

PENSIJŲ FONDO ATASKAITA
Pateikta – 2008-04-30

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 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 2007 metų sausio 1 dienos iki 2007 metų gruodžio 31 dienos.

II. Gryųjų aktyvų, apskaitos vienetų skaičiaus ir vertės pokyčiai

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

	Ataskaitinio laikotarpio pradžioje (2007-01-01)	Ataskaitinio laikotarpio pabaigoje (2007-12-31)	Prieš metus 2006-12-31	Prieš dvejus metus 2005-12-31
GAV, Lt	15923735,42	29526793,79	15923735,42	7339228,17
Apskaitos vieneto vertė, Lt	1,2966	1,3577	1,2966	1,2051
Apskaitos vienetų skaičius	12281575,8908	21747703,0711	12281575,8908	6090206,9754

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%	640.737,53
Nuo turto vertės	1%	1%	218.683,39
Keitimo mokesčiai:			
Fondo keitimas toje pačioje bendrovėje daugiau kaip kartą per metus	4%	-	-
Pensijų kaupimo bendrovės keitimas kartą per metus	0,2%	0,2%	979,52
Pensijų kaupimo bendrovės keitimas daugiau kaip kartą per metus	4%	-	-
Iš viso:			860.400,44
PAR (portfelio apyvartumo rodiklis)			68,45
BAR (bendrasis atskaitymų rodiklis)			0,0390

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

-

10. Pavyzdys apie mokesčių įtaką galutinei dalyviui tenkančiai investicinei grąžai

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

Per 2007 m. į Dalyvio sąskaitą pervesta 1222,71 Lt įmokų, nuo kurių padaryti 61,12 Lt atskaitymai (5% nuo įmokų). Dalyviui nupirkti 857,7507 pensijų fondo vienetai. Atskaitymai už turto valdymą per metus sudaro 1% nuo turto vertės ir yra įskačiuoti į vieneto kainą.

2007-12-31 dieną Dalyvio sąskaitoje buvo 2299,9049 vienetų, o vieneto kaina buvo 1,3577. Dalyvio pensijų turto vertė 2007-12-31 dieną sudarė 3122,58 Lt.

Metinė pensijų fondo investicijų grąža (apskaitos vieneto vertės pokytis) buvo 4,71%, o nuo fondo veiklos pradžios investicijų grąža siekia 35,77%. 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 mažėja.

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									

Corporate Express NV	Olandija	NL0000852861	32200	133416,19	909408,36	552565,40	www.euronext.com		1,87
DSM NV	Olandija	NL0000009827	1600	8286,72	205113,48	178164,48	www.euronext.com		0,60
DUDA S.A.	Lenkija	PLDUDA000016	30064	28775,16	334522,47	215813,67	www.wse.com.pl		0,73
Eesti Telekom	Estija	EE3100007220	500	1103,35	12937,51	13465,92	www.ee.omxgroup.com		0,05
Erste bank	Austrija	AT0000652011	1980		325257,21	331572,38	www.wienerboerse.at		1,12
Farmacol	Lenkija	PLFRMCL00066	2000	1914,26	73141,83	80781,77	www.wse.com.pl		0,27
Grammer AG	Vokietija	DE0005895403	3000		237785,57	166459,49	www.deutscheboerse.com		0,56
Komerční Banka	Čekija	CZ0008019106	710	46071,90	274222,87	401931,26	www.pse.cz		1,36
MATAV	Vengrija	HU0000073507	9900	13488,75	124460,58	121398,75	www.bse.hu		0,41
PKN Orlen	Lenkija	PLPKN0000018	7600	9092,74	347647,85	377530,36	www.wse.com.pl		1,28
Raiffeisen Intl Bank Holding AG	Austrija	AT0000606306	805		214554,40	287956,61	www.wienerboerse.at		0,98
Richter Gedeon	Vengrija	HU0000067624	270	3678,75	120802,53	152668,13	www.bse.hu		0,52
Telekomunikacja Polska	Lenkija	PLTLKPL00017	11600	33308,12	225562,55	249921,96	www.wse.com.pl		0,85
Thiel Logistik AG	Vokietija	LU0106198319	22000		227351,10	189904,00	www.deutscheboerse.com		0,64
TUI AG	Vokietija	DE000TUAG000	10500		687362,19	689558,69	www.deutscheboerse.com		2,34
Iš viso:			134729	279135,94	4320130,50	4009692,87			13,58
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:			134729	279135,94	4320130,50	4009692,87			13,58

