

PENSIJŲ FONDO ATASKAITA
Pateikta – 2008-09-01

I. Bendroji dalis

1. Pensijų fondo pavadinimas: Valstybinio socialinio draudimo įmokos dalies kaupimo pensijų fondas "ERGO Balans" veikiantis pagal pensijų fondo taisykles Nr. 007.

2. Draudimo įmonė: UAB "ERGO Lietuva gyvybės draudimas" (į. k. 110707135), veikianti adresu Geležinio vilko 6A, LT-03507 Vilnius, tel. 2683021, faks. 2683025, el. paštas: info-life@ergo.lt, interneto svetainė www.ergo.lt, draudimo veiklos leidimas išduotas Draudimo reikalų tarybos posėdžio, įvykusio 1995 m. gegužės 15 d. nutarimu (protokolo Nr.58). Asmenys priimančys investicinius sprendimus: Ege Metsandi ("ERGO Varahalduse AS" valdybos narys) ir Alo Alunurm ("ERGO Varahalduse AS" valdybos narys).

3. Už ataskaitas atsakingi draudimo įmonės darbuotojai:

Įmonės generalinis direktorius - Darius Kremensas, tel. 2683011, el. paštas darius.kremensas@ergo.lt

Vyr. buhalterė - Jūratė Muckienė, tel. 2683026, el. paštas jurate.muckiene@ergo.lt

Vadovė – vyr. buhalterės pavaduotoja Kristina Gerčienė, tel. 2683027, el. paštas kristina.gerciene@ergo.lt

Vyr. ekspertas – Valerijus Cvetkovas, tel. 2683057, el. paštas valerijus.cvetkovas@ergo.lt

4. Depozitoriumas: AB bankas "Hansabankas" (į.k. 112029651), kurio buveinė Savanorių pr. 19, LT-03502 Vilnius, tel. 2684299, faks. 2684170

5. Pensijų fondo turto valdymas – turto investavimas; duomenų reikalingų apskaitos ruošimui teikimas; grynosios aktyvų vertės nustatymas; apskaitos vieneto vertės nustatymas pavestas investicijų valdymo įmonei "ERGO Varahalduse AS", registracijos kodas 10863860, adresas Lauteri 5, Talinas, Estija. Pavedimo pagrindas – pavedimo sutartis.

6. Vertybinių popierių tvarkymo sutartis sudaryta su AB bankas "Hansabankas" (į.k. 112029651, banko licenzija Nr. 11, Lietuvos centrinio depozitoriumo kodas Nr. 976, adresas Savanorių pr. 19, LT-03502 Vilnius, tel. 2684514, faks. 2684869).

7. Ataskaitinis laikotarpis: nuo 2008 metų sausio 1 dienos iki 2008 metų balandžio 30 dienos.

II. Gryųjų aktyvų, apskaitos vienetų skaičiaus ir vertės pokyčiai

8. Gryųjų aktyvų, apskaitos vienetų skaičiaus ir vertės pokyčiai:

	Ataskaitinio laikotarpio pradžioje (2008-01-01)	Ataskaitinio laikotarpio pabaigoje (2008-06-30)	Prieš metus (2007-06-30)	Prieš dvejus metus (2006-06-30)
GAV, Lt	29526793,79	36246135,85	22995053,41	10692570,88
Apskaitos vieneto vertė, Lt	1,3577	1,2611	1,3811	1,2003
Apskaitos vienetų skaičius	21747703,0711	28741977,6164	16650345,8228	8908201,0501

III. Atskaitymai iš pensijų turto:

9. Atskaitymai iš pensijų turto:

9.1. atskaitymai iš pensijų fondo pensijų turto, pateikiant atskirai sumas, jeigu per ataskaitinį laikotarpį keitėsi mokesčio dydis arba buvo taikytas skirtingas mokestis nuo įmokų atskirų dalyvių grupėms:

Atskaitymai	Atskaitymų dydžiai		Priskaičiuota atskaitymų suma per ataskaitinį laikotarpį
	Maksimalūs numatyti taisyklėse	Faktiškai taikyti	
Nuo įmokų	10%	5%	476.835,92
Nuo turto vertės	1%	1%	151.211,19
Keitimo mokesčiai:			
Fondo keitimas toje pačioje bendrovėje daugiau kaip kartą per metus	4%	-	-
Pensijų kaupimo bendrovės keitimas kartą per metus	0,2%	0,2%	966,49
Pensijų kaupimo bendrovės keitimas daugiau kaip kartą per metus	4%	-	-
Iš viso:			629.013,60
PAR (portfelio apyvartumo rodiklis)			-

9.2. papildoma informacija jei yra skaičiuojamas tikėtinas bendrasis išlaidų koeficientas.

-

10. Pavyzdys apie mokesčių įtaką galutinei dalyviui tenkančiai investicinei grąžai

-

IV. Informacija apie pensijų fondo investicinį portfelį

11. Investicijų portfelio sudėtis

Emitento pavadinimas	Šalis	ISIN kodas	Kiekis, vnt.	Bendra nominali vertė, Lt	Bendra įsigijimo vertė, Lt	Bendra rinkos vertė, Lt	Rinka, pagal kurios duomenis nustatyta rinkos vertė (tinklalapio adresas)	Balsų dalis emitente, %	Dalis GA, %
Nuosavybės vertybiniai popieriai, įtraukti į Oficialųjį prekybos sąrašą									
Iš viso:									
Nuosavybės vertybiniai popieriai, įtraukti į Einamąjį prekybos sąrašą									
Trigon Agri	Danija	DK0060083566	150600	519991,68	793311,88	764387,77	www.omxnordicexchange.com		2,11
Merko	Estija	EE3100003559	11500	25377,05	366248,89	337511,20	www.ee.omxgroup.com/		0,93
Eesti Ehitus AS	Estija	EE3100039496	27000	59580,90	363579,84	321628,32	www.ee.omxgroup.com/		0,89
Richter Gedeon	Vengrija	HU0000067624	750	10867,50	345896,35	351074,59	www.bse.hu		0,97
MATAV	Vengrija	HU0000073507	32900	47672,10	370528,05	347529,61	www.bse.hu		0,96
AMBRA	Lenkija	PLAMBRA00013	81516	83533,52	641791,41	357523,47	www.wse.com.pl		0,99
Grupa Lotos	Lenkija	PLLOTOS00025	12980	13301,26	555278,45	352483,26	www.wse.com.pl		0,97
PKN Orlen	Lenkija	PLPKN0000018	14333	18359,68	585847,77	501439,50	www.wse.com.pl		1,38
Black Earth Farming LTD-SDR	Švedija	SE0001882291	13000		302831,39	218022,82	www.omxgroup.com/stockholmsborsern		0,60

Sberbank GDR	Rusija	US80529Q2057	300		283302,24	240211,30	www.deutsche-boerse.com/		0,66
Iš viso:			344879	778683,68	4608616,27	3791811,84			10,46
Nuosavybės vertybiniai popieriai kuriais prekiaujama reguliuojamose rinkose, kurios specializuojasi mažų ir vidutinių įmonių srityje									
Iš viso:									
Nuosavybės vertybiniai popieriai kuriais prekiaujama kitose reguliuojamose rinkose									
Iš viso:									
Išleidžiami nauji nuosavybės vertybiniai popieriai									
Iš viso:									
Iš viso nuosavybės vertybinių popierių:			344879	778683,68	4608616,27	3791811,84			10,46

