	Julius Baer	7,941,440.05	7,952,550.23	www.juliusbaer.com	iki 10%	3%
AVIVA MORLEY EURO CONV EQ FUND I	Liuksemburgas	LU0160773130	1,308.92	Aviva Funds	2,071,680.60	0.00	www.avivafunds.com	iki 10%	0%
HANSA PRIVATE DEBT BOND FUND	Estija	EE3600090668	630.00	AS Hansa Investeerimisfondid	2,175,264.00	0.00	www.hansa.ee	iki 10%	0%
PICTET EMRG LOCAL CUR DEBT I USD	Liuksemburgas	LU0255798018	10,467.83	Pictet Funds	4,488,640.00	0.00	www.pictetfunds.com	iki 10%	0%
Iš viso					132,317,997.46	126,152,299.64			55%
Kitų kolektyvinio investavimo subjektų vienetai (akcijos)									
Iš viso									
Iš viso KIS vienetų (akcijų)						<b>126,152,299.64</b>			<b>55%</b>
Emitento pavadinimas	Šalis	Priemonės pavadinimas		Kiekis, vnt.	Valiuta	Bendra rinkos vertė	Palūkanų norma	Galiojimo pabaigos data	Dalis GA, %
P pinigų rinkos priemonės, kuriomis prekiaujama reguliuojamose rinkose									
Iš viso									
Kitos pinigų rinkos priemonės									
Iš viso									
Iš viso pinigų rinkos priemonių									
Kredito įstaigos pavadinimas			Šalis		Valiuta	Bendra rinkos vertė	Palūkanų norma	Indėlio termino pabaiga	Dalis GA, %
AB Hansabankas			Lietuva		EUR	2069523.001	3.884%	2007.07.01	1%
AB Hansabankas			Lietuva		LTL	12047001.24	3.884%	2007.07.01	5%
Iš viso indėlių kredito įstaigose						14116524.24			6%

Priemonės pavadinimas	Emitentas	Šalis	Kita sandorio šalis	Va-liu-ta	Investicinis sandoris (pozicija)	Sandorio (pozicijos) vertė	Bendra rinkos vertė	Rinkos pavadinimas (tinklalapio adresas)	Galioji-mo terminas	Dalis GA, %
Išvestinės investicinės priemonės, kuriomis prekiaujama reguliuojamose rinkose										
Iš viso										
Kitos išvestinės investicinės priemonės										
AB Hansa bankas	EUR/JPY valiutos apskaitimo sandoris (SWAP)	Lietuva	AB Hansa bankas	EUR	6501906.669	6505925.509	-4018.84		2007.09.20	0%
AB Hansa bankas	LTL/USD valiutos apskaitimo sandoris (SWAP)	Lietuva	AB Hansa bankas	EUR	5418967.105	5403496.243	15470.86		2007.09.20	0%
AB Hansa bankas	LTL/USD valiutos apskaitimo sandoris (SWAP)	Lietuva	AB Hansa bankas	USD	6097288.763	6078933.273	18355.49		2007.09.20	0%
AB Hansa bankas	LTL/USD valiutos apskaitimo sandoris (SWAP)	Lietuva	AB Hansa bankas	USD	12190774.45	12157866.55	32907.9		2007.09.20	0%
AB Hansa bankas	LTL/USD valiutos apskaitimo sandoris (SWAP)	Lietuva	AB Hansa bankas	USD	11511713.3	11482429.52	29283.78		2007.09.20	0%
AB Hansa bankas	LTL/USD valiutos apskaitimo sandoris (SWAP)	Lietuva	AB Hansa bankas	USD	284473.5884	283683.5528	790.04		2007.09.20	0%
AB Hansa bankas	LTL/USD valiutos apskaitimo sandoris (SWAP)	Lietuva	AB Hansa bankas	USD	260787.7919	260043.2567	744.54		2007.09.20	0%
AB Hansa bankas	LTL/USD valiutos apskaitimo sandoris (SWAP)	Lietuva	AB Hansa bankas	USD	152402.5075	151973.3318	429.18		2007.09.20	0%
Iš viso						42324351.2	93962.94			0%
Iš viso išvestinių investicinių priemonių							<b>93962.94</b>			<b>0%</b>
Banko pavadinimas				Valiuta	Bendra rinkos vertė		Palūkanų norma		Dalis GA, %	
Pinigai										
Iš viso pinigų										
Pavadinimas		Trumpas apibūdinimas				Bendra vertė		Paskirtis		Dalis GA (%)
Kitos priemonės, nenumatytos Kolektyvinio investavimo subjektų įstatymo 36 str. 1 d.										
Gautinos/mokėtinios sumos						2293027.10				1%
Iš viso						2293027.10				1%
<b>Iš viso</b>						<b>229,848,681.91</b>				<b>100%</b>