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	205422,03	4,060	2009-09-29	0,70
DNB NORD	Lietuva	LT0000401374	2500	250000,00	249775,00	259127,72	4,300	2008-02-07	0,88
DNB NORD	Lietuva	LT0000401473	2000	200000,00	200000,00	199233,04	5,050	2008-10-08	0,67
DNB NORD	Lietuva	LT0000403065	1000	100000,00	100205,62	100217,72	3,250	2008-03-17	0,34
DNB NORD	Lietuva	LT0000403388	1635	163500,00	163440,98	157979,95	4,330	2009-09-26	0,54
Iš viso:			7735		920681,79	921980,46			3,12
Skolos vertybiniai popieriai, kuriais prekiaujama kitose reguliuojamose rinkose									
BACR	Didžioji Britanija	XS0323856210	6	1035840,00	1036047,17	1017422,45	4,710	2019-09-30	3,45
BHH bankas	Vokietija	DE000A0NKQTQ6	100	345280,00	343726,24	342593,02	4,125	2017-03-28	1,16
BHP Billiton	Australija	XS0252824858	100	345280,00	344262,56	343785,67	4,125	2011-05-05	1,16
Bulgarijos Respublikos Vyriausybė	Bulgarija	XS0145624432	51	176092,80	212909,38	208913,30	7,500	2013-01-15	0,71
Bundesimmobilien Gesellschaft mbH	Austrija	XS0155106171	170	586976,00	610882,39	594804,39	4,625	2012-09-27	2,01
CAISSE REF. HYPOTHEK	Prancūzija	FR0010261495	50000	172640,00	166551,02	160864,62	3,500	2017-04-25	0,54
CBRD (Su Kroatijos vyriausybės garantija)	Kroatija	XS0305384124	109	376355,20	374559,99	375258,94	5,000	2017-06-14	1,27
CEZ AS	Čekija	XS0271020850	1	172640,00	171274,42	163437,53	4,125	2013-10-17	0,55
Deutsche Genoss.-Hypothekenbank AG	Vokietija	DE0002366523	200	690560,00	734220,00	733937,04	5,500	2010-04-01	2,49

EESTI ENERGIA	Estija	XS0235372140	9	31075,20	30823,42	29598,81	4,500	2020-11-18	0,10
ERAP (su Prancūzijas vyriasybės garantija)	Prancūzija	FR0000473712	200	690560,00	706712,03	704131,49	3,375	2008-04-25	2,38
ERAP (su Prancūzijas vyriasybės garantija)	Prancūzija	FR0000474413	80	276224,00	277271,37	280104,17	3,750	2010-04-25	0,95
EUROHYPO SA	Liuksemburgas	XS0169781753	200	690560,00	719506,27	679943,97	4,250	2018-06-04	2,30
Europos investicijų bankas	Liuksemburgas	XS0170558877	103	355638,40	366108,63	345313,51	3,625	2013-10-15	1,17
Ispanijos Vyriasybė	Ispanija	ES0000012783	70	241696,00	297127,16	266958,00	5,500	2017-07-30	0,90
Kesko Oyj	Estija	EE4300094117	500	500000,00	483775,00	484974,28	-	2008-05-29	1,64
KFW (su Vokietijos vyriasybės garantija)	Vokietija	DE000A0MFJX5	250	863200,00	855372,26	854740,75	4,125	2017-07-04	2,89
Kipro Vyriasybė	Kipras	XS0143546207	300	1035840,00	1108978,83	1114346,54	5,500	2012-02-27	3,77
Kroatijos Respublikos Vyriasybė	Kroatija	XS0190291582	29	100131,20	110256,05	102716,50	5,000	2014-04-15	0,35
Landwirtschaftliche Rentenbank (su Vokietijos vyriasybės garantija)	Vokietija	DE0002942455	60	207168,00	222911,49	212302,57	4,125	2009-04-30	0,72
Latvijos Respublikos Vyriasybė	Latvija	LV0000570059	1510	748023,80	746203,98	728852,18	5,000	2011-11-03	2,47
Latvijos Respublikos Vyriasybė	Latvija	XS0138888689	18	62150,40	68683,86	62795,56	5,375	2008-11-27	0,21
Latvijos Respublikos Vyriasybė	Latvija	XS0189713992	110	379808,00	397539,06	379855,61	4,250	2014-04-02	1,29
Lenkijos Respublikos Vyriasybė	Lenkija	DE0006101652	48	165734,40	193388,18	178329,22	5,500	2011-02-14	0,60
Lenkijos Respublikos Vyriasybė	Lenkija	XS0162316490	30	103584,00	105898,11	107193,75	4,500	2013-02-05	0,36
Lietuvos Respublikos Vyriasybė	Lietuva	XS0212170939	105	362544,00	356013,52	347950,63	3,750	2016-02-10	1,18
Lietuvos Respublikos Vyriasybė	Lietuva	XS0327304001	30	103584,00	105253,95	103448,81	4,850	2018-02-07	0,35
OEBB Infrastruktur Bau AG (su Austrijos vyriasybės garantija)	Austrija	XS0271660242	140	483392,00	481023,72	463081,33	3,875	2016-10-18	1,57
Olandijos Vyriasybė	Olandija	NL0000102192	64150	221497,12	281584,75	249444,70	7,500	2010-04-15	0,84
Olandijos Vyriasybė	Olandija	NL0000102606	11000	37980,80	40598,07	39915,57	5,000	2011-07-15	0,14
Romanian Commercial Bank S.A.	Rumunija	XS0236777339	100	345280,00	349998,98	341472,88	3,750	2008-12-05	1,16
Siemens	Olandija	XS0131224155	100	345280,00	362182,87	363645,71	5,750	2011-07-04	1,23
Slovakijos Respublikos Vyriasybė	Slovakija	XS0299989813	38	131206,40	130455,55	130855,26	4,375	2017-05-15	0,44
Suomijos Respublikos Vyriasybė	Suomija	FI0001005407	109	376355,20	420768,04	407271,49	5,375	2013-07-04	1,38
Tesco PLC	Didžioji Britanija	XS0159012847	120	414336,00	427447,01	427809,86	4,750	2010-04-13	1,45
Tiuringijos žemė	Vokietija	DE000A0NKN C9	150	517920,00	513146,33	510376,94	4,000	2017-03-15	1,73
Vengrijos Respublikos Vyriasybė	Vengrija	XS0307199215	1	172640,00	172543,32	176746,25	4,875	2012-06-21	0,60