Emitento pavadinimas	Šalis	ISIN kodas	Kiekis, vnt.	Bendra nominali vertė, Lt	Bendra įsigijimo vertė, Lt	Bendra rinkos vertė, Lt	Palūkanų norma, %	Išpirkimo data	Dalis GA, %
Skolos vertybiniai popieriai, įtraukti į Oficialųjį prekybos sąrašą									
Iš viso:									
Skolos vertybiniai popieriai, įtraukti į Einamąjį prekybos sąrašą									
AB Lietuvos Energija	Lietuva	LT1000403311	600	207168,00	207260,19	209722,27	4,060	2009-09-29	0,58
DNB NORD	Lietuva	LT0000401473	2000	200000,00	200000,00	207058,21	5,050	2008-10-08	0,57
DNB NORD	Lietuva	LT0000401507	3500	350000,00	349685,00	358084,60	6,250	2009-02-13	0,99
DNB NORD	Lietuva	LT0000401523	3000	300000,00	299850,00	303762,69	5,900	2009-03-26	0,84
DNB NORD	Lietuva	LT0000403388	1635	163500,00	163440,98	164574,26	4,330	2009-09-26	0,45
Iš viso:			10735		1220236,17	1243202,03			3,43
Skolos vertybiniai popieriai, kuriais prekiaujama kitose reguliuojamose rinkose									
BACR	Didžioji Britanija	XS0323856210	6	1035840,00	1036047,17	1006319,25	4,710	2019-09-30	2,78
BHH bankas	Vokietija	DE000A0NKTC6	100	345280,00	343726,24	327031,66	4,125	2017-03-28	0,90
BHP Billiton	Australija	XS0252824858	100	345280,00	344262,56	332735,21	4,125	2011-05-05	0,92
Bulgarijos Respublikos Vyriausybė	Bulgarija	XS0145624432	51	176092,80	212909,38	193003,59	7,500	2013-01-15	0,53
Bundesimmobilien Gesellschaft mbH	Austrija	XS0155106171	170	586976,00	610882,39	593525,72	4,625	2012-09-27	1,64
CAISSE REF. HYPOTHEK	Prancūzija	FR0010261495	200000	690560,00	666348,62	611910,32	3,500	2017-04-25	1,69
CBRD bankas	Kroatija	XS0305384124	109	376355,20	374559,99	348687,55	5,000	2017-06-14	0,96
CEZ AS	Čekija	XS0271020850	1	172640,00	171274,42	164947,21	4,125	2013-10-17	0,46
Čekijos Respublikos Vyriausybė	Čekija	XS0194957527	93	321110,40	326742,09	313199,52	4,625	2014-06-23	0,86
Čekijos Respublikos Vyriausybė	Čekija	XS0368800073	260	897728,00	896543,00	881877,48	5,000	2018-06-11	2,43
Deutsche Genoss.-Hypothekenbank AG	Vokietija	DE0002366523	200	690560,00	734220,00	703738,49	5,500	2010-04-01	1,94
EESTI ENERGIA	Estija	XS0235372140	9	31075,20	30823,42	28926,71	4,500	2020-11-18	0,08
Eksportfinans A/S	Norvegija	XS0359632949	300	1035840,00	1033602,59	1017006,57	4,375	2011-04-26	2,81
Eksportfinans A/S	Norvegija	XS0369494223	80	276224,00	275022,43	270182,22	4,750	2013-06-11	0,75
ERAP (su Prancūzijos vyriausybės garantija)	Prancūzija	FR0000474413	120	414336,00	410113,74	408820,39	3,750	2010-04-25	1,13
EUROHYPO SA	Liuksemburgas	XS0169781753	200	690560,00	719506,27	647996,83	4,250	2018-06-04	1,79
Europos investicijų bankas	Liuksemburgas	XS0170558877	103	355638,40	366108,63	342802,55	3,625	2013-10-15	0,95
Europos investicijų bankas	Liuksemburgas	XS0330805069	320	1104896,00	1135816,07	1090957,29	4,250	2014-10-15	3,01
Kipro Vyriausybė	Kipras	XS0143546207	300	1035840,00	1108978,83	1061181,70	5,500	2012-02-27	2,93
Kroatijos Respublikos Vyriausybė	Kroatija	XS0190291582	29	100131,20	110256,05	97697,45	5,000	2014-04-15	0,27
Landwirtschaftliche Rentenbank (su Vokietijos vyriausybės garantija)	Vokietija	DE0002942455	60	207168,00	222911,49	207179,52	4,125	2009-04-30	0,57

Latvijos Respublikos Vyriausybė	Latvija	LV0000570059	1510	741153,30	746203,98	741232,52	5,000	2011-11-03	2,04
Latvijos Respublikos Vyriausybė	Latvija	XS0138886689	18	62150,40	68683,86	64136,18	5,375	2008-11-27	0,18
Latvijos Respublikos Vyriausybė	Latvija	XS0189713992	110	379808,00	397539,06	355222,56	4,250	2014-04-02	0,98
Lenkijos Respublikos Vyriausybė	Lenkija	DE0006101652	48	165734,40	193388,18	170253,72	5,500	2011-02-14	0,47
Lenkijos Respublikos Vyriausybė	Lenkija	XS0162316490	30	103584,00	105898,11	101850,04	4,500	2013-02-05	0,28
Lenkijos Respublikos Vyriausybė	Lenkija	XS0183959914	30	103584,00	104702,78	104894,21	3,875	2009-01-15	0,29
Lietuvos Respublikos Vyriausybė	Lietuva	XS0212170939	105	362544,00	356013,52	326272,28	3,750	2016-02-10	0,90
Lietuvos Respublikos Vyriausybė	Lietuva	XS0327304001	30	103584,00	105253,95	99673,09	4,850	2018-02-07	0,27
OEBB Infrastruktur Bau AG (su Austrijos vyriasybės garantija)	Austrija	XS0271660242	30	103584,00	103076,51	98993,35	3,875	2016-10-18	0,27
Olandijos Vyriausybė	Olandija	NL0000102192	64150	221497,12	281584,75	235417,48	7,500	2010-04-15	0,65
Olandijos Vyriausybė	Olandija	NL0000102606	11000	37980,80	40598,07	40056,97	5,000	2011-07-15	0,11
Pfandbrief Bank International S.A.	Liuksemburgas	XS0191842771	300	1035840,00	1041476,28	1043220,62	4,905	2009-05-11	2,88
Romanian Commercial Bank S.A.	Rumunija	XS0236777339	100	345280,00	349998,98	349660,39	3,750	2008-12-05	0,96
Siemens	Olandija	XS0131224155	80	276224,00	289746,30	293527,44	5,750	2011-07-04	0,81
Slovakijos Respublikos Vyriausybė	Slovakija	XS0192595873	90	310752,00	301521,22	302498,44	4,500	2014-05-20	0,83
Slovakijos Respublikos Vyriausybė	Slovakija	XS0299989813	38	131206,40	130455,55	124414,36	4,375	2017-05-15	0,34
Tallinna Sadam	Estija	EE3300081058	220	759616,00	771847,92	769804,09	5,075	2009-03-17	2,12
Tesco PLC	Didžioji Britanija	XS0159012847	40	138112,00	142482,34	137917,61	4,750	2010-04-13	0,38
Tiuringijos žemė	Vokietija	DE000A0NKNC9	150	517920,00	513146,33	488412,62	4,000	2017-03-15	1,35
Vengrijos Respublikos Vyriausybė	Vengrija	XS0307199215	1	172640,00	172543,32	165877,25	4,875	2012-06-21	0,46
Vengrijos Respublikos Vyriausybė	Vengrija	XS0369470397	170	586976,00	584275,91	581290,49	5,750	2018-06-11	1,60
Vokietijos Respublikos Vyriausybė	Vokietija	DE0001135101	1900000	65603,20	67805,33	66580,25	3,750	2009-01-04	0,18
Vokietijos Respublikos Vyriausybė	Vokietija	DE0001135218	2780000	95987,84	103200,34	97350,08	4,500	2013-01-04	0,27
Vokietijos Respublikos Vyriausybė	Vokietija	DE0001141455	2200000	75961,60	76850,32	76805,74	3,500	2009-10-09	0,21
VTB Capital	Liuksemburgas	XS0372322460	100	345280,00	345625,28	345791,20	8,250	2011-06-30	0,95
Zagrebacki Holding D.O.O.	Kroatija	XS0309688918	3	517920,00	519587,25	487029,77	5,500	2017-07-10	1,34
Iš viso:			7160964		19044160,81	18317909,98			50,54
Išleidžiami nauji skolos vertybiniai popieriai									
Iš viso:									
Iš viso skolos vertybinių popierių:			7171699		20264396,98	19561112,01			53,97

