

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

PENSIJŲ FONDO ATASKAITOS TURINYS

I. BENDROSIOS NUOSTATOS

1. Valstybinio socialinio draudimo įmokos dalies kaupimo pensijų fondas **Pensija 4** (toliau – pensijų fondas) veikia pagal 2005 m. lapkričio 25 d. Vertybinių popierių komisijos patvirtintas pensijų fondo taisykles, kurioms suteiktas registravimo numeris Nr. PF-V04-K002-023(001).

2. Valdymo įmonės duomenys:

2.1. UAB “Hansa investicijų valdymas”, 124815377;

2.2. Juridinis adresas – Savanorių pr. 19, Vilnius, buveinė - Justiniškių g. 64, Vilnius;

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

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

2.5. pensijų fondo valdytoja – UAB “Hansa investicijų valdymas” fondų valdytoja Daiva Račkauskienė.

3. Asmenys, atsakingi už ataskaitoje pateiktą informaciją:

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

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

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

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

- valdymo įmonės fondo valdytojos asistentė – Vaida Juozapėnaitė, tel.2684496, faks.2684819, vaida.juozapenaite@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 - 2006 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	Ataskaitinio laikotarpio pabaigoje	Prieš metus (2005.06.30)	Prieš dvejus metus (2004.06.30)
Grynųjų aktyvų vertė (GAV), Lt	173334.78	5312688.39	-	-
Apskaitos / Investicinio vieneto (akcijos) vertė, Lt	1.0051	0.9681	-	-
Apskaitos / Investicinio vienetų (akcijų) skaičius	172460.35	5487495.373	-	-

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

	Apskaitos / investicinių vienetų (akcijų) skaičius	Vertė, Lt
Išplatinta / Vientų skaičius (konvertuojant pinigines lėšas į apskaitos vienetus)	5355849.828	3694082.92
Išpirkta / Vientų skaičius (konvertuojant vienetų į pinigines lėšas)	40814.808	39709.32

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%	50543	50543
Nuo turto vertės	1%	1%	14283	4232
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%	-	-	-
<i>pensijų kaupimo bendrovės keitimas daugiau kaip kartą per metus</i>	0.20%	-	-	-
Iš viso			64826	54775
BAR (nurodomas tik Komisijai skirtame metų ataskaitos egzemplioriuje)				
Sąlyginis BIK ir (arba) Tikėtinas sąlyginis BIK				
PAR (portfelio apyvartumo rodiklis)				

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

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

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

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

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 (tinklalapio adresas)	Balsų dalis emitente, %	Dalis GA, %
Nuosavybės vertybiniai popieriai, įtraukti į Oficialųjį ar jį atitinkantį prekybos sąrašą									
Raiffeisen International	AT	AT0000606306	229	790.69	52,129.68	53,687.93	www.wienerboerse.at	0%	1%
Erste Bank	AT	AT0000652011	315	1,087.63	48,943.96	47,855.81	http://www.wienerboerse.at	0%	1%
OMV AG	AT	AT0000743059	401	1,384.57	56,559.80	64,451.86	http://www.wienerboerse.at	0%	1%
CESKE ENERGETICKE ZAVODY AS	CZ	CZ0005112300	581	7,060.31	51,887.83	53,128.85	www.pse.cz	0%	1%
NORMA AS	EE	EE3100001850	1500	3,310.05	32,296.95	24,600.29	www.omxgroup.com	0%	0%
Tallinn Water	EE	EE3100026436	745	164.40	32,123.11	34,160.50	www.omxgroup.com	0%	1%