Vokietijos Respublikos Vyriausybė	Vokietija	DE0001135101	1900000	65603,20	67805,33	67867,01	3,750	2009-01-04	0,23
Vokietijos Respublikos Vyriausybė	Vokietija	DE0001135218	2780000	95987,84	103200,34	101789,11	4,500	2013-01-04	0,34
Vokietijos Respublikos Vyriausybė	Vokietija	DE0001141455	2200000	75961,60	76850,32	75856,39	3,500	2009-10-09	0,26
Zagrebacki Holding D.O.O.	Kroatija	XS0309688918	3	517920,00	519587,25	499649,50	5,500	2017-07-10	1,69
Iš viso:			7010300		15093448,22	14780355,31			50,06
Išleidžiami nauji skolos vertybiniai popieriai									
Iš viso:									
Iš viso skolos vertybinių popierių:			7018035		16014130,01	15702335,77			53,18

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	14522,018		672170,99	876369,71	www.trigon.ee		2,97
Hansa Russian Equity Fund E-unit	Estija	EE3600073318	6660,470		566274,74	629126,68	www.hanza.net		2,13
Trigon New Europe Small Cap Fund	Estija	EE3600075883	22910,549		674887,97	703835,10	www.trigon.ee		2,38
Balzac Euro Index-P	Prancūzija	FR0000018087	286		213389,05	292633,32	www.statestreetfrance.com		0,99
State Street Europe Actions	Prancūzija	FR0000027369	124		212733,50	264539,31	www.statestreetfrance.com		0,90
State Street Midcap Europe	Prancūzija	FR0000988438	173		182264,65	248616,55	www.statestreetfrance.com		0,84
ISHARES PLC-IFTSE 100	Airija	IE0005042456	6500		207150,74	197724,59	www.euronext.com		0,67
ISHARES DJ STOXX 50	Airija	IE0008470928	500		63617,84	63721,42	www.euronext.com		0,22
East Capital Turkish Fund	Švedija	SE0001621327	227715,787		925350,40	951698,03	www.eastcapital.com		3,22
Asia Pacific Fund INC	JAV	US0449011065	8800		572418,49	504063,65	www.ishares.com		1,71
ISHARES MSCI JAPAN INDEX FUND	JAV	US4642868487	20558		761506,04	642570,55	www.ishares.com		2,18
ISHARES S&P500/BARRA GROWTH	JAV	US4642873099	7336		1253270,02	1218596,78	www.ishares.com		4,13
ISHARES S&P LATIN AMERICA 40	JAV	US4642873909	2125		1180475,00	1267289,65	www.ishares.com		4,29
Iš viso:			318210,824		7485509,43	7860785,34			26,62
Kitų kolektyvinio investavimo subjektų vienetai (akcijos)									
Iš viso:									
Iš viso KIS vienetų (akcijų):					7485509,43	7860785,34			26,62