13. Investicijų pasiskirstymas:

13.1. pagal valiutas ir geografinę zoną

Investicijų pasiskirstymas	Ataskaitinio laikotarpio pabaigoje		Ataskaitinio laikotarpio pradžioje	
	Rinkos vertė, Lt	Dalis aktyvuose, %	Rinkos vertė, Lt	Dalis aktyvuose, %
1	2	3	4	5
<b>Pagal valiutas</b>				
litais	14,892,781.75	6%	9,107,892.53	5%
eurais	163,885,351.64	71%	122,491,059.69	69%
doleriai	27,479,798.19	12%	20,337,590.99	11%
Japonijos jenos	2,330,996.02	1%	1,379,343.28	1%
kita valiuta	21,259,754.31	9%	24,405,423.70	14%
<b>Iš viso</b>	<b>229,848,681.91</b>	<b>100%</b>	<b>177,721,310.19</b>	<b>100%</b>
<b>Pagal geografinę zoną</b>				
Lietuva	19,942,801.31	9%	9,525,719.68	5%
kitos Europos Sąjungos valstybės	205,199,095.56	89%	163,439,911.50	92%
kitos Europos ekonominės erdvės valstybės (Islandija, Norvegija, Lichtenšteinas)	-	0%		0%
Jungtinės Amerikos Valstijos ir Kanada	-	0%		
Japonija	-	0%		
kitos šalys	4,706,785.04	2%	4,755,679.01	3%
<b>Iš viso</b>	<b>229,848,681.91</b>	<b>100%</b>	<b>177,721,310.19</b>	<b>100%</b>

13.2. pagal investavimo strategiją atspindinčius kriterijus (ši portfelio analizė pildoma pasirenkant investavimo strategiją atitinkančius kriterijus, pavyzdžiui: pagal turto rūšis, pramonės šakas, geografinę zoną, valiutas, rinkas, emitentų tipus (vyriausybė, bendrovės), emitentų kredito reitingus, priemonių galiojimo trukmes bei kt.)

Investicijų pasiskirstymas	Ataskaitinio laikotarpio pabaigoje		Ataskaitinio laikotarpio pradžioje	
	Rinkos vertė, Lt	Dalis aktyvuose, %	Rinkos vertė, Lt	Dalis aktyvuose, %
1	2	3	4	5
<b>Pagal investavimo objektus</b>				
Skolos vertybiniai popieriai ir jų fondai	169,535,926.76	74%	133,148,327.50	75%
Nuosavybės vertybiniai popieriai ir jų fondai	43,809,240.87	19%	35,680,319.78	20%
Terminuotieji indeliai ir grynieji pinigai	16,409,551.34	7%	9,028,470.96	5%
Išvestinės investavimo priemonės	93,962.94	0%	-135,808.00	0%
<b>Iš viso:</b>	<b>229,848,681.91</b>	<b>100%</b>	<b>177,721,310.24</b>	<b>100%</b>

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.