TALLINK GRUPP AS	EE	EE3100004466	1326	2,926.08	19,858.70	16,023.24	www.hex.ee	0%	0%
OTP	HU	HU0000061726	742	911.32	64,695.51	57,140.04	www.bet.hu	0%	1%
MOL	HU	HU0000068952	94	1,154.51	26,945.33	26,265.06	www.bet.hu	0%	0%
SNAIGE	LT	LT0000109274	2047	2,047.00	32,488.20	19,446.50	http://www.lt.omxgroup.com/	0%	0%
LIETUVOS TELEKOMAS	LT	LT0000123911	16001	16,001.00	41,245.11	35,682.23	http://www.lt.omxgroup.com/	0%	1%
SAF Tehnika	LV	LV0000101129	575	2,852.58	30,648.85	27,384.72	www.omxgroup.com	0%	1%
BANK PEKAO SA	PL	PLPEKAO00016	239	202.79	37,324.60	38,530.39	www.gpw.com.pl	0%	1%
POLSKI KONCERN NAFTORNY ORLEN	PL	PLPKN0000018	863	915.32	43,101.63	38,809.54	www.gpw.com.pl	0%	1%
SOFTBANK	PL	PLSOFTB00016	405	343.64	13,442.22	12,405.49	www.gpw.com.pl	0%	0%
PROKOM SOFTWARE	PL	PLPROKM00013	185	156.97	22,001.76	19,386.10	www.gpw.com.pl	0%	0%
SWEDBANK	SE	SE0000242455	430	161.18	34,459.51	30,463.25	www.omxgroup.com	0%	1%
CENTRAL EUROPEAN MEDIA	SK	BMG200452024	192	528.56	34,899.66	33,399.50	www.nasdaq.com	0%	1%
Iš viso:						632,821.30			12 %
Nuosavybės vertybiniai popieriai, įtraukti į Einamąjį ar jį atitinkantį prekybos sąrašą									
Iš viso:						0			0
Nuosavybės vertybiniai popieriai, kuriais prekiaujama reguliuojamose rinkose, kurios specializuojasi mažų ir vidutinių įmonių srityje									
Iš viso:						0			0
Nuosavybės vertybiniai popieriai, kuriais prekiaujama kitose reguliuojamose rinkose									
UNIFIED ENERGY SYSTEMS RAO ES GDR	RU	US9046882075	50	137.65	7,520.70	9,621.39	www.londonstockexchange.com	0%	0%
GAZPROM ADR	RU	US3682872078	150	412.94	13,865.44	17,363.92	www.londonstockexchange.com	0%	0%
LUKOIL HOLDING ADR	RU	US6778621044	85	234.00	14,535.53	19,468.51	www.londonstockexchange.com	0%	0%
PLIVA	HR	US72917Q2021	571	157,190.59	25,187.40	42,441.46	www.londonstockexchange.com	0%	1%
Iš viso:						88,895.27			2%
Išleidžiami nauji nuosavybės vertybiniai popieriai									
Iš viso:						0			0
Iš viso nuosavybės vertybinių popierių:						721,716.57			14 %
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:						0			0
Skolos vertybiniai popieriai, įtraukti į Einamąjį ar jį atitinkantį prekybos sąrašą									
Iš viso:						0			0
Skolos vertybiniai popieriai, kuriais prekiaujama kitose reguliuojamose rinkose									
Čekijos Vyriausybė	CZ	CZ0001000764	150,000.00	18,228.00	22,143.18	21,510.92	6.550%	2011.10.05	0%
Austrijos Vyriausybė	AT	AT0000385356	8.00	27,622.40	30,497.27	30,517.10	5.000%	2012.07.15	1%

