

## PENSIJŲ FONDO ATASKAITA

Pateikta – 2007-04-27

### 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: Aadu Oja (“ERGO Varahalduse AS” valdybos narys) ir Kertu Virkebau (“ERGO Varahalduse AS” valdybos narė).

### 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 2006 metų sausio 1 dienos iki 2006 metų gruodžio 31 dienos.

### II. Grynujų aktyvų, apskaitos vienetų skaičiaus ir vertės pokyčiai

#### 8. Grynujų aktyvų, apskaitos vienetų skaičiaus ir vertės pokyčiai:

	Ataskaitinio laikotarpio pradžioje (2006-01-01)	Ataskaitinio laikotarpio pabaigoje (2006-12-31)	Prieš metus 2005-12-31	Prieš dvejus metus 2004-12-31
GAV, Lt	7339228,17	15923735,42	7339228,17	2276142,72
Apskaitos vieneto vertė, Lt	1,2051	1,2966	1,2051	1,0383
Apskaitos vienetų skaičius	6090206,9754	12281575,8908	6090206,9754	2192280,3868

### 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%	393400,76
Nuo turto vertės	1%	1%	103648,36
Keitimo mokesčiai:			
Fondo keitimas toje pačioje bendrovėje daugiau kaip kartą per metus	4%	-	-
Pensijų kaupimo bendrovės keitimas kartą per metus	0,2%	-	-
Pensijų kaupimo bendrovės keitimas daugiau kaip kartą per metus	4%	-	-
Iš viso:			497049,12
PAR (portfelio apyvartumo rodiklis)			32,3647
BAR (bendrasis atskaitymų rodiklis)			0,0473

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

-

#### 10. Pavyzdys apie mokesčių įtaką galutinei dalyviui tenkančiai investicinei grąžai

Pensijų fondo Dalyvis 2005-12-31 dieną turėjo 827,6397 apskaitos vienetų, o vieneto kaina buvo 1,2051. Dalyvio pensijų turto vertė 2005-12-31 dieną sudarė 997,39 Lt.

Per 2006 m. į Dalyvio sąskaitą pervesta 796,26 Lt įmokų, nuo kurių padaryti 39,80 Lt atskaitymai (5% nuo įmokų). Dalyviui nupirkti 614,5138 pensijų fondo vienetai. Atskaitymai už turto valdymą per metus sudaro 1% nuo turto vertės ir yra įskaičiuoti į vieneto kainą.

2006-12-31 dieną Dalyvio sąskaitoje buvo 1442,1535 vienetų, o vieneto kaina buvo 1,2966. Dalyvio pensijų turto vertė 2006-12-31 dieną sudarė 1869,90 Lt.

Metinė pensijų fondo investicijų grąža (apskaitos vieneto vertės pokytis) buvo 7,59%, o nuo fondo veiklos pradžios investicijų grąža siekia 29,66%. Grynąją investicijų grąžą ir Dalyvio sukaupto turto vertę įtakojo atskaitymai nuo įmokų ir turto. Pirmaisiais pensijų fondo veiklos metais grynąją investicijų grąžą labiau įtakoja atskaitymai nuo įmokų, kurių įtaka augant Dalyvio pensijų turtui mažės.

### 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 emitent e, %	Dalis GA, %
Nuosavybės vertybiniai popieriai, įtraukti į Oficialųjį prekybos sąrašą									
Iš viso:									
Nuosavybės vertybiniai popieriai, įtraukti į Einamąjį prekybos sąrašą									
ABN Amro Holding NV	Olandija	NL0000301109	700	1353,50	47203,23	58852,98	www.euronext.com		0,37
Adris Grupa	Kroatija	HRADRSPA0009	950	4453,41	149723,69	190605,95	www.zse.hr		1,20
Allami Nyomda Nyrt	Vengrija	HU0000079835	210	2807,73	17798,34	19102,59	www.bse.hu		0,12
Astrazeneca Plc	Švedija	GB0009895292	250	164,40	23157,59	35190,92	www.omxgroup.com/stockholmsbor sen		0,22
Bayer AG	Vokietija	DE0005752000	550		47476,00	77547,30	www.deutsche-boerse.com		0,49
Bank Pekao	Lenkija	PLPEKAO00016	770	692,14	116123,85	157046,02	www.wse.com.pl		0,99
Bank Pekao	Lenkija	PLPKO0000016	3200	2876,42	92800,51	135191,55	www.wse.com.pl		0,85
Cesky Telecom	Čekija	CZ0009093209	3775	47217,70	219926,75	224756,25	www.pse.cz		1,41
Eesti Telekom	Estija	EE3100007220	2730	6024,29	70638,82	78849,69	www.ee.omxgroup.com		0,50
Ericsson Nikola Tesla	Kroatija	HRERNTRA0000	195	9141,21	134483,97	222588,46	www.zse.hr		1,40
Erste bank	Austrija	AT0000652011	950		179726,87	190101,67	www.wienerboerse.at		1,19
Farmacol	Lenkija	PLFRMCL00066	2000	1797,76	73141,83	78202,56	www.wse.com.pl		0,49
Foreningssparbanken	Švedija	SE0000242455	700		44209,94	66671,49	www.omxgroup.com/stockholmsbor sen		0,42
Komercni Banka	Čekija	CZ0008019106	440	27517,60	166383,45	170554,08	www.pse.cz		1,07
MATAV	Vengrija	HU0000073507	9900	13506,57	124460,58	141143,66	www.bse.hu		0,89
Mazeikių Nafta	Lietuva	LT0000115552	11000	11000,00	46090,00	111705,00	www.omxgroup.com/vilnius		0,70
MOL Magyar Oliaj ES gazipari RT	Vengrija	HU0000068952	230	3137,89	56804,30	68249,11	www.bse.hu		0,43
NOKIA OYP	Suomija	FI0009000681	1300	269,32	50628,41	69551,48	www.omxgroup.com/helsinginporssi		0,44
Nordea Bank AB	Suomija	FI0009902530	4800		146792,35	194406,45	www.omxgroup.com/stockholmsbor sen		1,22
OMV	Austrija	AT0000743059	1100		148636,14	164266,96	www.wienerboerse.at		1,03
OTP Bank	Vengrija	HU0000061726	890	1214,23	72798,40	103270,01	www.bse.hu		0,65
Polish Oil & Gas	Lenkija	PLPGNIG00014	12000	10786,56	37809,59	38831,62	www.wse.com.pl		0,24
PKN Orlen	Lenkija	PLPKN0000018	1500	1685,40	46151,30	64314,86	www.wse.com.pl		0,40
Raiffeisen Intl Bank Holding AG	Austrija	AT0000606306	555		99652,12	225328,61	www.wienerboerse.at		1,42
Richter Gedeon	Vengrija	HU0000067624	130	1773,59	43759,01	76889,56	www.bse.hu		0,48
Sanofi-Aventis	Prancūzija	FR0000120578	230	1588,29	46735,37	55550,37	www.euronext.com		0,35
SEB	Švedija	SE0000148884	2600		148089,80	216558,04	www.omxgroup.com/stockholmsbor sen		1,36
Siemens AG	Vokietija	DE0007236101	220		47460,81	57297,83	www.deutsche-boerse.com		0,36
Snieszka	Lenkija	PLSNZKA00033	930	835,96	18962,31	32602,38	www.wse.com.pl		0,20
Sparkassen Immobilien AG	Austrija	AT0000652250	2800		85753,74	94841,51	www.wienerboerse.at		0,60
Telekomunikacja Polska	Lenkija	PLTLKPL00017	11600	31281,02	225562,55	255983,05	www.wse.com.pl		1,61
Torfarm SA	Lenkija	PLTRFRM00018	600	539,33	23084,46	36134,98	www.wse.com.pl		0,23
Iš viso:			79805	181664,31	2852026,07	3712186,99			23,31