KIS pavadinimas	Šalis	ISIN kodas	Kiekis, vnt.	Valdytojas	Bendra įsigijimo vertė, Lt	Bendra rinkos vertė, Lt	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 Russian Equity Fund E-unit	Estija	EE3600073318	6660,47		566274,74	565863,49	www.hansa.ee		1,56
Trigon New Europe Small Cap Fund	Estija	EE3600075883	22910,549		674887,97	528816,62	www.trigon.ee		1,46
LHV Persian Gulf Fund	Estija	EE3600095295	14716,226		345273,52	344868,25	www.trigon.ee		0,95
EVLI Greater Russia B	Suomija	FI0008807565	740,404		690560,00	744259,10	www.evli.com		2,05
EVLI Ruble Debt B	Suomija	FI0008809413	2186,726		888839,66	901478,91	www.evli.com		2,49
Balzac Euro Index-P	Prancūzija	FR0000018087	286		213389,05	231954,06	www.ssga.com		0,64
State Street Europe Actions	Prancūzija	FR0000027369	124		212733,50	214677,29	www.ssga.com		0,59
State Street Midcap Europe	Prancūzija	FR0000988438	173		182264,65	207740,96	www.ssga.com		0,57
ISHARES PLC-IFTSE 100	Airija	IE0005042456	6500		207150,74	160356,66	www.ariva.de		0,44
ISHARES DJ STOXX 50	Airija	IE0008470928	500		63617,84	50220,98	www.ariva.de		0,14
Carnegie European Equity Sub-Fund	Liuksemburgas	LU0093943974	22042		1381120,00	1368396,98	www.carnegie.com		3,78
East Capital Turkish Fund	Švedija	SE0001621327	189979		546701,00	423888,44	www.eastcapital.com		1,17
Asia Pacific Fund INC	JAV	US0449011065	8800		572418,49	346918,76	www.ariva.de		0,96
ISHARES MSCI JAPAN INDEX FUND	JAV	US4642868487	20558		761506,04	562398,75	www.ariva.de		1,55
ISHARES S&P500/BARRA GROWTH	JAV	US4642873099	7336		1253270,02	1027261,94	www.barra.com		2,83
Ishares S&P Latin America 40	JAV	US4642873909	2125		1180475,00	1282001,88	www.ariva.de		3,54
Iš viso:					9740482,22	8961103,07			24,72
Kitų kolektyvinio investavimo subjektų vienetai (akcijos)									
Iš viso:									
Iš viso KIS vienetų (akcijų):					9740482,22	8961103,07			24,72

Priemonės pavadinimas	Emitentas	Šalis	Kita sandorio šalis	Valiuta	Investicinis sandoris (pozicija)	Sandorio (pozicijos) vertė	Bendra rinkos vertė	Rinkos pavadinimas (tinklalapio adresas)	Galiojimo terminas	Dalis GA, %
Išvestinės investicinės priemonės, kuriomis prekiaujama reguliuojamose rinkose										
Iš viso:										
Kitos išvestinės investicinės priemonės										
Valiutos apsiskeitimo sandoris USD/EUR	AB bankas „Hansabankas“	Lietuva	AB bankas „Hansabankas“	EUR			-11893,33		2008-07-23	-0,03
Valiutos apsiskeitimo sandoris GBP/EUR	AB bankas „Hansabankas“	Lietuva	AB bankas „Hansabankas“	EUR			-32,34		2008-07-08	0,00
Iš viso:							-11925,67			-0,03
Iš viso išvestinės investicinės priemonės							-11925,67			-0,03

Banko pavadinimas	Valiuta	Bendra rinkos vertė, Lt	Palūkanų norma, %	Dalis GA, %
Pinigai				
AB bankas "Hansabankas"	LTL	2505868,54		6,91
AB bankas "Hansabankas"	EUR	28544,71		0,08
AB bankas "Hansabankas"	USD	0,09		0,00
AB bankas "Hansabankas"	EEK	17874,27		0,05
Iš viso pinigų:		2552287,61		7,04

Kredito įstaigos pavadinimas	Šalis	Valiuta	Bendra rinkos vertė	Palūkanų norma	Indėlio termino pabaiga	Dalis GA, %
Indėliai kredito įstaigose						
SEB bankas	Lietuva	LTL	1403710,00	5,300	2008-12-15	3,87
Iš viso indėlių kredito įstaigose			1403710,00			3,87

Pavadinimas	Trumpas apibūdinimas	Bendra vertė	Paskirtis	Dalis GA (%)
Kitos priemonės				
Gautini dividendai	Ishares S&P Latin America 40 dividendai	8631,50		0,02
Gautini dividendai	Ishares S&P500/BARRA GROWTH dividendai	1934,64		0,01
Gautini dividendai	Sberbank GDR dividendai	1199,34		0,00
Gautini dividendai	ISHARES MSCI JAPAN INDEX FUND dividendai	1879,37		0,01
Gautini dividendai	ISHARES PLC-IFTSE 100 dividendai	1793,21		0,01
Iš viso:		15438,06		0,04

12. Investicijų paskirstymas pagal investavimo strategiją atspindinčius kriterijus:

12.1. Investicijų paskirstymas pagal valiutas ir geografinę zoną:

Investicijų paskirstymas	Ataskaitinio laikotarpio pabaigoje		Ataskaitinio laikotarpio pradžioje	
	Rinkos vertė, Lt	Dalis aktyvuose, %	Rinkos vertė, Lt	Dalis aktyvuose, %
Pagal valiutas				
LTL	4.943.058,30	14	2.925.175,68	10
EUR	24.442.315,62	67	19.570.011,43	66
USD	3.232.226,27	9	3.767.728,46	13
Kita valiuta	3.655.936,73	10	3.280.596,11	11
Iš viso:	36.273.536,92	100	29.543.511,68	100
Pagal geografinę zoną				
Lietuva	5.628.657,40	16	3.344.077,60	11
Kitos Europos Sąjungos valstybės	24.632.748,12	68	21.245.502,84	72
Kitos Europos ekonominės erdvės valstybės	1.287.188,79	4	0	0
Kitos Europos valstybės	1.173.626,07	3	977.624,94	3
Jungtinės Amerikos Valstijos	3.218.581,33	9	3.632.520,63	12
Australija	332.735,21	1	343.785,67	1
Iš viso:	36.273.536,92	100	29.543.511,68	100

12.2. pagal investavimo strategiją atspindinčius kriterijus.