Austrijos vyriausybė	AT	AT0000A001X2	4.00	13,811.20	13,620.86	13,038.00	3.500%	2021.09.15	0%
Belgijos Vyriausybė	BE	BE0312609754	5,000,000.00	172,640.00	172,453.55	172,519.15	0.000%	2006.07.13	3%
Vokietijos Vyriausybė	DE	DE0001137115	2,500,000.00	86,320.00	86,712.07	86,679.53	2.25%	2007.09.14	2%
Vokietijos Vyriausybė	DE	DE0001141380	300,000.00	10,358.40	10,648.54	10,781.64	4.750%	2018.08.06	0%
Vokietijos Vyriausybė	DE	DE0001141455	12.00	41,433.60	42,219.94	42,209.03	3.500%	2009.10.09	1%
Vokietijos Vyriausybė	DE	DE0001141463	700,000.00	24,169.60	25,011.05	23,913.17	3.250%	2010.04.09	0%
Ispanijos Vyriausybė	ES	ES0000012932	5.00	17,264.00	18,297.81	17,050.10	4.200%	2037.01.31	0%
Prancūzijos Vyriausybė	FR	FR0106589437	20,000.00	69,056.00	69,915.99	69,933.39	3.50%	2009.01.12	1%
Graikijos Vyriausybė	GR	GR0128002590	1,000,000.00	34,528.00	40,936.98	40,615.77	6.500%	2014.01.11	1%
Italijos Vyriausybė	IT	IT0000366655	600,000.00	20,716.80	32,286.80	32,113.61	9.000%	2023.11.01	1%
Italijos Vyriausybė	IT	IT0003080402	9.00	31,075.20	33,749.50	33,600.34	5.160%	2011.08.01	1%
Italijos Vyriausybė	IT	IT0003844534	2,000.00	6,905.60	6,949.97	6,753.92	3.750%	2015.08.01	0%
Portugalijos Vyriausybė	PT	PTPBTFG0002	15,000.00	51,792.00	51,049.30	51,214.52	0.000%	2006.11.17	1%
Vengrijos Vyriausybė	HU	HU0000402045	175.00	21,493.50	23,163.47	20,422.96	6.750%	2013.02.12	0%
Vengrijos Vyriausybė	HU	HU0000402318	224.00	27,511.68	27,009.20	23,679.33	5.500%	2016.02.12	0%
Vengrijos Vyriausybė	HU	HU0000402276	1,200,000.00	14,738.40	17,563.31	14,637.33	7.250%	2008.04.24	0%
Lenkijos Vyriausybė	PL	PL0000101259	64.00	54,304.00	55,481.76	55,622.25	6.000%	2009.05.24	1%
Lenkijos Vyriausybė	PL	PL0000101937	35.00	29,697.50	34,350.57	31,336.43	6.000%	2010.11.24	1%
Lenkijos Vyriausybė	PL	PL0000103602	33.00	28,000.50	33,617.61	30,337.06	6.250%	2015.10.24	1%
Slovakijos Vyriausybė	SK	SK4120004227	4.00	35,918.40	39,054.97	36,308.43	4.900%	2014.02.11	1%
European Investment Bank	TR	XS0211938013	29.00	49,694.40	58,435.68	50,302.48	14.500%	2011.06.08	1%
Iš viso:						915,096.46			17 %
Išleidžiami nauji skolos vertybiniai popieriai									
Iš viso:						0			0
Iš viso skolos vertybinių popierių:						915,096.46			17 %
KIS pavadinimas	Šalis	ISIN kodas	Kiekis, vnt.	Valdytojas	Bendra įsigijimo vertė	Bendra rinkos vertė	Rinkos vertės nustatymo šaltinis (tinklalapio adresas)	KIS aktyvų dalis investuota į kitus KIS, %	Dalis GA, %
Kolektyvinių investavimo subjektų, atitinkančių Kolektyvinio investavimo subjektų 40 str. 1 d. reikalavimus, vienetai (akcijos)									
Hansa Russian Equity Fund	EE	EE3600073318	3613.648	AS Hansa Investeerimisfondid	262,686.85	235,693.86	www.hansa.ee	iki 10%	4%
Hansa Eastern European Equity Fund	EE	EE3600073326	3765.05	AS Hansa Investeerimisfondid	230,657.09	222,429.39	www.hansa.ee	iki 10%	4%
Hansa Eastern European Bond Fund	EE	EE3600077608	2365.14	AS Hansa Investeerimisfondid	79,391.11	70,067.33	www.hansa.ee	iki 10%	1%

Iš viso indėlių kredito įstaigose:					0				0	
Priemonės pavadinimas	Emitentas	Šalis	Kita sandorio šalis	Valiuta	Investicinis sandoris (pozicija)	Sandorio (pozicijos) vertė	Bendra rinkos vertė	Rinkos pavadinimas (tinklapio adresas)	Galiojimo terminas	Dalis GA, %
Išvestinės investicinės priemonės, kuriomis prekiaujama reguliuojamose rinkose										
Iš viso:										
							0			0
Kitos išvestinės investicinės priemonės										
LTL/USD valiutos apskaitimo sandoris (SWAP)	AB Hansabankas	LT	AB Hansabankas	USD	81,780.00	82,073.53	-293.53		2006.09.21	0%
LTL/USD valiutos apskaitimo sandoris (SWAP)	AB Hansabankas	LT	AB Hansabankas	USD	190,820.00	191,504.91	-684.91		2006.09.21	0%
LTL/USD valiutos apskaitimo sandoris (SWAP)	AB Hansabankas	LT	AB Hansabankas	USD	537,022.00	538,949.54	-1,927.54		2006.09.21	0%
Iš viso:							-2,905.98			0%
Iš viso išvestinių investicinių priemonių:							-2,905.98			0%
Banko pavadinimas				Valiuta	Bendra rinkos vertė		Palūkanų norma		Dalis GA, %	
Pinigai										
Hansabankas				LTL	434,708.42				8%	
Hansabankas				SEK	1,027.53				0%	
Hansabankas				EEK	2,306.44				0%	
Hansabankas				USD	245.75				0%	
Hansabankas				EUR	172,283.39				3%	
Hansabankas				JPY	0.02				0%	
Iš viso pinigų:					610,571.56				11%	
Pavadinimas	Trumpas apibūdinimas			Bendra vertė			Paskirtis		Dalis GA, %	
Kitos priemonės, nenumatytos Kolektyvinio investavimo subjektų įstatymo 36 str. 1d.										
Iš viso:										
					0				0	