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:			79805	181664,31	2852026,07	3712186,99				23,31

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	207188,34	4,060	2009.09.29	1,30
DNB NORD	Lietuva	LT0000403388	1635	163500,00	163440,98	164798,72	4,330	2009.09.26	1,03
Lietuvos Respublikos Vyriausybė	Lietuva	LT0000603219	1083	108300,00	109905,11	109826,12	3,400	2007.07.19	0,69
DNB NORD	Lietuva	LT0000403065	1000	100000,00	100205,62	99837,02	3,250	2008.03.17	0,63
Iš viso:			4318		580811,90	581650,20			3,65
Skolos vertybiniai popieriai, kuriais prekiaujama kitose reguliuojamose rinkose									
Airijos Respublikos Vyriausybė	Airija	IE0006857530	1900000	65603,20	67630,79	70978,88	4,600	2016.04.18	0,45
Airijos Respublikos Vyriausybė	Airija	IE0031256211	5800000	200262,40	216121,52	202507,29	4,250	2007.10.18	1,27
Austrijos Respublikos Vyriausybė	Austrija	AT0000384953	69	238243,20	266492,06	243694,76	5,500	2007.10.20	1,53
Austrijos Respublikos Vyriausybė	Austrija	AT0000385356	58	200262,40	219107,51	215211,58	5,000	2012.07.15	1,35
Belgijos Vyriausybė	Belgija	BE0000282880	1400000	48339,20	69339,30	64689,36	8,000	2015.03.28	0,41
Bulgarijos Respublikos Vyriausybė	Bulgarija	XS0145624432	51	176092,80	212909,38	218526,30	7,500	2013.01.15	1,37
CEZ AS	Čekija	XS0271020850	1	172640,00	171274,42	171681,07	4,125	2013.10.17	1,08
Čekijos Respublikos Vyriausybė	Čekija	XS0194957527	75	258960,00	287983,03	273207,17	4,625	2014.06.23	1,72
EESTI ENERGIA	Estija	XS0235372140	9	31075,20	30823,42	30629,42	4,500	2020.11.18	0,19
ERAP (su Prancūzijos vyriausybės garantija)	Prancūzija	FR0000473712	200	690560,00	706712,03	701984,63	3,375	2008.04.25	4,41
ERAP (su Prancūzijos vyriausybės garantija)	Prancūzija	FR0000474413	80	276224,00	277271,37	281487,18	3,750	2010.04.25	1,77
Estijos Respublikos Vyriausybė	Estija	XS0150123312	21	72508,80	77613,01	74780,95	5,000	2007.06.26	0,47
Europos investicijų bankas	Liuksemburgas	XS0170558877	103	355638,40	366108,63	350384,87	3,625	2013.10.15	2,20
Ispanijos Vyriausybė	Ispanija	ES0000012783	70	241696,00	297127,16	277971,76	5,500	2017.07.30	1,75
KFW (su Vokietijos vyriausybės garantija)	Vokietija	DE0002760881	50	172640,00	189384,90	176581,96	4,750	2007.08.17	1,11
Kroatijos Respublikos Vyriausybė	Kroatija	XS0190291582	29	100131,20	110256,05	107514,08	5,000	2014.04.15	0,68
Landwirtschaftliche Rentenbank (su Vokietijos vyriausybės garantija)	Vokietija	DE0002942455	60	207168,00	222911,49	214005,86	4,125	2009.04.30	1,34
Landwirtschaftliche Rentenbank (su Vokietijos vyriausybės garantija)	Vokietija	XS0168924834	58	200262,40	200196,00	202070,98	3,625	2010.06.15	1,27
Latvijos Respublikos Vyriausybė	Latvija	LV0000570059	1270	629119,90	626377,83	628840,72	5,000	2011.11.03	3,95
Latvijos Respublikos Vyriausybė	Latvija	XS0138888689	18	62150,40	68683,86	63880,50	5,375	2008.11.27	0,40
Latvijos Respublikos Vyriausybė	Latvija	XS0189713992	110	379808,00	397539,06	395035,33	4,250	2014.04.02	2,48
Lenkijos Respublikos Vyriausybė	Lenkija	DE0006101652	48	165734,40	193388,18	182332,32	5,500	2011.02.14	1,15