Investicijų paskirstymas	Ataskaitinio laikotarpio pabaigoje		Ataskaitinio laikotarpio pradžioje	
	Rinkos vertė, Lt	Dalis aktyvuose, %	Rinkos vertė, Lt	Dalis aktyvuose, %
Pagal investavimo objektus:				
Skolos vertybiniai popieriai	19.561.112,01	54	15.702.335,77	53
Nuosavybės vertybiniai popieriai	3.791.811,84	10	4.009.692,87	14
Kolektyviniai investavimo subjektai	8.961.103,07	25	7.860.785,34	27
Išvestinės priemonės	-11.925,67	0	111.846,90	0
Pinigai ir gautinos sumos	2.567.725,67	7	157.456,36	1
Indėliai	1.403.710,00	4	1.701.394,44	6
Iš viso:	36.273.536,92	100	29.543.511,68	100

13. 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, sandorius reguliuojamose rinkose ir šalių tarpusavio sandorius bei kitą svarbią informaciją).

-

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

Valiutos kurso svyravimų rizikos valdymo tikslais buvo sudaryti Didžiosios Britanijos svarų (GBP) ir JAV dolerių (USD) apsisikeitimo į eurus sandoriai. Atsižvelgiant į investicines priemones, kurios yra nominuotos GBP ir USD, buvo nupirkti Didžiosios Britanijos svarai ir JAV doleriai ir sudaryti išankstiniai sandoriai juos parduoti sutartu laiku už sutartą kainą. Jei apsisikeitimo sandorio pabaigoje parduodama įsigyta investicinė priemonė, tai gautus GBP ir USD galima panaudoti apsisikeitimo sandorio įsipareigojimų įvykdymui. Nepardavus investicinės priemonės, gali būti sudarytas naujas apsisikeitimo sandoris, pratęsiantis pirmąjį. Rizikos, susijusios su išvestinio sandorio sudarymu: 1) jei investicinės priemonės vertė sumažėtų, tai įsipareigojimų vykdymo momentu reiktų papildomai įsigyti GBP ar USD tuo metu galiojančia rinkos kaina; 2) apsisikeitimo sandorio kita šalis atsisako vykdyti prisiimtus įsipareigojimus (neatperka valiutos sutarta kaina).

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

Valiutos apsisikeitimo sandorių rinkos vertė 2008-06-30 dieną yra -11.925,67 Lt.

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

Pensijų fondo portfelio lėšos yra investuotos laikantis diversifikavimo reikalavimų. Remiantis investavimo strategija į nuosavybės vertybinius popierius investuota daugiau kaip 10 proc. gryųjų aktyvų vertės, dar 22 proc. investuota į kolektyvinius investavimo subjektus, kurie investuoja į akcijas. Pensijų fondo taisyklėse numatyta, jog į akcijų rinkas galima investuoti ne daugiau kaip 50 proc. gryųjų aktyvų vertės (investuota – beveik 33 proc.).

Grynieji pinigai ir gautinos sumos sudaro 7 proc. grynujų aktyvų vertės, indėliai – 4 proc. grynujų aktyvų vertės. Į skolos vertybinius popierius buvo investuota 54 proc. grynujų aktyvų vertės, dar 2 proc. investuoti į kolektyvinį investavimo subjektą, kuris investuoja į skolos vertybinius popierius.

Pagal geografinį pasiskirstymą 16 proc. pensijų fondo lėšų investuota į Lietuvos VP, o didžiausia dalis (68 proc.) - į kitų Europos Sąjungos valstybių VP. Dar 4 proc. investuoti į Europos ekonominės erdvės valstybių VP, 3 proc. - į kitų Europos valstybių VP, 1 proc. į Australijos VP ir 9 proc. – į JAV kolektyvinio investavimo subjektus.

Pagal valiutas daugiausia investuota: 67 proc. eurais, 14 proc. litais ir 9 proc. JAV doleriais.

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

Pasirenkant fiksuoto pajamingumo vertybinius popierius, vadovautasi siūloma rinkoje palūkanų norma, vertybinio popieriaus išpirkimo laikotarpiu ir vertybinio popieriaus leidėjo finansiniu pajėgumu. Siekiant diversifikuoti investicijas, kaip to reikalauja įstatymai ir fondo taisyklės, pasirenkant investavimo instrumentus, buvo atsižvelgiama ir į įsigijimo sąnaudas, kurios padengiamos įmonės sąskaita.

Palūkanų normos rizika kontroliuojama keičiant investavimo laikotarpį. Ataskaitinio laikotarpio pabaigoje vidutinė investavimo trukmė buvo 3,1 m.

Investicijos į trumpesnio kaip 3 metų išpirkimo terminą turinčius skolos VP sudarė 37 proc., į 3-5 metų – 18 proc., į 5-7 metų – 14 proc., į 7-10 metų – 26 proc. ir į ilgesnio kaip 10 metų išpirkimo laikotarpio – 5 proc. visų skolos VP grynujų aktyvų vertės.

Investuojant į skolos vertybinius popierius yra atsižvelgiama ir į skolos VP reitingo laipsnį, kurį nustato keletas didžiausių reitingo agentūrų – Moody' s reitingo agentūra (Moody's Rating Agency), Standard&Poors reitingo agentūra (Standard&Poors Rating Agency) ir Fitch reitingo agentūra (Fitch Rating Agency). Pagal reitingo lygį 41 proc. investicijų yra investuota į aukščiausio tarpautinio kredito reitingo AAA lygio, 6 proc. – į AA lygio, 30 proc. į A lygio, 19 proc. – į BBB lygio ir 4 proc. į BB lygio skolos VP. Vidutinis skolos VP reitingo lygis pensijų fonde yra A.

Akcijų portfelį sudaro 10 Europos valstybių įmonių akcijos. Tikintis vertės augimo ilgalaikėje perspektyvoje ir saugantis galimo akcijų vertės kritimo vertybinių popierių biržoje, kiekvienos įmonės akcijų dalis neviršija 3 proc. pensijų fondo grynujų aktyvų vertės, kas rodo apie akcijų portfelio subalansavimą.

Iki ataskaitinio laikotarpio pabaigos investuota į 16 kolektyvinio investavimo fondų. Kiekvieno iš šių investavimo fondų dalis neviršija 4 proc. pensijų fondo grynujų aktyvų vertės.

2008 m. pradžioje JAV centrinis bankas kelis kartus sumažino bazinę palūkanų normą, Europos centrinis bankas palūkanų normos nekeitė. Ataskaitinio laikotarpio pabaigoje sumažėjo daugumos akcijų ir skolos vertybinių popierių kainos, kas įtakojo pensijų fondo apskaitos vieneto vertės kritimą.