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
Pagal valiutas				
litas	489,837.15	9%	38,995.54	22%
eurais	2,507,698.76	47%	85,749.77	49%
JAV doleriais	1,362,414.08	26%	30,470.81	18%
Japojos jenos	219,442.61	4%	7,610.71	4%
kita valiuta	743,347.15	14%	10,560.90	6%
Iš viso	5,322,739.75	100.00%	173,387.73	100.00%
Pagal geografinę zoną				
Lietuva	662,794.31	12%	39,398.50	23%
kitos Europos Sąjungos valstybės	2,651,945.29	50%	87,823.27	51%

kitos Europos ekonominės erdvės valstybės (Islandija, Norvegija, Lichtenšteinas)	0.00	0%	0.00	0%
Jungtinės Amerikos Valstijos ir Kanada	620,768.76	12%	21,194.06	12%
Japonija	219,442.59	4%	7,610.69	4%
kitos šalys	1,167,788.79	22%	17,361.21	10%
Iš viso	5,322,739.75	100%	173,387.73	100%

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
Pagal investavimo objektus				
Skolos vertybiniai popieriai ir jų fondai	1,327,282.81	25%	41,901.74	24%
Nuosavybės vertybiniai popieriai ir jų fondai	3,387,791.36	64%	110,815.07	64%
Terminuotieji indeliai ir gryniesi pinigai	610,571.56	11%	20,670.92	12%
Išvestinės investavimo priemonės	-2,905.98	0%	0.00	0%
Iš viso:	5,322,739.75	100%	173,387.73	100%

14. Per ataskaitinį laikotarpį įvykdyti sandoriai su išvestinėmis investicinėmis priemonėmis, išskyrus tuos, kurie nurodyti šio priedo 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 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 apsigėitimo sandoriai, t.y. atsižvelgiant į konkrečias įsigyjamąs investicines priemones, kurios yra nominuotos JAV doleriais, buvo nupirkti JAV doleriai ir sudarytas išankstinis sandoris juos parduoti sutartu laiku už sutartą kainą. Tokiu būdu, jei apsigėitimo sandorio pabaigoje mes parduotume įsigytą investicinę priemonę, gautus JAV dolerius galėtume panaudoti apsigėitimo sandorio įsipareigojimų įvykdymui. Nepardavus investicinės priemonės, gali būti sudarytas naujas apsigėitimo sandoris, pratęsiantis pirmąjį. Rizikos, susijusios su išvestinio sandorio sudarymu, yra kelios: 1) jei investicinės priemonės vertė JAV doleriais sumažėtų, tai įsipareigojimų vykdymo momentu turėtume papildomai įsigyti JAV dolerių tuo metu esančia rinkos kaina; 2) apsigėitimo sandorio kita šalis atsisako vykdyti prisiimtus įsipareigojimus (neatperka JAV dolerių sutarta kaina).

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

JAV dolerio ir lito apsigėitimo sandoriai (rinkos vertė 2006.06.30) – (2,906) 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 70 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 25 % investicijų portfelio. Akcijos ir jų fondai sudarė apie 64 proc. Tokio tipo fondai yra skirti investuotojams, kurie nori prisiimti didesnę investavimo riziką ir kurių investavimo horizontas yra virš 15-20 metų. Todėl "Pensija 4" fondo valdymo tikslas – siekti aukštesnio investicijų pelningumo per ilgą laikotarpį. Investicijos parenkamos pagal laukiamą vertės augimo perspektyvą. Fondas gali prisiimti valiutos, kredito ir palūkanų normos riziką. Valiutos rizika valdoma sudarinėjant valiutų apskaitos, išankstinio pirkimo (pardavimo) sandorius toms valiutoms, kurioms sudaryti tokius sandorius ekonomiškai apsimoka. 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 2006 m. I pusr., todėl investicijų portfelio vertė augo lėčiau (palūkanoms kylant, obligacijų kainos krenta). Akcijų rinkoje svyravimai būna didesni (ne išimtis ir 2006 metai), nemažą įtaką turi sezoniškas. Priimant investicinius sprendimus, taip pat atsižvelgiama į skirtingų geografinių regionų vystymosi perspektyvas. Valiutų kursų svyravimų įtaka portfelio vertės kitimui buvo nedidelė, nes portfelyje neapdraustų valiutinių pozicijų buvo tik nedidelė dalis (apie 15-20 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 2006 M. BIRŽELIO 30 D. DUOMENIS