Lenkijos Respublikos Vyriausybė	Lenkija	XS0162316490	20	69056,00	69855,78	72875,40	4,500	2013.02.05	0,46
Lietuvos Respublikos Vyriausybė	Lietuva	XS0163880502	19	65603,20	66934,15	69211,06	4,500	2013.03.05	0,43
Lietuvos Respublikos Vyriausybė	Lietuva	XS0212170939	170	586976,00	576402,84	586695,65	3,750	2016.02.10	3,68
OEBB Infrastruktur Bau AG (su Austrijos vyriausybės garantija)	Austrija	XS0271660242	140	483392,00	481023,72	478514,74	3,875	2016.10.18	3,01
Olandijos Vyriausybė	Olandija	NL0000102192	64150	221497,12	281584,75	257308,71	7,500	2010.04.15	1,62
Olandijos Vyriausybė	Olandija	NL0000102606	11000	37980,80	40598,07	40530,48	5,000	2011.07.15	0,25
Prancūzijos Respublikos Vyriausybė	Prancūzija	FR0000187361	65000	224432,00	249145,66	244675,37	5,000	2016.10.25	1,54
Prancūzijos Respublikos Vyriausybė	Prancūzija	FR0000570590	55000	189904,00	211737,23	194164,05	5,500	2007.10.25	1,22
Slovėnijos Respublikos Vyriausybė	Slovėnija	XS0109256734	80	276224,00	300104,50	305239,27	6,000	2010.03.24	1,92
Slovėnijos Respublikos Vyriausybė	Slovėnija	XS0127672938	80	276224,00	297087,61	300856,10	5,375	2011.04.11	1,89
Suomijos Respublikos Vyriausybė	Suomija	FI0001005332	32	110489,60	119828,80	113793,59	5,000	2007.07.04	0,71
Suomijos Respublikos Vyriausybė	Suomija	FI0001005407	109	376355,20	420768,04	416960,94	5,375	2013.07.04	2,62
Vokietijos Respublikos Vyriausybė	Vokietija	DE0001135101	1900000	65603,20	67805,33	67885,27	3,750	2009.01.04	0,43
Vokietijos Respublikos Vyriausybė	Vokietija	DE0001135218	3780000	130515,84	140322,76	140259,26	4,500	2013.01.04	0,88
Vokietijos Respublikos Vyriausybė	Vokietija	DE0001141455	2200000	75961,60	76850,32	75808,36	3,500	2009.10.09	0,48
Iš viso:			17178180		8675300,55	8512775,22			53,46
Išleidžiami nauji skolos vertybiniai popieriai									
Iš viso:									
Iš viso skolos vertybinių popierių:			17182498		9256112,45	9094425,42			57,11

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)									
Trigon Second Wave Fund	Estija	EE3600072419	16700	AS Trigon Funds	757092,21	781347,06	www.trigon.ee		4,91
Trigon New Europe Small Cap Fund	Estija	EE3600075883	26200	AS Trigon Funds	756880,42	785314,81	www.trigon.ee		4,93
Balzac Euro Index-P	Prancūzija	FR0000018087	286	State Street Global Advisors France S.A.	213389,05	271780,19	www.statestreetfrance.com		1,71
State Street Europe Actions	Prancūzija	FR0000027369	124	State Street Global Advisors France S.A.	212733,50	269146,17	www.statestreetfrance.com		1,69
State Street Midcap Europe	Prancūzija	FR0000988438	173	State Street Global Advisors France S.A.	182264,65	258430,75	www.statestreetfrance.com		1,62
ISHARES PLC-IFTSE 100	Airija	IE0005042456	6500	Barclay Global Investors	207150,74	208497,33	www.euronext.com		1,31
ISHARES DJ STOXX 50	Airija	IE0008470928	1000	Barclay Global Investors	127235,68	128081,62	www.euronext.com		0,80
Iš viso:			50983		2456746,25	2702597,93			16,97
Kitų kolektyvinio investavimo subjektų vienetai (akcijos)									

Iš viso:										
Iš viso KIS vienetų (akcijų):					2456746,25	2702597,93				16,97

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 apskaitimo sandoris GBP/EUR	AB bankas „Hansabankas“	Lietuva	AB bankas „Hansabankas“	EUR	155376,00	153.821,37	-1554,63		2007-02-28	-0,01
Iš viso:										
Iš viso išvestinės investicinės priemonės										

Banko pavadinimas	Valiuta	Bendra rinkos vertė, Lt	Palūkanų norma, %	Dalis GA, %
Pinigai				
AB bankas "Hansabankas"	LTL	394010,94		2,47
AB bankas "Hansabankas"	USD	5,52		0,00
AB bankas "Hansabankas"	HRK	1113,35		0,01
AB bankas "Hansabankas"	EEK	24021,38		0,15
Iš viso pinigų:		419151,19		2,63