Valiutos kurso rizikos valymo tikslais buvo sudaryti keli JAV dolerio, Japonijos jenos apsigėtimo sandoriai, t.y. atsižvelgiant į konkrečias įsigijamas investicines priemones, kurios yra nominuotos JAV doleriais ar Japonijos jenomis, buvo nupirkti JAV doleriai (jenos) ir sudarytas išankstinis sandoris juos parduoti sutartu laiku už sutartą kainą. Tokiu būdu, jei apsigėtimo sandorio pabaigoje mes parduotume įsigytą investicinę

priemonę, gautus JAV dolerius (jenas) galėtume panaudoti apsigkeitimo sandorio išsipareigojimų įvykdymui. Nepardavus investicinės priemonės, gali būti sudarytas naujas apsigkeitimo sandoris, pratęsiantis pirmąjį. Rizikos, susijusios su išvestinio sandorio sudarymu, yra kelios: 1) jei investicinės priemonės vertė JAV doleriais (jenomis) sumažėtų, tai išsipareigojimų vykdymo momentu turėtume papildomai išigyti JAV dolerių (jenu) tuo metu esančia rinkos kaina; 2) apsigkeitimo sandorio kita šalis atsisako vykdyti prisiimtus išsipareigojimus (neatperka JAV dolerių (jenu) sutarta kaina).

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

JAV dolerio ir lito apsigkeitimo sandoriai (rinkos vertė 2007.06.30) – 97981,78 Lt.

Japonijos jenos ir euro apsigkeitimo sandoriai (rinkos vertė 2007.06.30) – (4018.84) 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 skolas vertybinius popierius, vienetai sudarė apie 74 % investicijų portfelio. Akcijos ir jų fondai sudarė apie 19 proc. Tokio tipo fondai yra skirti investuotojams, kurie nori prisiimti nedidelę investavimo riziką ir (arba) kurių investavimo horizontas yra bent 5-10 metų. Todėl "Pensija 2" fondo valdymo tikslas – siekti aukštesnio investicijų pelningumo per vidutinį laikotarpį. Investicijos parenkamos pagal laukiamą vertės augimo perspektyvą. Fondas gali prisiimti valiutos (iki 15 proc. atvira valiutos pozicija), kredito ir palūkanų normos riziką. Valiutos rizika valdoma sudarinėjant valiutų apsigkeitimo, išankstinio pirkimo (pardavimo) sandorius toms valiutoms, kurioms sudaryti tokius sandorius ekonomiškai apsimoka. Tokiu būdu iš dalies buvo apsidrausta nuo JAV dolerio, 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. 2005 m. rudenį Lietuvos ir kitose ES rinkose prasidėjusi palūkanų kilimo tendencija tęsėsi 2007 m. I pusm., todėl investicijų portfelio vertė augo lėčiau (palūkanoms kylant, obligacijų kainos krenta). Akcijų rinkoje svyravimai būna didesni (ne išimtis ir 2007 metai). Priimant investicinius sprendimus taip pat atsižvelgiama į skirtingų geografinių regionų vystymosi perspektyvas. Valiutų kursų svyravimų įtaka portfelio vertės kitimui buvo palyginti nedidelė, nes portfelyje neapdraustų valiutinių pozicijų buvo tik nedidelė dalis (iki 15 proc.)

Sprendimai dėl portfelio struktūros galimų pokyčių priimami reguliariai (ne rečiau kaip kartą per metus) ir atsižvelgiant į situaciją rinkoje: kuriame regione daugiau investuoti, kokio tipo vertybinius popierius rinktis (Vyriausybės obligacijas ar bendrovių? Kokio termino? Akcijas ar kolektyvinio investavimo subjektus, investuojančius į jas? Ir t.t.), ar ir kaip drausti tam tikras investicijų portfelio rizikas.

## V. PENSIJŲ FONDO INVESTICIJŲ GRAŽA IR RIZIKOS RODIKLIAI

V skyrius pusmečio ataskaitoje nepildomas.