(litais)

Eil. Nr.	Turtas	Pastabų Nr.	Ataskaitinis laikotarpis	Praėjęs ataskaitinis laikotarpis
I.	PINIGAI IR PINIGŲ EKVIVALENTAI	2	610571	-
II.	TERMINUOTI INDĖLIAI	2	0	-
III.	INVESTICIJOS	1	4715075	-
1	Skolos vertybiniai popieriai	1	915097	-
1.1.	Vyriausybės ir centrinių bankų arba jų garantuoti skolos vertybiniai popieriai	1	0	-
1.2.	Kiti skolos vertybiniai popieriai	1	915097	-
2	Nuosavybės vertybiniai popieriai	1	721717	-
3	Kolektyvinio investavimo subjektų investiciniai vienetai ir akcijos	1	3078261	-
4	Kitos investicijos			-
IV.	GAUTINOS SUMOS	2	0	-
1	Investicijų pardavimo sandorių gautinos sumos			-
2	Kitos gautinos sumos	2		-
	TURTAS, IŠ VISO	2	5325646	-

Eil. Nr.	Įsipareigojimai ir grynieji aktyvai	Pastabų Nr.	Ataskaitinis laikotarpis	Praėjęs ataskaitinis laikotarpis
V.	ISIPAREIGOJIMAI		12958	-
1.	Investicijų pirkimo įsipareigojimai		0	-
2.	Mokėtinos sumos kaupimo bendrovei ir depozitoriumui		10052	-
3.	Kitos mokėtinos sumos ir įsipareigojimai		2906	-
VI.	GRYNIEJI AKTYVAI (I+II+III+IV-V)		5312688	-
	ISIPAREIGOJIMAI IR GRYNIEJI AKTYVAI, IŠ VISO		5325646	-

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

GRYŪJŲ AKTYVŲ POKYČIŲ ATASKAITA
PAGAL 2006 M. BIRŽELIO 30 D. DUOMENIS

(litais)

Eil. Nr.	Straipsniai	Pastabų Nr.	Ataskaitinis laikotarpis	Praėjęs ataskaitinis laikotarpis
I.	GRYŪNIEJI AKTYVAI ATASKAITINIO LAIKOTARPIO PRADŽIOJE		173335	0
II.	PADIDĖJIMAS, IŠ VISO		5622991	173887
1	Pensijų įmokos		1684708	0
2	Iš kitų pensijų fondų pervestos sumos		3726403	172478
3	Kaupimo bendrovės garantinės įmokos			
4	Palūkanos ir dividendai		23010	251
5	Investicijų pardavimo pelnas		8604	0
6	Investicijų vertės padidėjimo suma		156358	1128
7	Turto vertės padidėjimas dėl užsienio valiutų kursų pasikeitimo		22493	30
8	Kitos pajamos		1415	0
III.	SUMAŽĖJIMAS, IŠ VISO		483638	552
1	Pensijų išmokos		0	0
2	Iš kitų pensijų fondų pervestos sumos		39709	0
3	Investicijų pardavimo nuostoliai		70877	0
4	Investicijų vertės sumažėjimo suma		290675	170
5	Turto vertės sumažėjimas dėl užsienio valiutų kursų pasikeitimo		17551	329
6	Valdymo sąnaudos		64826	53
7	Kitos sąnaudos			
IV.	GRYŪNIEJI AKTYVAI ATASKAITINIO LAIKOTARPIO PABAIGOJE		5312688	173335

		Ataskaitinio laikotarpio pabaigoje	Praėjęs ataskaitinis laikotarpis	Prieš dvejus metus
V.	APSKAITOS VIENETO VERTĖ	0.9681	1.0051	
VI.	APSKAITOS VIENETŲ SKAIČIUS	5487495.373	172460.353	

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

1. BENDROJI DALIS

Valstybinio socialinio draudimo įmokos dalies kaupimo pensijų fondas „Pensija 4“ (toliau – pensijų fondas) buvo įsteigtas 2005 m. gruodžio 19 d. Pensijų fondo veikla neterminuota.