Pavadinimas	Trumpas apibūdinimas	Bendra vertė	Paskirtis	Dalis GA (%)
Kitos priemonės				
Gautini dividendai	PKN Orlen dividendai	5157,32		0,03
Gautini dividendai	ISHARES PLC-IFTSE 100 dividendai	899,92		0,01
Gautinos sumos		2061,52		0,01
Iš viso:		8118,76		0,05

## 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	880.177,80	5,53	287.970,46	3,92
EUR	12.060.822,51	75,74	5.737.269,73	78,17
CZK	395.310,33	2,48	68.985,91	0,94
EEK	24.021,38	0,15	39,94	0,00
GBP	899,92	0,01	0,00	0,00
HRK	414.307,76	2,60	170.658,81	2,33
HUF	408.654,93	2,57	351.054,82	4,78
LVL	628.840,72	3,95	0,00	0,00
PLN	803.464,34	5,05	538.251,07	7,33
SEK	318.420,45	2,00	198.627,22	2,71
USD	5,52	0,00	56.858,03	0,77
Iš viso:	15.934.925,66	100,07	7.409.715,99	100,96

Pagal geografinę zoną				
Lietuva	1.774.977,23	11,15	287.970,46	3,92
Kitos Europos Sąjungos valstybės	13.420.713,64	84,28	5.737.269,73	78,17
Kitos Europos valstybės	739.234,79	4,64	1.384.475,80	18,86
Iš viso:	15.934.925,66	100,07	7.409.715,99	100,96

## 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	9.094.425,42	57,11	4.152.830,83	56,58
Nuosavybės vertybiniai popieriai	3.712.186,99	23,31	2.044.971,49	27,86
Kolektyviniai investavimo subjektai	2.702.597,93	16,97	642.803,74	8,76
Išvestinės priemonės	-1.554,63	-0,01	0,00	0,00
Pinigai	419.151,19	2,63	569.109,93	7,75
Gautinos sumos	8.118,76	0,05	0,00	0,00
Iš viso:	15.934.925,66	100,07	7.409.715,99	100,96

**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 sudarytas Didžiosios Britanijos svarų (GBP) apsigėitimo sandoris, t.y. atsižvelgiant į investicines priemones, kurios yra nominuotos GBP, buvo nupirkti Didžiosios Britanijos svarai ir sudarytas išankstinis sandoris juos parduoti sutartu laiku už sutartą kainą. Jei apsigėitimo sandorio pabaigoje parduodama įsigyta investicinė priemonė, tai gautus GBP galima panaudoti apsigėitimo sandorio įsipareigojimų įvykdymui. Nepardavus investicinės priemonės, gali būti sudarytas naujas apsigėitimo sandoris, pratęsiantis pirmąjį. Rizikos, susijusios su išvestinio sandorio sudarymu: 1) jei investicinės priemonės vertė GBP sumažėtų, tai įsipareigojimų vykdymo momentu reiktų papildomai įsigyti GBP tuo metu galiojančia rinkos kaina; 2) apsigėitimo 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).**

Didžiosios Britanijos svaro ir euro apsikeitimo sandorio rinkos vertė 2006-12-31 dieną yra -1554,63 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 virš 23 proc. grynujų aktyvų vertės, dar 17 proc. investuota į kolektyvinius investavimo subjektus. Pensijų fondo taisyklėse numatyta, jog į akcijų rinkas galima investuoti ne daugiau kaip 50 proc. grynujų aktyvų vertės ( investuota – 40 proc.).

Grynieji pinigai sudaro 3 proc. grynujų aktyvų vertės. Į skolos vertybinius popierius buvo investuota 57 proc. grynujų aktyvų vertės.

Pagal geografinį pasiskirstymą 11 proc. pensijų fondo lėšų investuota į Lietuvos VP, o didžiausia dalis (84 proc.) - į kitų Europos Sąjungos valstybių VP. Dar 5 proc. investuoti į būsimų Europos Sąjungos valstybių VP (Bulgarijos ir Kroatijos).

Pagal valiutas daugiausia investuota: 76 proc. eurais, 6 proc. litais ir 5 proc. Lenkijos zlotais.

**17. Nurodyti veiksnius, 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. Jei tikimasi, kad palūkanų norma ateityje kils, investuojama į trumpesnio laikotarpio VP, jei tikimasi, kad palūkanų norma kris, tai ilginamas investavimo laikotarpis. 2006 m. palūkanų normos augo, todėl investavimo laikotarpis buvo trumpinamas ir ataskaitinio laikotarpio pabaigoje vidutinė investavimo trukmė buvo 4,1 m

Investicijos į trumpesnio kaip 3 metų išpirkimo terminą turinčius skolos VP sudarė 30 proc., į 3-5 metų – 24 proc., į 5-7 metų – 18 proc., į 7-10 metų – 24 proc. ir į ilgesnio kaip 10 metų išpirkimo laikotarpio – 3 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 55 proc. investicijų yra investuota į aukščiausio tarpautinio kredito reitingo AAA lygio, 7 proc. – į AA lygio, 32 proc. į A lygio ir mažiau kaip 6 proc. – į BBB lygio skolos VP. Vidutinis skolos VP reitingo lygis pensijų fonde yra A+.

Akcijų portfelį sudaro esamų ir būsimų Europos Sąjungos valstybių 31 skirtingos įmonės akcijos. Tikintis vertės augimo ilgalaikėje perspektyvoje ir saugantis galimo akcijų vertės kritimo vertybinių popierių biržoje, kiekvienos įmonės akcijų dalis neviršija 2 proc. pensijų fondo grynujų aktyvų vertės, kas rodo apie akcijų portfelio subalansavimą.

Iki ataskaitinio laikotarpio pabaigos investuota į 7 kolektyvinio investavimo fondus: tris iš jų valdo State Street Global Advisors France S.A., du valdo Trigon Capital SA ir du valdo Barclay Global Investors. Kiekvieno iš šių investavimo fondų dalis neviršija 5 proc. pensijų fondo grynujų aktyvų vertės.