V. Pensijų fondo investicijų grąža ir rizikos rodikliai

18. Orientacinis indeksas ir jo apibūdinimas

-

19. Pensijų fondo investicijų portfelio apskaitos vieneto vertės ir orientacinio indekso vertės pokyčiai.

-

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

-

21. Vidutinė investicijų graža ir orientacinio indekso reikšmės pokytis per paskutinius trejus, penkerius, dešimt metų (vidutinė grynoji investicijų graža apskaičiuojama kaip geometrinis metinių grynosios investicinių gražos vidurkis).

-

22. Kiti rodikliai, atskleidžiantys investicijų portfelio riziką. Atskleidžiant investicijų rizikos rodiklius, turi būti pateikiami jų paaiškinimai ir apskaičiavimo metodika. Tuo atveju, kai pensijų fondo investavimo strategija grindžiama indeksu, turi būti atskleidžiama indekso sekimo paklaida. Indekso sekimo paklaida - tam tikro periodo investicijų portfelio gražos ir orientacinio indekso reikšmės pokyčio skirtumo standartinis nuokrypis.

-

VI. Pensijų fondo finansinė būklė

23. Pensijų fondų finansinė atskaitomybė parengta, vadovaujantis Lietuvos Respublikos Vyriausybės 2004 m. sausio 13 d. nutarimu Nr. 30 patvirtinta Pensijų fondų buhalterinės apskaitos ir finansinės atskaitomybės sudarymo tvarka (Žin., 2004, Nr. 9-233):

23.1. balansas;

23.2. grynujų aktyvų pokyčių ataskaita

24. aiškinamasis raštas

UAB ERGO LIETUVA GYVYBĖS DRAUDIMAS

110707135 , Geležinio vilko 6 a , Vilnius

ERGO BALANS PENSIJŲ FONDAS

BALANSAS

PAGAL 2008 M. BIRŽELIO 30 D. DUOMENIS

Eil. Nr.	Turtas	Pastabų Nr.	Ataskaitinis laikotarpis	Praėjęs ataskaitinis laikotarpis
I.	PINIGAI IR PINIGŲ EKVIVALENTAI	1 pastaba	2.552.288	22.249
II.	TERMINUOTI INDĖLIAI		1.403.710	1.701.394
III.	INVESTICIJOS		32.314.027	27.572.814
1.	Skolos vertybiniai popieriai		19.561.112	15.702.336
1.1.	Vyriausybių ir centrinių bankų arba jų garantuoti skolos vertybiniai popieriai		8.698.226	8.086.039
1.2.	Kiti skolos vertybiniai popieriai		10.862.886	7.616.297
2.	Nuosavybės vertybiniai popieriai		3.791.812	4.009.693
3.	Kolektyvinio investavimo subjektų investiciniai vienetai ir akcijos		8.961.103	7.860.785
4.	Kitos investicijos			
IV.	GAUTINOS SUMOS		15.438	252.070
1.	Investicijų pardavimo sandorių gautinos sumos			
2.	Kitos gautinos sumos	2 pastaba	15.438	252.070
	TURTAS, IŠ VISO		36.285.463	29.548.527

Eil. Nr.	Įsipareigojimai ir gryniesi aktyvai	Pastabų Nr.	Ataskaitinis laikotarpis	Praėjęs ataskaitinis laikotarpis
V.	ĮSIPAREIGOJIMAI		39.327	21.733
1.	Investicijų pirkimo įsipareigojimai			
2.	Mokėtinos sumos kaupimo bendrovei ir depozitoriumui	3 pastaba	27.401	21.733
3.	Kitos mokėtinos sumos ir įsipareigojimai	4 pastaba	11.926	
VI.	GRYNIEJI AKTYVAI (I+II+III+IV-V)		36.246.136	29.526.794
	ĮSIPAREIGOJIMAI IR GRYNIEJI AKTYVAI, IŠ VISO		36.285.463	29.548.527

Gen.direktorius

Darius Kremensas

Vyr. buhalterė

Jūratė Muckienė

UAB ERGO LIETUVA GYVYBĖS DRAUDIMAS

110707135 , Geležinio vilko 6 a , Vilnius

ERGO BALANS PENSIJŲ FONDO GRYNŲJŲ AKTYVŲ POKYČIŲ ATASKAITA

PAGAL 2008 M. BIRŽELIO 30 D. DUOMENIS

Eil. Nr.	Straipsniai	Pastabų Nr.	Ataskaitinis laikotarpis	Praėjęs ataskaitinis laikotarpis
I.	GRYNIEJI AKTYVAI ATASKAITINIO LAIKOTARPIO PRADŽIOJE		29.526.796	15.923.895
II.	PADIDĖJIMAS, IŠ VISO		12.009.725	8.352.009
1.	Pensijų įmokos		9.536.465	5.699.316
2.	Iš kitų pensijų fondų pervestos sumos		505.870	758.951
3.	Kaupimo bendrovės garantinės įmokos			
4.	Palūkanos ir dividendai	5 pastaba	584.509	421.080
5.	Investicijų pardavimo pelnas		258.139	133.399
6.	Investicijų vertės padidėjimo suma		1.021.411	1.303.213
7.	Turto vertės padidėjimas dėl užsienio valiutų kursų pasikeitimo	6 pastaba	103.331	36.050
8.	Kitos pajamos			
III.	SUMAŽĖJIMAS		5.290.385	1.278.223
1.	Pensijų išmokos		12.368	5.105
2.	Iš kitų pensijų fondų pervestos sumos		535.128	305.350
3.	Investicijų pardavimo nuostoliai		673.985	8.221
4.	Investicijų vertės sumažėjimo suma		3.237.286	547.573
5.	Turto vertės sumažėjimas dėl užsienio valiutų kursų pasikeitimo	6 pastaba	202.604	35.533
6.	Valdymo sąnaudos		629.014	375.533
7.	Kitos sąnaudos			908
IV.	GRYNIEJI AKTYVAI ATASKAITINIO LAIKOTARPIO PABAIGOJE		36.246.136	22.997.681

		Ataskaitinio laikotarpio pabaigoje	Prieš metus	Prieš dvejus metus
V.	APSKAITOS VIENETO VERTĖ	1,2611	1,3811	1,2003
VI.	APSKAITOS VIENETŲ SKAIČIUS	28.741.977,6164	16.650.345,8228	8.908.201,0501

Gen.direktorius

Darius Kremensas

Vyr. buhalterė

Jūratė Muckienė

UAB ERGO LIETUVA GYVYBĖS DRAUDIMAS

110707135 , Geležinio vilko 6 a , Vilnius

ERGO BALANS PENSIJŲ FONDO PINIGŲ SRAUTŲ ATASKAITA

PAGAL 2008 M. BIRŽELIO 30 D. DUOMENIS

Gautos lėšos per ataskaitinį laikotarpį, iš viso		10.042.335	
	Periodinės įmokos į pensijų fondą iš Valstybinio socialinio draudimo fondo	9.536.465	
	Valstybinio socialinio draudimo fondo sumokėti delspinigiai		
	Draudimo įmonės pervestos lėšos		
	Iš kitų pensijų fondų pervestos lėšos, iš viso	505.870	
		Iš tos pačios pensijų kaupimo bendrovės	209.258
		Iš kitos pensijų kaupimo bendrovės	296.612
	Kitos gautos lėšos (šaltinis ir lėšų suma), iš viso	0	
		Gautos palūkanos	
		Vertės pokytis/ kurso įtaka	
	Išmokėtos lėšos per ataskaitinį laikotarpį, iš viso		547.496
	Pensijų išmokos, iš viso	12.368	
		Pensijų išmokos dalyviams ir jų paveldėtojams	12.368
		Periodinės išmokos dalyviams	
		Išmokos anuiteto įsigijimui	
	Iš kitus pensijų fondus pervestos lėšos, iš viso	535.128	
		Tos pačios pensijų kaupimo bendrovės	49.434
		Kitos pensijų kaupimo bendrovės	485.694
	Kitais pagrindais išmokėtos lėšos (šaltinis ir lėšų suma), iš viso	0	
		Depozitoriumo nuskaitytos lėšos	

Gen.direktorius

Darius Kremensas

Vyr. buhalterė

Jūratė Muckienė

AIŠKINAMASIS RAŠTAS

Prie 2008 birželio 30 d. pensijų fondo "ERGO Balans" balanso

I. Bendroji dalis

Pensijų fondo steigimo data: 2003 m. rugpjūčio 8 d.