Kaupimo bendrovė - UAB „Hansa investicijų valdymas“, įmonės kodas 124815377, adresas Justiniškių g. 64, Vilnius.

Depozitoriumas, kuris saugo pensijų fondo turtą – AB bankas “Hansabankas”, adresas Savanorių pr.19, Vilnius, įmonės kodas 1120 29651.

Audito įmonė – UAB “Deloitte Lietuva”, adresas Jogailos g. 4, Vilnius, įmonės kodas 111525235

2. INVESTAVIMO IR RIZIKOS VALDYMO POLITIKOS

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 grynųjų 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, 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 priemones 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.

3. 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 (“Lt”).

Žemiau pateikti pagrindiniai apskaitos principai.

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 mokesťį, vykdant pensijų išmokas ar pervedant sumas į kitus pensijų fondus. Turto sumažėjimą lemia investicijų pardavimo nuostoliai, investicijų vertės sumažėjimas bei neigiami valiutų kursų pokyčiai.

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

Investicijų įvertinimo metodai:

- vertybiniai popieriai, kuriais prekiaujama reguliuojamose rinkose, vertinami rinkos verte;
- vertybiniai popieriai, kuriais neprekaujama reguliuojamose rinkose, vertinami vadovaujantis valdymo įmonės valdybos patvirtintomis grynųjų aktyvų skaičiavimo procedūromis;
- terminuoti indėliai bankuose vertinami pagal amortizuotos savikainos verte;
- gryniesiems pinigams ir lėšoms 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 pridėamos susidariusios pajamos;
- kolektyvinio investavimo subjektų vienetai (akcijos) vertinami pagal paskutinę viešai paskelbtą išpirkimo kainą;
- aktyvai denominuoti užsienio valiuta vertinami taip pat, kaip aktyvai, denominuoti Lietuvos Respublikos valiuta. Tokiu būdu nustatyta vertė, išreikšta užsienio valiuta, Lietuvos Respublikos valiuta išreiškiama vėliausia valiutų supirkimo verte, kurią nustato Pensijų fondo depozitoriumas. Jei vertinimo metu Pensijų fondo depozitoriumas nėra nustatęs tam tikros valiutos kainos, vertinimas atliekamas pagal Lietuvos Banko nustatytą vėliausią kursą.

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

Apskaitos vieneto vertės nustatymo taisyklės - pensijų fondo grynųjų aktyvų vertė ir apskaitos vieneto vertė nustatoma kiekvieną darbo dieną. Kartą per mėnesį apskaičiuojama vidutinė praėjusio

mėnesio apskaitos vieneto vertė. Pensijų fondo gryniesi 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.

4. PASTABOS

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

(litas)

Balanso straipsniai	Pokytis						ataskaitinio laikotarpio pabaigoje
	praėjusio ataskaitinio laikotarpio pabaigoje	įsigyta	parduota (išpirkta)	sukauptos palūkanos	vertės padidėjimas	vertės sumažėjimas	
Skolos vertybiniai popieriai	33902	1692872	778063	8107	1010	42731	915097
<i>Vyriausybės ir centrinių bankų arba jų garantuoti skolos vertybiniai popieriai</i>	4924	0	4903	13	0	34	0
<i>Kiti skolos vertybiniai popieriai</i>	28978	1692872	773160	8094	1010	42697	915097
Nuosavybės vertybiniai popieriai	25008	806433	90712	0	62162	81174	721717
Kolektyvinio investavimo subjektų investiciniai vienetai ir akcijos	93807	4053613	964176	0	98220	203203	3078261
Kitos investicijos							
Iš viso	152717	6552918	1832951	8107	161392	327108	4715075

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

(litas)