2006 m. tęsėsi Europos akcijų rinkų augimas ir skolos vertybinių popierių palūkanų normų augimas.

## V. Pensijų fondo investicijų grąža ir rizikos rodikliai

### 18. Orientacinis indeksas ir jo apibūdinimas

Orientacinis indeksas nėra pasirinktas.

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

	Per ataskaitinį laikotarpį	Prieš metus	Prieš 2 metus
Apskaitos vieneto vertės pokytis *	7,5927%	16,0647%	
Metinė grynoji investicijų grąža	3,5699%	9,0739%	
Apskaitos vieneto vertės pokyčio standartinis nuokrypis	0,0290	0,0472	
Grynosios investicijų grąžos standartinis nuokrypis	0,0047	0,0033	

\* skaičiuojant apskaitos vieneto vertės pokytį, nėra įvertinami atskaitymai nuo įmokų.

Apskaitos vieneto vertės pokytis parodo metinę pensijų fondo investicijų grąžą. Metinė grynoji investicijų grąža apskaičiuota įvertinus atskaitymus nuo įmokų ir turto.

### 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 grąža ir orientacinio indekso reikšmės pokytis per paskutinius trejus, penkerius, dešimt metų (vidutinė grynoji investicijų grąža apskaičiuojama kaip geometrinis metinių grynosios investicinių grąžos 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 grąžos 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. gryųjų aktyvų pokyčių ataskaita**

**24. aiškinamasis raštas**

UAB ERGO LIETUVA GYVYBĖS DRAUDIMAS

110707135 , Geležinio vilko 6 a , Vilnius

ERGO BALANS PENSIJŲ FONDAS

BALANSAS

PAGAL 2006 M. GRUODŽIO 31 D. DUOMENIS

Eil. Nr.	Turtas	Pastabų Nr.	Ataskaitinis laikotarpis	Praėjęs ataskaitinis laikotarpis
I.	PINIGAI IR PINIGŲ EKVIVALENTAI	1 pastaba	419.311	569.244
II.	TERMINUOTI INDĖLIAI		0	0
III.	INVESTICIJOS		15.509.210	6.840.605
1.	Skolos vertybiniai popieriai		9.094.425	4.152.830
1.1.	Vyriausybių ir centrinių bankų arba jų garantuoti skolos vertybiniai popieriai		8.420.291	4.120.866
1.2.	Kiti skolos vertybiniai popieriai		674.135	31.964
2.	Nuosavybės vertybiniai popieriai		3.712.187	2.044.971
3.	Kolektyvinio investavimo subjektų investiciniai vienetai ir akcijos		2.702.598	642.804
4.	Kitos investicijos			
IV.	GAUTINOS SUMOS		6.564	1.022
1.	Investicijų pardavimo sandorių gautinos sumos			
2.	Kitos gautinos sumos	2 pastaba	6.564	1.022
	TURTAS, IŠ VISO		15.935.085	7.410.872

Eil. Nr.	Įsipareigojimai ir gryniesi aktyvai	Pastabų Nr.	Ataskaitinis laikotarpis	Praėjęs ataskaitinis laikotarpis
V.	ĮSIPAREIGOJIMAI		11.190	71.511
1.	Investicijų pirkimo įsipareigojimai			
2.	Mokėtinų sumų kaupimo bendrovei ir depozitoriumui	3 pastaba	11.190	71.511
3.	Kitos mokėtinų sumos ir įsipareigojimai			
VI.	GRYNIEJI AKTYVAI ( I+II+III+IV-V)		15.923.895	7.339.361
	ĮSIPAREIGOJIMAI IR GRYNIEJI AKTYVAI, IŠ VISO		15.935.085	7.410.872

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 2006 M. GRUODŽIO 31 D. DUOMENIS

Eil. Nr.	Straipsniai	Pastabų Nr.	Ataskaitinis laikotarpis	Praėjęs ataskaitinis laikotarpis
I.	GRYNIEJI AKTYVAI ATASKAITINIO LAIKOTARPIO PRADŽIOJE		7.339.361	2.276.143
II.	PADIDĖJIMAS, IŠ VISO		9.904.412	5.558.286
1.	Pensijų įmokos		7.867.828	4.750.412
2.	Iš kitų pensijų fondų pervestos sumos		168.485	
3.	Kaupimo bendrovės garantinės įmokos			
4.	Palūkanos ir dividendai	4 pastaba	297.922	142.570
5.	Investicijų pardavimo pelnas		47.146	16.942
6.	Investicijų vertės padidėjimo suma		1.396.653	644.803
7.	Turto vertės padidėjimas dėl užsienio valiutų kursų pasikeitimo	5 pastaba	125.864	3.559
8.	Kitos pajamos	6 pastaba	513	
III.	SUMAŽĖJIMAS		1.319.878	495.067
1.	Pensijų išmokos		7.175	2.675
2.	Iš kitų pensijų fondų pervestos sumos			
3.	Investicijų pardavimo nuostoliai		41.644	11
4.	Investicijų vertės sumažėjimo suma		647.240	208.454
5.	Turto vertės sumažėjimas dėl užsienio valiutų kursų pasikeitimo	5 pastaba	126.770	4.396
6.	Valdymo sąnaudos		497.049	279.531
7.	Kitos sąnaudos			
IV.	GRYNIEJI AKTYVAI ATASKAITINIO LAIKOTARPIO PABAIGOJE		15.923.895	7.339.361