Kaupimo bendrovė valdanti pensijų fondą: UAB "ERGO Lietuva gyvybės draudimas" (į.k. 110707135), veikianti adresu Geležinio vilko 6A, Vilnius)

Depozitoriumas: AB bankas "Hansabankas" (į.k. 112029651), kurio buveinė Savanorių pr. 19 Vilnius LT-03502. tel. 2684299, faks. 2684170

Audito įmonė: UAB "KPMG Lietuva" (į.k. 1149497), kurios buveinė Vytauto g. 12 Vilnius, tel. 2102600, fax. 2102659

II. Apskaitos politika

1. Teisės aktai, kuriais vadovaujantis parengta finansinė atskaitomybė

Finansinė atskaitomybė parengta vadovaujantis Lietuvos Respublikos pensijų fondų buhalterinės apskaitos ir finansinės atskaitomybės tvarka, patvirtinta LR Vyriausybės 2004 m. sausio 13 d. nutarimu Nr. 30.

2. Investavimo politika

Investavimas vykdomas, vadovaujantis pensijų fondo "ERGO Balans" taisyklėmis, Lietuvos Respublikos papildomo savanoriško pensijų kaupimo įstatymo penktu skirsniu.

3. Finansinės rizikos valdymo politika

Investuojama į lito atžvilgiu mažai svyruojančias valiutas, todėl valiutos vertės svyravimo rizika minimali. Siekiant išvengti nuostolių dėl palūkanų normos augimo, šiuo metu daugiau investuojama į 1-5 metų termino vertybinius popierius. Investicijų portfelio rizikingumo politika – išlaikyti kredito rizika ne žemesnę negu A3 lygio pagal Moodys Reitingo Agentūrą (Moodys Rating Agency).

4. Turto padidėjimo ir sumažėjimo pripažinimo principai

Turto vertė nustatoma, vadovaujantis Lietuvos Respublikos Draudimo priežiūros komisijos nutarimu "Dėl grynųjų aktyvų vertės skaičiavimo metodikos patvirtinimo".

5. Atskaitymų kaupimo bendrovei ir depozitoriumui taisyklės

Atskaitymai iš pensijų turto pagal kiekvieną pensijų kaupimo sutartį dėl dalyvavimo pensijų fonde per metus gali sudaryti ne daugiau kaip 1 procentą nuo Dalyvio pensijų sąskaitoje apskaitytų lėšų vidutinės metinės vertės ir ne daugiau kaip 5 procentus Dalyvio vardu įmokėtų įmokų. Atskaitymai nuo įmokų vykdomi pinigų įskaitymo į pensijų dalyvio sąskaitą momentu. Atkaitymai nuo turto vertės vykdomi kiekvieną darbo dieną. Atskaitymo dydis yra:

$$GAV \times \left(\sqrt[m]{1 + \frac{1}{100}} - 1 \right)$$

kur, GAV - grynųjų aktyvų vertė
m – darbo dienų skaičius metuose

Atlyginimas depozitoriumui mokamas iš nuosavų lėšų, gautų iš atskaitymų nuo dalyvio vardu įmokėtų įmokų ar dalyvio sąskaitoje apskaičiuotų lėšų vidutinės vertės. Depozitoriumui mokamas pensijų turto apskaitos mokestis, kuris yra 0,11 proc. nuo grynujų aktyvų vertės, jei grynujų aktyvų vertė neviršija 50 mln. Lt., 0,09 proc., jei grynujų aktyvų vertė neviršija 250 mln. Lt, ir 0,08 proc., jei grynujų aktyvų vertė viršija 250 mln. Lt.

6. Investicijų įvertinimo metodai, investicijų pervertinimo periodiškumas

Investicijų vertė nustatoma, vadovaujantis Lietuvos Respublikos Draudimo priežiūros komisijos nutarimu "Dėl grynujų aktyvų vertės skaičiavimo metodikos patvirtinimo". Investicijų vertė nustatoma kiekvieną darbo dieną.

7. Apskaitos vieneto vertės nustatymo taisyklės

Apskaitos vieneto vertė nustatoma, pensijų fondo grynujų aktyvų vertę padalijant iš apskaitos vienetų skaičiaus. Apskaitos vienetų skaičius nustatomas, vadovaujantis pensijų fondo "ERGO Balans" taisyklėmis, Lietuvos Respublikos papildomo savanoriško pensijų kaupimo įstatymo 35 straipsniu. Pradinė vieneto vertė 2004-06-15 dieną buvo 1.0000.

8. Pinigų ekvivalentai

Pinigams priskiriamos lėšos atsiskaitomojoje sąskaitoje ir trumpalaikės (iki trijų mėnesių) likvidžios investicijos, kurios gali būti greitai iškeičiamos į pinigų sumas ir kurių vertės pasikeitimo rizika yra nereikšminga.

9. Investicinio portfelio struktūra

Investuojama į vertybinius popierius ar pinigų rinkos priemones, kuriomis prekiaujama rinkose reguliuojamose ir veikiančiose Lietuvos Respublikoje ar Europos Sąjungos valstybėse, o taip pat rinkose nurodytose "ERGO Balans" taisyklėse. Į akcijų rinkas investuojama ne daugiau 50 procentų pensijų fondo turto. Lėšos investuojamos laikantis investicijų diversifikavimo reikalavimų numatytų Lietuvos Respublikos papildomo savanoriško pensijų kaupimo įstatyme.

III. Aiškinamojo rašto pastabos

Lentelė „Investicijų vertės pokytis“

Balanso straipsniai	Pokytis					
	praėjusio ataskaitinio laikotarpio pabaigoje	įsigyta	Parduota (išpirka)	vertės padidėjimas	vertės sumažėjimas	ataskaitinio laikotarpio pabaigoje
Skolos vertybiniai popieriai	15.702.335,77	8.376.621,91	4.153.956,60	271.462,93	635.352,00	19.561.112,01
<i>Vyriausybių ir centrinių bankų arba jų garantuoti skolos vertybiniai popieriai</i>	<i>8.086.038,64</i>	<i>3.759.714,81</i>	<i>2.944.747,71</i>	<i>118.524,42</i>	<i>321.304,11</i>	<i>8.698.226,05</i>
<i>Kiti skolos vertybiniai popieriai</i>	<i>7.616.297,13</i>	<i>4.616.907,10</i>	<i>1.209.208,89</i>	<i>152.938,51</i>	<i>314.047,89</i>	<i>10.862.885,96</i>
Nuosavybės vertybiniai popieriai	4.009.692,87	7.641.413,36	7.065.091,12	186.887,30	981.090,57	3.791.811,84
Kolektyvinio investavimo subjektų investiciniai vienetai ir akcijos	7.860.785,34	4.132.469,97	1.664.293,64	240.369,00	1.608.227,60	8.961.103,07
Kitos investicijos	0,00	5.320.885,65	5.630.961,72	322.691,56	12.615,49	0,00
Iš viso	27.572.813,98	25.471.390,89	18.514.303,08	1.021.410,79	3.237.285,66	32.314.026,92

Pastaba. Kitas investicijas sudaro tokios išvestinės investicinės priemonės kaip išankstiniai valiutos pirkimo ir apskaitimo sandoriai.