## 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 2007 M. BIRŽELIO 30 D. DUOMENIS

(litas)

Eil. Nr.	Turtas	Pastabų Nr.	Ataskaitinis laikotarpis	Praėjęs ataskaitinis laikotarpis
I.	PINIGAI IR PINIGŲ EKVIVALENTAI	2	14,116,524	9,028,471
II.	TERMINUOTI INDĖLIAI	2	0	0
III.	INVESTICIJOS	1	213,345,173	168,828,647
1.	Skolos vertybiniai popieriai	1	83,810,481	77,455,987
1.1.	Vyriausybių ir centrinių bankų arba jų garantuoti skolos vertybiniai popieriai	1	2,886,534	0
1.2.	Kiti skolos vertybiniai popieriai	1	80,923,947	77,455,987
2.	Nuosavybės vertybiniai popieriai	1	3,382,387	5,708,837
3.	Kolektyvinio investavimo subjektų investiciniai vienetai ir akcijos	1	126,152,305	85,663,823
4.	Kitos investicijos			
IV.	GAUTINOS SUMOS	2	2,391,009	0
1.	Investicijų pardavimo sandorių gautinos sumos		2,293,027	
2.	Kitos gautinos sumos	2	97,982	0
	<b>TURTAS, IŠ VISO</b>	<b>2</b>	<b>229,852,706</b>	<b>177,857,118</b>

Eil. Nr.	Įsipareigojimai ir gryniesi aktyvai	Pastabų Nr.	Ataskaitinis laikotarpis	Praėjęs ataskaitinis laikotarpis
V.	ĮSIPAREIGOJIMAI		498,371	517,341
1.	Investicijų pirkimo įsipareigojimai		0	
2.	Mokėtinos sumos kaupimo bendrovei ir depozitoriumui		494,352	381,533
3.	Kitos mokėtinos sumos ir įsipareigojimai		4,019	135,808
VI.	GRYNIEJI AKTYVAI (I+II+III+IV-V)		229,354,335	177,339,777
	<b>ĮSIPAREIGOJIMAI IR GRYNIEJI AKTYVAI, IŠ VISO</b>		<b>229,852,706</b>	<b>177,857,118</b>

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

**GRYNUJŲ AKTYVŲ POKYČIŲ ATASKAITA  
PAGAL 2007 M. BIRŽELIO 30 D. DUOMENIS**

(litas)

Eil. Nr.	Straipsniai	Pastabų Nr.	Ataskaitinis laikotarpis	Praėjęs ataskaitinis laikotarpis
I.	GRYNIJEI AKTYVAI ATASKAITINIO LAIKOTARPIO PRADŽIOJE		177,339,777	84,619,253
II.	PADIDĖJIMAS, IŠ VISO		74,328,969	111,124,133
1.	Pensijų įmokos		61,101,137	92,725,071
2.1.	Iš kitų pensijų fondų pervestos sumos		761,551	417,847
2.2.	Iš fondų sujungimo gautos sumos		0	0
3.	Kaupimo bendrovės garantinės įmokos		0	0
4.	Palūkanos ir dividendai		2,253,545	2,570,889
5.	Investicijų pardavimo pelnas		5,062,345	3,134,834
6.	Investicijų vertės padidėjimo suma		4,430,866	10,824,983
7.	Turto vertės padidėjimas dėl užsienio valiutų kursų pasikeitimo		674,652	1,356,495
8.	Kitos pajamos		44,873	94,014
III.	SUMAŽĖJIMAS, IŠ VISO		22,314,411	18,403,609
1.	Pensijų išmokos		116,812	104,416
2.	I kitus pensijų fondus pervestos sumos		11,089,934	3,796,909
3.	Investicijų pardavimo nuostoliai		795,768	2,528,552
4.	Investicijų vertės sumažėjimo suma		7,399,731	7,554,542
5.	Turto vertės sumažėjimas dėl užsienio valiutų kursų pasikeitimo		130,523	481,784
6.	Valdymo sąnaudos		2,781,643	3,937,406
7.	Kitos sąnaudos			
IV.	GRYNIJEI AKTYVAI ATASKAITINIO LAIKOTARPIO PABAIGOJE		229,354,335	177,339,777

		Ataskaitinio laikotarpio pabaigoje	Praėjęs ataskaitinis laikotarpis
V.	APSKAITOS VIENETO VERTĖ	1.1746	1.1566
VI.	APSKAITOS VIENETŲ SKAIČIUS	195255132.105	153332790.005

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 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 Aludarių g. 2, Vilnius, įmonės kodas 111525237.