		Ataskaitinio laikotarpio pabaigoje	Prieš metus	Prieš dvejus metus
V.	APSKAITOS VIENETO VERTĖ	1,2966	1,2051	1,0383
VI.	APSKAITOS VIENETŲ SKAIČIUS	12.281.575,8908	6.090.206,9754	2.192.280,3868

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 2006 M. GRUODŽIO 31 D. DUOMENIS

Gautos lėšos per ataskaitinį laikotarpį, iš viso		8.036.313
	Periodinės įmokos į pensijų fondą iš Valstybinio socialinio draudimo fondo	7.867.828
	Valstybinio socialinio draudimo fondo sumokėti delspinigiai	
	Draudimo įmonės pervestos lėšos	
	Iš kitų pensijų fondų pervestos lėšos, iš viso	168.485
	Iš tos pačios pensijų kaupimo bendrovės	168.485
	Iš kitos pensijų kaupimo bendrovės	
	Kitos gautos lėšos ( šaltinis ir lėšų suma), iš viso	
	Gautos palūkanos	
	Vertės pokytis/ kurso įtaka	
	Išmokėtos lėšos per ataskaitinį laikotarpį, iš viso	7.175
	Pensijų išmokos, iš viso	7.175
	Pensijų išmokos dalyviams ir jų paveldėtojams	7.175
	Periodinės išmokos dalyviams	
	Išmokos anuiteto įsigijimui	
	Iš kitus pensijų fondus pervestos lėšos, iš viso	0
	Tos pačios pensijų kaupimo bendrovės	
	Kitos pensijų kaupimo bendrovės	
	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 2006 gruodžio 31 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. Kadangi šiuo metu palūkanų norma rinkoje yra maža, tikimasi, kad Europos Centrinis Bankas dar didins palūkanų normą, kaip tai buvo atlikta JAV. 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 gryųjų 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. Atskaitymai nuo turto vertės vykdomi kiekvieną darbo dieną. Atskaitymo dydis yra:

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

kur, GAV - grynujų 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	išigyta	Parduota (išpirka)	vertės padidėjimas	vertės sumažėjimas	ataskaitinio laikotarpio pabaigoje
Skolos vertybiniai popieriai	4.152.830,83	5.628.875,53	546.050,57	125.016,69	266.247,06	9.094.425,42
<i>Vyriausbių ir centrinių bankų arba jų garantuoti skolos vertybiniai popieriai</i>	<i>4.120.866,52</i>	<i>4.699.902,20</i>	<i>258.471,86</i>	<i>119.948,52</i>	<i>261.954,53</i>	<i>8.420.290,85</i>
<i>Kiti skolos vertybiniai popieriai</i>	<i>31.964,31</i>	<i>928.973,33</i>	<i>287.578,71</i>	<i>5.068,17</i>	<i>4.292,53</i>	<i>674.134,57</i>
Nuosavybės vertybiniai popieriai	2.044.971,49	2.152.598,94	1.170.093,78	1.071.892,22	387.181,88	3.712.186,99
Kolektyvinio investavimo subjektų investiciniai vienetai ir akcijos	642.803,74	1.848.359,02		246.890,23	35.455,06	2.702.597,93
Kitos investicijos						
Iš viso	6.840.606,06	9.629.833,49	1.716.144,35	1.443.799,14	688.884,00	15.509.210,34

#### 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, įtraukti į Einamąjį prekybos sąrašą							
DNB NORD	Lietuva	LTL	100.000,00	3,250	2008.03.17	99.837,02	0,63
DNB NORD	Lietuva	LTL	163.500,00	4,330	2009.09.26	164.798,72	1,03
Lietuvos Respublikos Vyriausybė	Lietuva	LTL	108.300,00	3,400	2007.07.19	109.826,12	0,69
AB Lietuvos Energija	Lietuva	EUR	207.168,00	4,060	2009.09.29	207.188,34	1,30
Iš viso:						581.650,20	3,65
Skolos vertybiniai popieriai, kuriais prekiaujama kitose reguliuojamose rinkose							
Austrijos Respublikos Vyriausybė	Austrija	EUR	238.243,20	5,500	2007.10.20	243.694,76	1,53
Austrijos Respublikos Vyriausybė	Austrija	EUR	200.262,40	5,000	2012.07.15	215.211,58	1,35
Belgijos Vyriausybė	Belgija	EUR	48.339,20	8,000	2015.03.28	64.689,36	0,41
Vokietijos Respublikos Vyriausybė	Vokietija	EUR	65.603,20	3,750	2009.01.04	67.885,27	0,43
Vokietijos Respublikos Vyriausybė	Vokietija	EUR	130.515,84	4,500	2013.01.04	140.259,26	0,88
Vokietijos Respublikos Vyriausybė	Vokietija	EUR	75.961,60	3,500	2009.10.09	75.808,36	0,48
KFW (su Vokietijos vyriausybės garantija)	Vokietija	EUR	172.640,00	4,750	2007.08.17	176.581,96	1,11
Landwirtschaftliche Rentenbank (su Vokietijos vyriausybės garantija)	Vokietija	EUR	207.168,00	4,125	2009.04.30	214.005,86	1,34
Lenkijos Respublikos Vyriausybė	Lenkija	EUR	165.734,40	5,500	2011.02.14	182.332,32	1,14
Ispanijos Vyriausybė	Ispanija	EUR	241.696,00	5,500	2017.07.30	277.971,76	1,74
Suomijos Respublikos Vyriausybė	Suomija	EUR	110.489,60	5,000	2007.07.04	113.793,59	0,71
Suomijos Respublikos Vyriausybė	Suomija	EUR	376.355,20	5,375	2013.07.04	416.960,94	2,62
Prancūzijos Respublikos Vyriausybė	Prancūzija	EUR	224.432,00	5,000	2016.10.25	244.675,37	1,54
ERAP (su Prancūzijos vyriausybės garantija)	Prancūzija	EUR	690.560,00	3,375	2008.04.25	701.984,63	4,41
ERAP (su Prancūzijos vyriausybės garantija)	Prancūzija	EUR	276.224,00	3,750	2010.04.25	281.487,18	1,77