Turto arba emitento pavadinimas	Valstybės, į kurios vertybinius popierius investuota, pavadinimas	Valiutos, kuria denominuotas turtas, pavadinimas	Nominali vertė (jeigu ji yra)	Metinė palūkanų norma % (jeigu ji yra)	Indelio, investicijos pabaigos terminas (jeigu ji terminuota)	Tikroji vertė	Turto, investicijos lyginamoji dalis (procentais)
Pinigai a/s HB*		LTL				434708	8.16%
Pinigai a/s HB*		EUR				172283	3.23%
Pinigai a/s HB*		USD				246	0.00%
Pinigai a/s HB*		EEK				2306	0.04%
Pinigai a/s HB*		SEK				1028	0.02%
Čekijos Vyriausybė	Čekija	CZK	18228	6.55%	2011.10.05	21568	0.40%
Austrijos Vyriausybė	Austrija	EUR	27622	5.00%	2012.07.15	30517	0.57%
Austrijos vyriausybė	Austrija	EUR	13811	3.50%	2021.09.15	13038	0.24%
Belgijos Vyriausybė	Belgija	EUR	172640	0.00%	2006.07.13	172519	3.24%
Vokietijos Vyriausybė	Vokietija	EUR	86320	2.25%	2007.09.14	86680	1.63%
Vokietijos Vyriausybė	Vokietija	EUR	10358	4.75%	2018.08.06	10782	0.20%
Vokietijos Vyriausybė	Vokietija	EUR	41434	3.50%	2009.10.09	42209	0.79%
Vokietijos Vyriausybė	Vokietija	EUR	24170	3.25%	2010.04.09	23913	0.45%
Ispanijos Vyriausybė	Ispanija	EUR	17264	4.20%	2037.01.31	17050	0.32%
Prancūzijos Vyriausybė	Prancūzija	EUR	69056	3.50%	2009.01.12	69933	1.31%
Graikijos Vyriausybė	Graikija	EUR	34528	6.50%	2014.01.11	40616	0.76%
Italijos Vyriausybė	Italija	EUR	20717	8.93%	2023.11.01	32114	0.60%
Italijos Vyriausybė	Italija	EUR	31075	5.16%	2011.08.01	33600	0.63%
Italijos Vyriausybė	Italija	EUR	6906	3.75%	2015.08.01	6754	0.13%
Portugalijos Vyriausybė	Portugalija	EUR	51792	0.00%	2006.11.17	51215	0.96%
Vengrijos Vyriausybė	Vengrija	HUF	21494	6.75%	2013.02.12	20512	0.39%
Vengrijos Vyriausybė	Vengrija	HUF	27512	5.50%	2016.02.12	23702	0.45%
Vengrijos Vyriausybė	Vengrija	HUF	14738	7.25%	2008.04.24	14725	0.28%
Lenkijos Vyriausybė	Lenkija	PLN	54304	6.00%	2009.05.24	55276	1.04%
Lenkijos Vyriausybė	Lenkija	PLN	29698	6.00%	2010.11.24	31395	0.59%
Lenkijos Vyriausybė	Lenkija	PLN	28001	6.25%	2015.10.24	30331	0.57%
Slovakijos Vyriausybė	Slovakija	SKK	35918	4.90%	2014.02.11	36354	0.68%
European Investment Bank	Turkija	TRY	49694	14.50%	2011.06.08	50295	0.94%
Snaigė	Lietuva	LTL				19447	0.37%
TEO LT	Lietuva	LTL				35682	0.67%
Tallinna Vesi	Estija	EEK				34161	0.64%
SAF TEHNIKA	Latvija	LVL				27385	0.51%
MOL	Vengrija	HUF				26265	0.49%
PLIVA	Kroatija	USD				42441	0.80%
OTP	Vengrija	HUF				57140	1.07%
NORMA	Estija	EEK				24600	0.46%
Swedbank	Švedija	SEK				30463	0.57%
Raiffeisen Int.	Liuksemburgas	EUR				53688	1.01%
Tallink Group	Estija	EEK				16023	0.30%
PKN	Lenkija	PLN				38810	0.73%
CETVUS	Kroatija	USD				33400	0.63%
CEZCZK	Čekija	CZK				53129	1.00%
PEKAO	Lenkija	PLN				38530	0.72%
ERSB	Vokietija	EUR				47856	0.90%
PROKOM	Lenkija	PLN				19386	0.36%
SOFT	Lenkija	PLN				12405	0.23%
Gazprom	Rusija	USD				17364	0.33%
EESRGDR	Rusija	USD				9621	0.18%
OMVV	Austrija	EUR				64452	1.21%
Lukoil	Rusija	USD				19469	0.37%
BALZACEI	Prancūzija	EUR				755840	14.19%