Lentelė „Turto struktūra ataskaitinio laikotarpio pabaigoje“

Turto arba emitento pavadinimas	Valsybės, į kurios vertybinius popierius investuota, pavadinimas	Valiuta, kuria denominuojamas turtas, pavadinimas	Bendra nominali vertė, Lt	Palūkanų norma, %	Išpirkimo/konvertavimo data	Bendra rinkos vertė, Lt	Turto investicijos lyginamoji dalis (procentais)
Skolos vertybiniai popieriai							
AB Lietuvos Energija	Lietuva	EUR	207168,00	4,060	2009-09-29	209722,27	0,58
DNB NORD	Lietuva	LTL	200000,00	5,050	2008-10-08	207058,21	0,57
DNB NORD	Lietuva	LTL	350000,00	6,250	2009-02-13	358084,60	0,99
DNB NORD	Lietuva	LTL	300000,00	5,900	2009-03-26	303762,69	0,84
DNB NORD	Lietuva	LTL	163500,00	4,330	2009-09-26	164574,26	0,45
BACR	Didžioji Britanija	EUR	1035840,00	4,710	2019-09-30	1006319,25	2,77
BHH bankas	Vokietija	EUR	345280,00	4,125	2017-03-28	327031,66	0,90
BHP Billiton	Australija	EUR	345280,00	4,125	2011-05-05	332735,21	0,92
Bulgarijos Respublikos Vyriausybė	Bulgarija	EUR	176092,80	7,500	2013-01-15	193003,59	0,53
Bundesimmobilien Gesellschaft mbH	Austrija	EUR	586976,00	4,625	2012-09-27	593525,72	1,64
CAISSE REF. HYPOTHEK	Prancūzija	EUR	690560,00	3,500	2017-04-25	611910,32	1,69
CBRD bankas	Kroatija	EUR	376355,20	5,000	2017-06-14	348687,55	0,96
CEZ AS	Čekija	EUR	172640,00	4,125	2013-10-17	164947,21	0,45
Čekijos Respublikos Vyriausybė	Čekija	EUR	321110,40	4,625	2014-06-23	313199,52	0,86
Čekijos Respublikos Vyriausybė	Čekija	EUR	897728,00	5,000	2018-06-11	881877,48	2,43
Deutsche Genoss.-Hypothekenbank AG	Vokietija	EUR	690560,00	5,500	2010-04-01	703738,49	1,94
EESTI ENERGIA	Estija	EUR	31075,20	4,500	2020-11-18	28926,71	0,08
Eksportfinans A/S	Norvegija	EUR	1035840,00	4,375	2011-04-26	1017006,57	2,80
Eksportfinans A/S	Norvegija	EUR	276224,00	4,750	2013-06-11	270182,22	0,74
ERAP (su Prancūzijos vyriausybės garantija)	Prancūzija	EUR	414336,00	3,750	2010-04-25	408820,39	1,13
EUROHYPO SA	Liuksemburgas	EUR	690560,00	4,250	2018-06-04	647996,83	1,79
Europos investicijų bankas	Liuksemburgas	EUR	355638,40	3,625	2013-10-15	342802,55	0,94
Europos investicijų bankas	Liuksemburgas	EUR	1104896,00	4,250	2014-10-15	1090957,29	3,01
Kipro Vyriausybė	Kipras	EUR	1035840,00	5,500	2012-02-27	1061181,70	2,92
Kroatijos Respublikos Vyriausybė	Kroatija	EUR	100131,20	5,000	2014-04-15	97697,45	0,27
Landwirtschaftliche Rentenbank (su Vokietijos vyriausybės garantija)	Vokietija	EUR	207168,00	4,125	2009-04-30	207179,52	0,57
Latvijos Respublikos Vyriausybė	Latvija	LVL	741153,30	5,000	2011-11-03	741232,52	2,04
Latvijos Respublikos Vyriausybė	Latvija	EUR	62150,40	5,375	2008-11-27	64136,18	0,18
Latvijos Respublikos Vyriausybė	Latvija	EUR	379808,00	4,250	2014-04-02	355222,56	0,98
Lenkijos Respublikos Vyriausybė	Lenkija	EUR	165734,40	5,500	2011-02-14	170253,72	0,47
Lenkijos Respublikos Vyriausybė	Lenkija	EUR	103584,00	4,500	2013-02-05	101850,04	0,28
Lenkijos Respublikos Vyriausybė	Lenkija	EUR	103584,00	3,875	2009-01-15	104894,21	0,29
Lietuvos Respublikos Vyriausybė	Lietuva	EUR	362544,00	3,750	2016-02-10	326272,28	0,90
Lietuvos Respublikos Vyriausybė	Lietuva	EUR	103584,00	4,850	2018-02-07	99673,09	0,27
OEBB Infrastruktur Bau AG (su Austrijos vyriausybės garantija)	Austrija	EUR	103584,00	3,875	2016-10-18	98993,35	0,27
Olandijos Vyriausybė	Olandija	EUR	221497,12	7,500	2010-04-15	235417,48	0,65