**2. Apskaitos politika.**

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

Investuojant pensijų fondo turtą, yra išskiriamos kelios rizikų rūšys:

#### *Kredito rizika*

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

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

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

#### *Rinkos rizika*

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

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

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

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

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

*gryniesi pinigai ir lėšos* bankuose vertinami pagal nominalią verte;

*išvestinės investicinės priemonės* verte 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 verte, 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 verte ir apskaitos vieneto verte nustatoma kiekvieną darbo dieną. Kartą per mėnesį apskaičiuojama vidutinė praėjusio mėnesio apskaitos vieneto verte. Pensijų fondo gryniesi aktyvai įvertinami jų tikrąją verte, vadovaujantis grynųjų aktyvų vertės skaičiavimo metodika. Apskaitos vieneto verte nustatoma pensijų fondo grynųjų aktyvų verte dalinant iš apskaitos vienetų skaičiaus. Apskaitos vienetų verte 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					
	praejusio ataskaitinio laikotarpio pabaigoje	įsigyta	parduota (išpirkta)	vertės padidėjimas	vertės sumažėjimas	ataskaitinio laikotarpio pabaigoje
Skolos vertybiniai popieriai	77,455,987	51,083,746	45,006,905	3,911,123	3,633,470	83,810,481
<i>Vyriausbių ir centrinių bankų arba jų garantuoti skolos vertybiniai popieriai</i>	0	2,887,737	0	14,764	15,967	2,886,534
<i>Kiti skolos vertybiniai popieriai</i>	77,455,987	48,196,009	45,006,905	3,896,359	3,617,503	80,923,947
Nuosavybės vertybiniai popieriai	5,708,837	395,423	2,809,282	1,239,092	1,151,683	3,382,387
Kolektyvinio investavimo subjektų investiciniai vienetai ir akcijos	85,663,823	72,605,195	34,993,657	6,287,289	3,410,345	126,152,305
Kitos investicijos						
Iš viso	168,828,647	124,084,364	82,809,844	11,437,504	8,195,498	213,345,173