BALZACCAN	Prancūzija	CAD				22322	0.42%
BALZACUSA	Prancūzija	USD				598447	11.24%
BALZACJPN	Prancūzija	JPY				219443	4.12%
TRPGEMI	Liuksemburgas	USD				200684	3.77%
HVAFEUR	Estija	EUR				235694	4.43%
HANSAIEVF	Estija	EUR				70067	1.32%
HIEAFEUR	Estija	EUR				222429	4.18%
JMBECCB	Liuksemburgas	EUR				74282	1.39%
TRPEURBD	Liuksemburgas	EUR				86840	1.63%
BALZACAUS	Prancūzija	AUD				55236	1.04%
TRPFEM	Liuksemburgas	USD				87669	1.65%
ABNAFDEMB	Liuksemburgas	EUR				26141	0.49%
YBMBGBHYB	Liuksemburgas	EUR				67187	1.26%
TRPGE	Liuksemburgas	USD				355980	6.68%
Iš viso	X	X	X	X	X	5325646	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		38
Dalyvių skaičius ataskaitinio laikotarpio pabaigoje	dalyviai, pasinaudoję teise nukelti pensijų išmokos mokėjimą	-
	dalyviai, gaunantys periodines pensijų išmokas	-
	kiti dalyviai	-
	Iš viso	19381
Dalyvių skaičiaus pokytis		19343

26. Per ataskaitinį laikotarpį prisijungusių dalyvių skaičius:

Bendras prisijungusių dalyvių skaičius		19444
Dalyviai, pensijų kaupimo sutartis sudarę pirmą kartą		16576
Iš kitų pensijų fondų atėję dalyviai	iš tos pačios pensijų kaupimo bendrovės	2868
	iš kitos pensijų kaupimo bendrovės	-

27. Per ataskaitinį laikotarpį pasitraukusių dalyvių skaičius:

Bendras pasitraukusių dalyvių skaičius		101
Į kitus pensijų fondus išėjusių dalyvių skaičius	valdomus tos pačios pensijų kaupimo bendrovės	26
	valdomus kitos pensijų kaupimo bendrovės	-
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)	-
	dalyvių, pasinaudojusių Pensijų kaupimo įstatymo suteikta galimybe vienašališkai nutraukti pirmą kartą sudarytą sutartį	75
	mirusių dalyvių	-

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	15428	3703	250	0	19381
	vyrų	8167	1888	136	0	10191
	moterys	7261	1815	114	0	9190
Dalyvių dalis, %	iš viso	80	19	1	0	100
	vyrų	42.14	9.74	0.70	0.00	52.58
	moterys	37.46	9.36	0.59	0.00	47.42

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		5411111
Periodinės įmokos į pensijų fondą	iš Valstybinio socialinio draudimo fondo	1684708
	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 delpinigiaai		-
Iš garantijų rezervo sumokėtos lėšos		-
Iš kitų pensijų fondų pervedtos lėšos	iš tos pačios pensijų kaupimo bendrovės	3726403
	iš kitos pensijų kaupimo bendrovės	-
Kitos gautos lėšos (nurodyti šaltinį ir gautų lėšų sumą), iš viso		-

30. Išmokėtos lėšos:

Bendra išmokėtų lėšų suma		39709
Pensijų išmokos	vienkartinės išmokos dalyviams	-
	periodinės išmokos dalyviams	-
	išmokos anuiteto įsigijimui	-
Į kitus pensijų fondus pervedtos lėšos	valdomas tos pačios pensijų kaupimo bendrovės	39709
	valdomas kitos pensijų kaupimo bendrovės	-
Išstojusiems dalyviams išmokėtos lėšos (pildoma tik papildomo savanoriško kaupimo pensijų fondų atveju)		-
Paveldėtojams išmokėtos lėšos		-
Kitais pagrindais išmokėtos lėšos (nurodyti šaltinį ir gautų lėšų sumą), iš viso		-

IX. INFORMACIJA APIE GARANTIJŲ REZERVĄ

31. Jei pensijų fondo taisyklėse numatytas išsipareigojimas garantuoti tam tikrą pajamingumą, nurodyti garantuojamo pajamingumo dydį, per ataskaitinį laikotarpį į garantinį rezervą įmokėtų įmokų sumą, pateikti jo investicijų portfelį, jei buvo panaudotas, nurodyti panaudojimo priežastis, panaudotą sumą, rezervo dydį ataskaitinio laikotarpio pabaigoje ir kitą svarbią informaciją -.

X. INFORMACIJA APIE PENSIJŲ FONDO REIKMĖMS PASISKOLINTAS LĖŠAS

32. Pensijų fondo reikmėms pasiskolintos lėšos ataskaitinio laikotarpio pabaigoje:

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

XI. 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 rengę 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"
Fondo valdytojos asistentė _____ V.Juozapėnaitė

UAB "Hansa investicijų valdymas"
Apskaitininkas _____ T.Kivaras