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	AB bankas	Lietuva	AB bankas Hansa-	EUR			105364,43		2008-01-23	0,36

sandoris USD/EUR	„Hansabankas“		bankas“						
Valiutos apskaitės sandoris USD/EUR	AB bankas „Hansabankas“	Lietuva	AB bankas „Hansabankas“	EUR		6482,47		2008-01-23	0,02
Iš viso:						111846,90			0,38
Iš viso išvestinės investicinės priemonės						111846,90			0,38

Banko pavadinimas	Valiuta	Bendra rinkos vertė, Lt	Palūkanų norma, %	Dalis GA, %
Pinigai				
AB bankas „Hansabankas“	LTL	22248,53		0,08
Iš viso pinigų:		22248,53		0,08

Kredito įstaigos pavadinimas	Šalis	Valiuta	Bendra rinkos vertė	Palūkanų norma	Indėlio termino pabaiga	Dalis GA, %
Indėliai kredito įstaigose						
AB bankas „Hansabankas“	Lietuva	LTL	1201350,00	4,500	2008-01-02	4,07
AB bankas „Hansabankas“	Lietuva	LTL	500044,44	3,200	2008-01-02	1,69
Iš viso indėlių kredito įstaigose			1701394,44			5,76

Pavadinimas	Trumpas apibūdinimas	Bendra vertė	Paskirtis	Dalis GA (%)
Kitos priemonės				
Gautini dividendai	ISHARES S&P LATIN AMERICA 40 dividendai	12172,56		0,04
Gautini dividendai	ISHARES MSCI JAPAN INDEX FUND dividendai	4694,40		0,02
Gautini dividendai	ASIA PACIFIC FUND INC dividendai	118340,87		0,40
Iš viso:		135207,83		0,46

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	2.925.175,68	10	880.177,80	6
EUR	19.570.011,43	66	12.058.760,99	76
CZK	401.931,26	1	395.310,33	2
EEK	0,00	0	24.021,38	0
HRK	0,00	0	414.307,76	3
HUF	274.066,88	1	408.654,93	3
LVL	728.852,18	2	628.840,72	4
PLN	924.047,76	3	798.307,02	5
SEK	951.698,03	3	318.420,45	2
USD	3.767.728,46	13	5,52	0
Iš viso:	29.543.511,68	100	15.926.806,90	100
Pagal geografinę zoną				
Lietuva	3.344.077,60	11	1.766.858,47	11
Kitos Europos Sąjungos valstybės	21.245.502,84	72	13.420.713,64	84

Kitos Europos valstybės	977.624,94	3	739.234,79	5
Jungtinės Amerikos Valstijos	3.632.520,63	12	0,00	0
Australija	343.785,67	1	0,00	0
Iš viso:	29.543.511,68	100	15.926.806,90	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	15.702.335,77	53	9.094.425,42	57
Nuosavybės vertybiniai popieriai	4.009.692,87	14	3.712.186,99	23
Kolektyviniai investavimo subjektai	7.860.785,34	27	2.702.597,93	17
Išvestinės priemonės	111.846,90	0	-1.554,63	0
Pinigai ir gautinos sumos	157.456,36	1	419.151,19	3
Indėliai	1.701.394,44	6	0	0
Iš viso:	29.543.511,68	100	15.926.806,90	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 2007-12-31 dieną yra 111.846,90 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 mažiau kaip 14 proc. grynujų aktyvų vertės, dar beveik 27 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 ir gautinos sumos sudaro mažiau kaip 1 proc. grynujų aktyvų vertės, indėliai – 6 proc. grynujų aktyvų vertės. Į skolos vertybinius popierius buvo investuota 53 proc. grynujų aktyvų vertės.

Pagal geografinį pasiskirstymą 11 proc. pensijų fondo lėšų investuota į Lietuvos VP, o didžiausia dalis (72 proc.) - į kitų Europos Sąjungos valstybių VP. Dar 3 proc. investuoti į Kroatijos VP, 1 proc. į Australijos VP ir 12 proc. – į JAV kolektyvinio investavimo subjektus.