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 kurias 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)
Terminuotas indėlis		LTL		3.66%	2007.07.01	12,047,001	5.24%
Terminuotas indėlis		EUR		3.66%	2007.07.01	2,069,523	0.90%
Gautinos sumos už VP pardavimą		EUR				2,293,027	1.00%
SW(USD)		USD				97,982	0.04%
Austrijos Vyriausybė	Austrija	EUR	7,022,995	5.00%	2012.07.15	7,490,082	3.26%
Čekijos Vyriausybė	Čekija	CZK	1,302,785	6.55%	2011.10.05	1,486,911	0.65%
Vokietijos Vyriausybė	Vokietija	EUR	9,250,051	3.25%	2008.06.13	9,166,530	3.99%
Vokietijos Vyriausybė	Vokietija	EUR	3,943,098	3.50%	2009.10.09	3,960,523	1.72%
Ispanijos Vyriausybė	Ispanija	EUR	7,036,806	4.20%	2037.01.31	6,519,919	2.84%
Suomijos Vyriausybė	Suomija	EUR	4,167,530	3.88%	2017.09.15	4,047,793	1.76%
Graikijos Vyriausybė	Graikija	EUR	9,988,950	5.35%	2011.05.18	10,303,496	4.48%
Vengrijos Vyriausybė	Vengrija	HUF	2,124,960	7.25%	2008.04.24	2,153,273	0.94%
Vengrijos Vyriausybė	Vengrija	HUF	2,432,520	5.50%	2016.02.12	2,299,750	1.00%
Vengrijos Vyriausybė	Vengrija	HUF	279,600	6.50%	2009.08.12	295,405	0.13%
Italijos Vyriausybė	Italija	EUR	3,007,389	7.25%	2026.11.01	3,906,218	1.70%
Italijos Vyriausybė	Italija	EUR	7,388,992	3.75%	2015.08.01	7,045,267	3.07%
Italijos Vyriausybė	Italija	EUR	5,179,200	0.00%	2007.07.16	5,171,742	2.25%
VILNIAUS BANKAS	Lietuva	LTL	325,900	3.10%	2008.02.20	325,921	0.14%
Lietuvos Vyriausybė	Lietuva	LTL	1,370,000	5.10%	2010.02.11	1,410,178	0.61%
Lietuvos Vyriausybė	Lietuva	LTL	1,390,000	5.60%	2013.01.24	1,476,356	0.64%
Latvijos Vyriausybė	Latvija	LVL	743,955	5.00%	2011.11.03	768,008	0.33%
Lenkijos Vyriausybė	Lenkija	PLN	2,393,140	6.00%	2010.11.24	2,521,463	1.10%
Lenkijos Vyriausybė	Lenkija	PLN	3,941,642	5.75%	2010.03.24	4,046,644	1.76%
Lenkijos Vyriausybė	Lenkija	PLN	1,965,337	5.25%	2017.10.25	1,977,870	0.86%
PAN EUROPEAN CREDIT S.A.	Liuksemburgas	EUR	897,728	0.00%	2009.10.28	887,033	0.39%
PAN EUROPEAN CREDIT S.A.	Liuksemburgas	EUR	1,001,312	0.00%	2010.04.21	974,413	0.42%
EUROPEAN INVESTMENT BANK	Didžioji Britanija	TRY	3,941,184	18.50%	2009.03.20	4,184,363	1.82%
Latvijos Vyriausybė	Latvija	LVL	1,373,837	5.13%	2013.02.14	1,391,323	0.61%
ERSTE BANK	Austrija	EUR				543,634	0.24%
NORMA AS	Estija	EEK				150,387	0.07%
TALLINK GRUPP AS	Estija	EEK				252,681	0.11%
OLYMPIC ENTERTAINMENT GROUP AS	Estija	EEK				517,910	0.23%
OIP ES KERESKEDELMI BANK NYRT SNAIGE AB	Vengrija	HUF				564,596	0.25%
SAF TEHNIKA A/S	Lietuva	LTL				226,833	0.10%
PROKOM SOFTWARE SA	Latvija	LVL				161,037	0.07%
PROKOM SOFTWARE SA	Lenkija	PLN				442,886	0.19%
GAZPROM	Rusija	USD				218,318	0.09%
VNESHTORGBANK	Rusija	USD				112,620	0.05%
LUKOIL HOLDING	Rusija	USD				191,484	0.08%

HANSA INVESTIERIMISFONDID	Estija	EUR				3,957,568	1.72%
HANSA INVESTIERIMISFONDID	Estija	EUR				2,281,257	0.99%
HANSA INVESTIERIMISFONDID	Estija	EUR				16,897,186	7.35%
HANSA INVESTIERIMISFONDID	Estija	EUR				1,091,516	0.47%
HANSA INVESTIERIMISFONDID	Estija	EUR				2,175,607	0.95%
STATE STREET GLOBAL ADVISORS	Prancūzija	JPY				2,330,997	1.01%
STATE STREET GLOBAL ADVISORS	Prancūzija	CAD				533,313	0.23%
STATE STREET GLOBAL ADVISORS	Prancūzija	AUD				534,915	0.23%
STATE STREET GLOBAL ADVISORS	Prancūzija	USD				8,560,154	3.72%
STATE STREET GLOBAL ADVISORS	Prancūzija	EUR				8,033,671	3.50%
PIMCO FUNDS GLOBAL INVE	Didžioji Britanija	EUR				7,808,982	3.40%
T-ROWE PRICE GLBL EMERG.INV SE	Liuksemburgas	USD				4,277,143	1.86%
T-ROWE PRICE GLBL EMERG.INV SE	Liuksemburgas	EUR				5,796,607	2.52%
PICTET FUNDS SA	Liuksemburgas	EUR				8,662,110	3.77%
T-ROWE PRICE GLBL EMERG.INV SE	Liuksemburgas	USD				4,655,370	2.03%
DWS INVESTMENT GMBH	Liuksemburgas	EUR				1,995,349	0.87%
JULIUS BAER INVESTMENT FUNDS	Liuksemburgas	EUR				7,718,856	3.36%
JULIUS BAER INVESTMENT FUNDS	Liuksemburgas	EUR				7,952,551	3.46%
ABN AMRO ASSET MANAGEMENT	Liuksemburgas	EUR				10,979,598	4.78%
T-ROWE PRICE GLBL EMERG.INV SE	Liuksemburgas	USD				9,366,727	4.08%
HSBC GLOBAL INVESTMENT FUNDS	Liuksemburgas	EUR				1,879,000	0.82%
BLUEBAY ASSET MANAGEMENT	Liuksemburgas	EUR				1,811,291	0.79%
BLUEBAY ASSET MANAGEMENT	Liuksemburgas	EUR				6,852,537	2.98%
Iš viso	X	X	X	X	X	229,852,706	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		144388
Dalyvių skaičius ataskaitinio laikotarpio pabaigoje	dalyviai, pasinaudoję teise nukelti pensijų išmokos mokėjimą	-
	dalyviai, gaunantys periodines pensijų išmokas	-
	kiti dalyviai	-
	Iš viso	141323
Dalyvių skaičiaus pokytis		-3065