Olandijos Vyriausybė	Olandija	EUR	37980,80	5,000	2011-07-15	40056,97	0,11
Pfandbrief Bank International S.A.	Liuksemburgas	EUR	1035840,00	4,905	2009-05-11	1043220,62	2,88
Romanian Commercial Bank S.A.	Rumunija	EUR	345280,00	3,750	2008-12-05	349660,39	0,96
Siemens	Olandija	EUR	276224,00	5,750	2011-07-04	293527,44	0,81
Slovakijos Respublikos Vyriausybė	Slovakija	EUR	310752,00	4,500	2014-05-20	302498,44	0,83
Slovakijos Respublikos Vyriausybė	Slovakija	EUR	131206,40	4,375	2017-05-15	124414,36	0,34
Tallinna Sadam	Estija	EUR	759616,00	5,075	2009-03-17	769804,09	2,12
Tesco PLC	Didžioji Britanija	EUR	138112,00	4,750	2010-04-13	137917,61	0,38
Tiuringijos žemė	Vokietija	EUR	517920,00	4,000	2017-03-15	488412,62	1,35
Vengrijos Respublikos Vyriausybė	Vengrija	EUR	172640,00	4,875	2012-06-21	165877,25	0,46
Vengrijos Respublikos Vyriausybė	Vengrija	EUR	586976,00	5,750	2018-06-11	581290,49	1,60
Vokietijos Respublikos Vyriausybė	Vokietija	EUR	65603,20	3,750	2009-01-04	66580,25	0,18
Vokietijos Respublikos Vyriausybė	Vokietija	EUR	95987,84	4,500	2013-01-04	97350,08	0,27
Vokietijos Respublikos Vyriausybė	Vokietija	EUR	75961,60	3,500	2009-10-09	76805,74	0,21
VTB Capital	Liuksemburgas	EUR	345280,00	8,250	2011-06-30	345791,20	0,95
Zagrebacki Holding D.O.O.	Kroatija	EUR	517920,00	5,500	2017-07-10	487029,77	1,34
Nuosavybės vertybiniai popieriai							
AMBRA	Lenkija	PLN	83533,52			357523,47	0,99
Black Earth Farming LTD-SDR	Švedija	SEK				218022,82	0,60
Eesti Ehitus AS	Estija	EUR	59580,90			321628,32	0,89
Grupa Lotos	Lenkija	PLN	13301,26			352483,26	0,97
MATAV	Vengrija	HUF	47672,10			347529,61	0,96
Merko	Estija	EUR	25377,05			337511,20	0,93
PKN Orlen	Lenkija	PLN	18359,68			501439,50	1,38
Richter Gedeon	Vengrija	HUF	10867,50			351074,59	0,97
Sberbank GDR	Rusija	EUR				240211,30	0,66
Trigon Agri	Danija	EUR	519991,68			764387,77	2,11
Kolektyvinio investavimo subjektai							
Asia Pacific Fund INC	JAV	USD				346918,76	0,96
Balzac Euro Index-P	Prancūzija	EUR				231954,06	0,64
Carnegie European Equity Sub-Fund	Liuksemburgas	EUR				1368396,98	3,77
East Capital Turkish Fund	Švedija	SEK				423888,44	1,17
EVL I Greater Russia B	Suomija	EUR				744259,10	2,05
EVL I Ruble Debt B	Suomija	EUR				901478,91	2,48
Hansa Russian Equity Fund E-unit	Estija	EUR				565863,49	1,56
ISHARES DJ STOXX 50	Airija	EUR				50220,98	0,14
ISHARES MSCI JAPAN INDEX FUND	JAV	USD				562398,75	1,55
ISHARES PLC-IFTSE 100	Airija	EUR				160356,66	0,44
Ishares S&P Latin America 40	JAV	USD				1282001,88	3,53
ISHARES S&P500/BARRA GROWTH	JAV	USD				1027261,94	2,83
LHV Persian Gulf Fund	Estija	EEK				344868,25	0,95
State Street Europe Actions	Prancūzija	EUR				214677,29	0,59
State Street Midcap Europe	Prancūzija	EUR				207740,96	0,57
Trigon New Europe Small Cap Fund	Estija	EUR				528816,62	1,46
Pinigai							
AB bankas "Hansabankas"		LTL				2505868,54	6,91
AB bankas "Hansabankas"		EUR				28544,71	0,08
AB bankas "Hansabankas"		USD				0,09	0,00
AB bankas "Hansabankas"		EEK				17874,27	0,05

Indėliai							
SEB bankas		LTL		5,300	2008-12-15	1403710,00	3,87
Kitas turtas							
Gautinos sumos		USD				13644,85	0,04
Gautinos sumos		EUR				1793,21	0,00
Iš viso:						36285462,59	100,00

1 pastaba “Pinigai ir pinigų ekvivalentai”

2008-06-30 dieną sudarė šios sumos:

likutis grynaisiais pinigais 2552287,52 LTL .

2 pastaba “ Kitos gautinos sumos”

2008-06-30 dieną kitas gautinas sumas sudarė :

gautini dividendai 15438,06 LTL

3 pastaba “Mokėtinos sumos kaupimo bendrovei ir depozitoriumui”

2008-06-30 dieną sudarė 27401,07 LTL gautinas atskaitymas nuo pensijų fondo turto vertės už 2008 m. birželio mėnesį.

4 pastaba “Kitos mokėtinos sumos ir įsipareigojimai”

išvestinių finansinių priemonių tikroji vertė - 11925,67 LTL

5 pastaba “Palūkanos ir dividendai”

2008-06-30 dieną sudarė šios sumos:

palūkanos iš trumpalaikių indėlių 1965,65 LTL
 skolos vertybinių popierių atkarpos mokėjimai 582543,68 LTL

6 pastaba “Turto vertės padidėjimas/sumažėjimas dėl užsienio valiutų kursų pasikeitimo”

2008-06-30 dieną sudarė banke turimų piniginių lėšų kursų pasikeitimas.

VII. Informacija apie pensijų fondo dalyvius

25. Bendri duomenys apie pensijų fondo dalyvius:

		Dalyvių skaičius, vnt.
Ataskaitinio laikotarpio pradžioje:		21827
Prisijungę per ataskaitinį laikotarpį, iš viso:		2281
	Pirmą kartą sudarę pensijų kaupimo sutartis	2084
	Atėję iš kitų pensijų fondų, iš viso:	197
	Iš tos pačios pensijų kaupimo bendrovės	58
	Iš kitos pensijų kaupimo bendrovės	139
Pasitraukę per ataskaitinį laikotarpį, iš viso:		152
	Baigę dalyvavimą pensijų kaupime, iš viso:	15
	Gavę pensijų išmokas	2
	Pasinaudoję galimybe pasitraukti iš pensijų fondo per 30 dienų nuo sutarties pasirašymo	7
	Mirę	6
	Perėję į kitus pensijų fondus, iš viso:	137
	Iš tos pačios pensijų kaupimo bendrovės	2
Iš kitos pensijų kaupimo bendrovės	135	
Ataskaitinio laikotarpio pabaigoje, iš viso:		23956
	Pasinaudoję teise nukelti pensijų išmokos mokėjimą	23
	Gaunantys periodines pensijų išmokas	0
Pokytis		2129

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

		Dalyviai pagal amžiaus metus				
		Iš viso	iki 30 (imtinai)	nuo 31 iki 45 (imtinai)	nuo 46 iki 60 (imtinai)	virš 60
Dalyvių skaičius, vnt.	Iš viso:	23956	10734	9544	3656	22
	Vyrai	11498	5545	4253	1681	19
	Moterys	12458	5189	5291	1975	3
Dalyvių dalis, %	Iš viso:	100,0	44,8	39,8	15,3	0,1
	Vyrai	48,0	23,1	17,8	7,0	0,1
	Moterys	52,0	21,7	22,1	8,2	0,0

VIII. Pinigų srautai

27. Per ataskaitinį laikotarpį faktiškai gautos ir išmokėtos lėšos.

Pateikiama atskirai kartu su balansu.

IX. Informacija apie pensijų kaupimo techninį atidėjinį.

28. Jei pensijų fondo taisyklėse numatytas įsipareigojimas garantuoti tam tikrą pajamingumą, nurodyti garantuojamo pajamingumo dydį, pensijų kaupimo techninio atidėjinio pokytį per ataskaitinį laikotarpį ir kitą svarbią informaciją.

-

X. Informacija apie pensijų fondų reikmėms pasiskolintas lėšas

29. Pensijų fondo reikmėms pasiskolintos lėšos ataskaitinio laikotarpio pabaigoje.

-

30. Konsultantų paslaugomis naudotasi nebuvo.

Patvirtiname, kad pateikta ataskaita yra teisinga ir joje nėra nutylėtų faktų, galinčių daryti esminę įtaką pensijų fondų veiklos rezultatų vertinimui.

Generalinis direktorius

Darius Kremensas

Vyr. buhalterė

Jūratė Muckienė

Vyr. buhalterės pavaduotoja

Kristina Gerčienė

Vyr. ekspertas

Valerijus Cvetkovas