Pagal valiutas daugiausia investuota: 66 proc. eurais, 13 proc. JAV doleriais ir 10 proc. litais.

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 3,6 m.

Investicijos į trumpesnį kaip 3 metų išpirkimo terminą turinčius skolos VP sudarė 29 proc., į 3-5 metų – 23 proc., į 5-7 metų – 12 proc., į 7-10 metų – 25 proc. ir į ilgesnio kaip 10 metų išpirkimo laikotarpio – mažiau kaip 12 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 daugiau kaip 45 proc. investicijų yra investuota į aukščiausio tarpautinio kredito reitingo AAA lygio, 11 proc. – į AA lygio, 30 proc. į A lygio ir mažiau kaip 14 proc. – į BBB lygio skolos VP. Vidutinis skolos VP reitingo lygis pensijų fonde yra A.

Akcijų portfelį sudaro esamų ir būsimų Europos Sąjungos valstybių 15 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 13 kolektyvinio investavimo fondus. Kiekvieno iš šių investavimo fondų dalis neviršija 5 proc. pensijų fondo grynujų aktyvų vertės.

Pasaulio rinkose skolos vertybinių popierių palūkanų normų kilimo tendencija tęsėsi iki 2007 m. vidurio. 2007 m. pabaigoje JAV centrinis bankas jau kelis kartus sumažino bazinę palūkanų normą, Europos centrinis bankas palūkanų normos nekeitė. Akcijų rinkose 2007 m. vyko kainų korekcijos, o metų pabaigoje daugumos akcijų kainos krito.

V. Pensijų fondo investicijų graža ir rizikos rodikliai

18. Orientacinis indeksas ir jo apibūdinimas

-

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

	Per ataskaitinį laikotarpį	Prieš metus	Prieš 2 metus
Orientacinio indekso reikšmės pokytis	-	-	-
Apskaitos vieneto vertės pokytis *	4,7123%	7,5927%	16,0647%
Metinė grynoji investicijų graža	0,3877%	3,5699%	9,0739%
Apskaitos vieneto vertės pokyčio standartinis nuokrypis	0,0294	0,0290	0,0472
Grynosios investicijų gražos standartinis nuokrypis	0,0039	0,0047	0,0033

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

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

20. Jei pensijų fondo reklamoje buvo naudojamos investicijų gražos prognozės, nurodyti prognozuotą dydį, palyginti neatitikimus su faktine graža 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).

	Per paskutinius 3 metus	Per paskutinius 5 metus	Per paskutinius 10 metų	Nuo veiklos pradžios
Vidutinis orientacinio indekso reikšmės pokytis	-			
Vidutinė grynoji investicijų graža	4,2826%			
Vidutinės grynosios investicijų gražos standartinis nuokrypis	0,0035			

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 2007 M. GRUODŽIO 31 D. DUOMENIS

Eil. Nr.	Turtas	Pastabų Nr.	Ataskaitinis laikotarpis	Praėjęs ataskaitinis laikotarpis
I.	PINIGAI IR PINIGŲ EKVIVALENTAI	1 pastaba	22.249	419.311
II.	TERMINUOTI INDĖLIAI		1.701.394	0
III.	INVESTICIJOS		27.572.814	15.509.210
1.	Skolos vertybiniai popieriai		15.702.336	9.094.425
1.1.	Vyriausybės ir centrinių bankų arba jų garantuoti skolos vertybiniai popieriai		8.086.039	8.420.291
1.2.	Kiti skolos vertybiniai popieriai		7.616.297	674.135
2.	Nuosavybės vertybiniai popieriai		4.009.693	3.712.187
3.	Kolektyvinio investavimo subjektų investiciniai vienetai ir akcijos		7.860.785	2.702.598
4.	Kitos investicijos			
IV.	GAUTINOS SUMOS		252.070	6.564
1.	Investicijų pardavimo sandorių gautinos sumos			
2.	Kitos gautinos sumos	2 pastaba	252.070	6.564
	TURTAS, IŠ VISO		29.548.527	15.935.085

Eil. Nr.	Įsipareigojimai ir gryniesi aktyvai	Pastabų Nr.	Ataskaitinis laikotarpis	Praėjęs ataskaitinis laikotarpis
V.	ĮSIPAREIGOJIMAI		21.733	11.190
1.	Investicijų pirkimo įsipareigojimai			
2.	Mokėtinos sumos kaupimo bendrovei ir depozitoriumui		21.733	11.190
3.	Kitos mokėtinos sumos ir įsipareigojimai	3 pastaba		
VI.	GRYNIEJI AKTYVAI (I+II+III+IV-V)		29.526.794	15.923.895
	ĮSIPAREIGOJIMAI IR GRYNIEJI AKTYVAI, IŠ VISO		29.548.527	15.935.085