Prancūzijos Respublikos Vyriausybė	Prancūzija	EUR	189.904,00	5,500	2007.10.25	194.164,05	1,22
Airijos Respublikos Vyriausybė	Airija	EUR	65.603,20	4,600	2016.04.18	70.978,88	0,45
Airijos Respublikos Vyriausybė	Airija	EUR	200.262,40	4,250	2007.10.18	202.507,29	1,27
Latvijos Respublikos Vyriausybė	Latvija	LVL	629.119,90	5,000	2011.11.03	628.840,72	3,95
Olandijos Vyriausybė	Olandija	EUR	221.497,12	7,500	2010.04.15	257.308,71	1,61
Olandijos Vyriausybė	Olandija	EUR	37.980,80	5,000	2011.07.15	40.530,48	0,25
Slovėnijos Respublikos Vyriausybė	Slovėnija	EUR	276.224,00	6,000	2010.03.24	305.239,27	1,92
Slovėnijos Respublikos Vyriausybė	Slovėnija	EUR	276.224,00	5,375	2011.04.11	300.856,10	1,89
Latvijos Respublikos Vyriausybė	Latvija	EUR	62.150,40	5,375	2008.11.27	63.880,50	0,40
Bulgarijos Respublikos Vyriausybė	Bulgarija	EUR	176.092,80	7,500	2013.01.15	218.526,30	1,37
Estijos Respublikos Vyriausybė	Estija	EUR	72.508,80	5,000	2007.06.26	74.780,95	0,47
Lenkijos Respublikos Vyriausybė	Lenkija	EUR	69.056,00	4,500	2013.02.05	72.875,40	0,46
Lietuvos Respublikos Vyriausybė	Lietuva	EUR	65.603,20	4,500	2013.03.05	69.211,06	0,43
Landwirtschaftliche Rentenbank (su Vokietijos vyriausybės garantija)	Vokietija	EUR	200.262,40	3,625	2010.06.15	202.070,98	1,27
Europos investicijų bankas	Liuksemburgas	EUR	355.638,40	3,625	2013.10.15	350.384,87	2,20
Latvijos Respublikos Vyriausybė	Latvija	EUR	379.808,00	4,250	2014.04.02	395.035,33	2,48
Kroatijos Respublikos Vyriausybė	Kroatija	EUR	100.131,20	5,000	2014.04.15	107.514,08	0,67
Čekijos Respublikos Vyriausybė	Čekija	EUR	258.960,00	4,625	2014.06.23	273.207,17	1,71
Lietuvos Respublikos Vyriausybė	Lietuva	EUR	586.976,00	3,750	2016.02.10	586.695,65	3,68
EESTI ENERGIA	Estija	EUR	31.075,20	4,500	2020.11.18	30.629,42	0,19
CEZ AS	Čekija	EUR	172.640,00	4,125	2013.10.17	171.681,07	1,08
OEBB Infrastruktur Bau AG (su Austrijos vyriausybės garantija)	Austrija	EUR	483.392,00	3,875	2016.10.18	478.514,74	3,00
Iš viso:						8.512.775,22	53,42
Iš viso skolos vertybinių popierių:						9.094.425,42	57,07
Nuosavybės vertybiniai popieriai, įtraukti į Einamąjį prekybos sąrašą							
Raiffeisen Intl Bank Holding AG	Austrija	EUR				225.328,61	1,41
Erste bank	Austrija	EUR				190.101,67	1,19
Sparkassen Immobilien AG	Austrija	EUR				94.841,51	0,60
OMV	Austrija	EUR				164.266,96	1,03
Komercni Banka	Čekija	CZK	27.517,60			170.554,08	1,07
Cesky Telecom	Čekija	CZK	47.217,70			224.756,25	1,41
Bayer AG	Vokietija	EUR				77.547,30	0,49
Siemens AG	Vokietija	EUR				57.297,83	0,36
Eesti Telekom	Estija	EUR	6.024,29			78.849,69	0,49
NOKIA OYP	Suomija	EUR	269,32			69.551,48	0,44
Nordea Bank AB	Suomija	EUR				194.406,45	1,22
Sanofi-Aventis	Prancūzija	EUR	1.588,29			55.550,37	0,35
Astrazeneca Plc	Švedija	SEK	164,40			35.190,92	0,22
Adris Grupa	Kroatija	HRK	4.453,41			190.605,95	1,20
Ericsson Nikola Tesla	Kroatija	HRK	9.141,21			222.588,46	1,40
OTP Bank	Vengrija	HUF	1.214,23			103.270,01	0,65
Richter Gedeon	Vengrija	HUF	1.773,59			76.889,56	0,48
MOL Magyar Oliaj ES gazipari RT	Vengrija	HUF	3.137,89			68.249,11	0,43
MATAV	Vengrija	HUF	13.506,57			141.143,66	0,89
Allami Nyomda Nyrt	Vengrija	HUF	2.807,73			19.102,59	0,12
Mazeikių Nafta	Lietuva	LTL	11.000,00			111.705,00	0,70
ABN Amro Holding NV	Olandija	EUR	1.353,50			58.852,98	0,37
Farmacol	Lenkija	PLN	1.797,76			78.202,56	0,49
Bank Pekao	Lenkija	PLN	692,14			157.046,02	0,99