26. Per ataskaitinį laikotarpį prisijungusių dalyvių skaičius:

Bendras prisijungusių dalyvių skaičius		1886
Dalyviai, pensijų kaupimo sutartis sudarę pirmą kartą		1605
Iš kitų pensijų fondų atėję dalyviai	iš tos pačios pensijų kaupimo bendrovės	255
	iš kitos pensijų kaupimo bendrovės	26

27. Per ataskaitinį laikotarpį pasitraukusių dalyvių skaičius:

Bendras pasitraukusių dalyvių skaičius		4951
Į kitus pensijų fondus išėjusių dalyvių skaičius	valdomus tos pačios pensijų kaupimo bendrovės	4410
	valdomus kitos pensijų kaupimo bendrovės	437

Baigusiu 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)	5
	dalyvių, pasinaudojusių Pensijų kaupimo įstatymo suteikta galimybe vienašališkai nutraukti pirmą kartą sudarytą sutartį	20
	mirusių dalyvių	79

## 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	7791	92669	40823	40	141323
	vyrų	4020	41173	19081	40	64314
	moterys	3771	51496	21742	0	77009
Dalyvių dalis, %	iš viso	6	66	29	0	100
	vyrų	2.84	29.13	13.50	0.03	45.51
	moterys	2.67	36.44	15.38	0.00	54.49

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		61,862,687.77
Periodinės įmokos į pensijų fondą	iš Valstybinio socialinio draudimo fondo	61,101,136.56
	pačio dalyvio įmokėtos lėšos (pildoma tik papildomo savanoriško pensijų kaupimo pensijų fondo atveju)	-
	darbdavių ir kitų trečiųjų asmenų įmokėtos lėšos (pildoma tik papildomo savanoriško pensijų kaupimo pensijų fondo atveju)	-
Valstybinio socialinio draudimo fondo sumokėti delspinigiai		-
Iš garantijų rezervo sumokėtos lėšos		-
Iš kitų pensijų fondų pervestos lėšos	iš tos pačios pensijų kaupimo bendrovės	677,561.63
	iš kitos pensijų kaupimo bendrovės	83,989.58
Kitos gautos lėšos (nurodyti šaltinį ir gautų lėšų sumą), 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 rengęs asmenys nėra bendrovės darbuotojai) -.

36. Valdymo įmonės administracijos vadovo, vyriausiojo finansininko, ataskaitą rengusių asmenų ir konsultantų patvirtinimas, kad joje pateikta informacija teisinga ir nėra nutylėtų faktų, galinčių daryti esminę įtaką pensijų fondo veiklos rezultatų vertinimui.

Tvirtiname:

UAB "Hansa investicijų valdymas"  
Administracijos vadovas

\_\_\_\_\_

A.Maždzierius

UAB "Hansa investicijų valdymas"  
Vyriausioji finansininkė

\_\_\_\_\_

A.Žeknienė

UAB "Hansa investicijų valdymas"  
Fondo valdytojos asistentė

\_\_\_\_\_

V. Vaicekavičienė

UAB "Hansa investicijų valdymas"  
Ekonomistas

\_\_\_\_\_

T.Kivaras