Polish Oil & Gas	Lenkija	PLN	10.786,56			38.831,62	0,24
PKN Orlen	Lenkija	PLN	1.685,40			64.314,86	0,40
Bank Pekao	Lenkija	PLN	2.876,42			135.191,55	0,85
Sniezka	Lenkija	PLN	835,96			32.602,38	0,20
Telekomunikacja Polska	Lenkija	PLN	31.281,02			255.983,05	1,61
Torfarm SA	Lenkija	PLN	539,33			36.134,98	0,23
SEB	Švedija	SEK				216.558,04	1,36
Foreningssparbanken	Švedija	SEK				66.671,49	0,42
Iš viso nuosavybės vertybinių popierių:						3.712.186,99	23,30
<b>Kolektyvinio investavimo subjektai</b>							
Trigon Second Wave Fund	Estija	EUR				781.347,06	4,90
Trigon New Europe Small Cap Fund	Estija	EUR				785.314,81	4,93
Balzac Euro Index-P	Prancūzija	EUR				271.780,19	1,71
State Street Europe Actions	Prancūzija	EUR				269.146,17	1,69
State Street Midcap Europe	Prancūzija	EUR				258.430,75	1,62
ISHARES PLC-IFTSE 100	Airija	EUR				208.497,33	1,31
ISHARES DJ STOXX 50	Airija	EUR				128.081,62	0,80
Iš viso kolektyvinio investavimo subjektų:						2.702.597,93	16,96
<b>Pinigai</b>							
AB bankas "Hansabankas"		LTL				394.170,46	2,47
AB bankas "Hansabankas"		USD				5,52	0,00
AB bankas "Hansabankas"		HRK				1.113,35	0,01
AB bankas "Hansabankas"		EEK				24.021,38	0,15
Iš viso pinigų:						419.310,71	2,63
<b>Kitos priemonės</b>							
Gautini dividendai		PLN				5.157,32	0,03
Gautini dividendai		GBP				899,92	0,01
Gautinos sumos		EUR				2.061,52	0,01
Valiutos apskaitimo sandoris		EUR				-1.554,63	0,01
Iš viso kitų priemonių:						6.564,13	0,04
Iš viso:						15.935.085,18	100,00

### **1 pastaba "Pinigai ir pinigų ekvivalentai"**

2006-12-31 dieną sudarė šios sumos:

Likutis grynaisiais pinigais 10,59 EUR, 394133,89 LTL, 2375,00 HRK, 108856,56 EEK, 2,10 USD. Kadangi 2006 m. gruodžio 31 d. AB bankas "Hansabankas" priskaičiavo palūkanas, o investicijų valdymo įmonei "ERGO Varahalduse AS" Estijoje buvo ne darbo diena, tai susidarė piniginių lėšų skirtumas: 10,59 EUR ir 122,95 LTL (viso 159,52 LTL). Ši suma ataskaitoje įskaičiuota 2007 m. sausio 2 d.

### **2 pastaba "Kitos gautinos sumos"**

2006-12-31 dieną kitas gautinas sumas sudarė valiutų konvertavimo išlaidos ir gautini dividendai.

### **3 pastaba "Mokėtinos sumos kaupimo bendrovei ir depozitoriumui"**

2006-12-31 dieną sudarė gautinas atskaitymas nuo pensijų fondo turto vertės 11190,24 LTL.

#### 4 pastaba "Palūkanos ir dividendai"

2006-12-31 dieną sudarė šios sumos:

palūkanos iš trumpalaikių indėlių	1689,80 LTL
skolos vertybinių popierių atkarpos mokėjimai	296232,03 LTL

#### 5 pastaba "Turto vertės padidėjimas/sumažėjimas dėl užsienio valiutų kursų pasikeitimo"

2006-12-31 dieną sudarė banke turimų piniginių lėšų kursų pasikeitimas.

#### 6 pastaba "Kitos pajamos"

2006-12-31 dieną kitos pajamos susidarė dėl investicijų valdymo įmonės "ERGO Varahalduse AS" netiksliai apskaityto valiutos pirkimo pardavimo sandorio kurso pokyčio. Šis netikslumas koreguotas 2007 m. pradžioje.

### VII. Informacija apie pensijų fondo dalyvius

#### 25. Bendri duomenys apie pensijų fondo dalyvius:

		Dalyvių skaičius, vnt.
Ataskaitinio laikotarpio pradžioje:		10114
Prisijungę per ataskaitinį laikotarpį, iš viso:		1036
	Pirmą kartą sudarę pensijų kaupimo sutartis	888
	Atėję iš kitų pensijų fondų, iš viso:	148
	Iš tos pačios pensijų kaupimo bendrovės	148
	Iš kitos pensijų kaupimo bendrovės	0
Pasitraukę per ataskaitinį laikotarpį, iš viso:		15
	Baigę dalyvavimą pensijų kaupime, iš viso:	15
	Gavę pensijų išmokas	1
	Pasinaudoję galimybe pasitraukti iš pensijų fondo per 30 dienų nuo sutarties pasirašymo	7
	Mirę	7
	Perėję į kitus pensijų fondus, iš viso:	0
	Į tos pačios pensijų kaupimo bendrovės	0
	Į kitos pensijų kaupimo bendrovės	0
Ataskaitinio laikotarpio pabaigoje, iš viso:		11135
	Pasinaudoję teise nukelti pensijų išmokos mokėjimą	10
	Gaunantys periodines pensijų išmokas	0
Pokytis		1021

**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:	11135	3354	6201	1569	11
	Vyrai	5058	1709	2636	703	10
	Moterys	6077	1645	3565	866	1
Dalyvių dalis, %	Iš viso:	100,0	30,1	55,7	14,1	0,1
	Vyrai	45,4	15,3	23,7	6,3	0,1
	Moterys	54,6	14,8	32,0	7,8	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