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 2007 M. GRUODŽIO 31 D. DUOMENIS

Eil. Nr.	Straipsniai	Pastabų Nr.	Ataskaitinis laikotarpis	Praėjęs ataskaitinis laikotarpis
I.	GRYNIEJI AKTYVAI ATASKAITINIO LAIKOTARPIO PRADŽIOJE		15.923.895	7.339.361
II.	PADIDĖJIMAS, IŠ VISO		17.290.182	9.904.412
1.	Pensijų įmokos		12.814.353	7.867.828
2.	Iš kitų pensijų fondų pervestos sumos		1.161.671	168.485
3.	Kaupimo bendrovės garantinės įmokos			
4.	Palūkanos ir dividendai	4 pastaba	843.788	297.922
5.	Investicijų pardavimo pelnas		178.487	47.146
6.	Investicijų vertės padidėjimo suma		2.027.878	1.396.653
7.	Turto vertės padidėjimas dėl užsienio valiutų kursų pasikeitimo	5 pastaba	264.005	125.864
8.	Kitos pajamos			513
III.	SUMAŽĖJIMAS		3.687.283	1.319.878
1.	Pensijų išmokos		10.145	7.175
2.	Iš kitų pensijų fondų pervestos sumos		491.258	
3.	Investicijų pardavimo nuostoliai		93.494	41.644
4.	Investicijų vertės sumažėjimo suma		2.179.486	647.240
5.	Turto vertės sumažėjimas dėl užsienio valiutų kursų pasikeitimo	6 pastaba	51.592	126.770
6.	Valdymo sąnaudos		860.400	497.049
7.	Kitos sąnaudos		908	
IV.	GRYNIEJI AKTYVAI ATASKAITINIO LAIKOTARPIO PABAIGOJE		29.526.794	15.923.895

		Ataskaitinio laikotarpio pabaigoje	Prieš metus	Prieš dvejus metus
V.	APSKAITOS VIENETO VERTĖ	1,3577	1,2966	1,2051
VI.	APSKAITOS VIENETŲ SKAIČIUS	21.747.703,0711	12.281.575,8908	6.090.206,9754

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 2007 M. GRUODŽIO 31 D. DUOMENIS

Gautos lėšos per ataskaitinį laikotarpį, iš viso		13.976.024	
	Periodinės įmokos į pensijų fondą iš Valstybinio socialinio draudimo fondo	12.814.353	
	Valstybinio socialinio draudimo fondo sumokėti delspinigiai		
	Draudimo įmonės pervestos lėšos		
	Iš kitų pensijų fondų pervestos lėšos, iš viso	1.161.671	
		Iš tos pačios pensijų kaupimo bendrovės	915.832
		Iš kitos pensijų kaupimo bendrovės	245.839
	Kitos gautos lėšos (šaltinis ir lėšų suma), iš viso		
		Gautos palūkanos	
		Vertės pokytis/ kurso įtaka	
Išmokėtos lėšos per ataskaitinį laikotarpį, iš viso		501.403	
	Pensijų išmokos, iš viso	10.145	
		Pensijų išmokos dalyviams ir jų paveldėtojams	10.145
		Periodinės išmokos dalyviams	
		Išmokos anuiteto įsigijimui	
	Iš kitus pensijų fondus pervestos lėšos, iš viso	491.258	
		Tos pačios pensijų kaupimo bendrovės	2.480
		Kitos pensijų kaupimo bendrovės	488.778
	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 2007 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. 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 grynujų 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 - 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	įsigyta	Parduota (išpirka)	vertės padidėjimas	vertės sumažėjimas	ataskaitinio laikotarpio pabaigoje
Skolos vertybiniai popieriai	9.094.425,42	11.554.762,62	4.673.895,31	340.787,09	613.744,05	15.702.335,77
<i>Vyriausybės ir centrinių bankų arba jų garantuoti skolos vertybiniai popieriai</i>	<i>8.420.290,85</i>	<i>3.322.224,43</i>	<i>3.493.124,57</i>	<i>241.423,26</i>	<i>404.775,33</i>	<i>8.086.038,64</i>
<i>Kiti skolos vertybiniai popieriai</i>	<i>674.134,57</i>	<i>8.232.538,19</i>	<i>1.180.770,74</i>	<i>99.363,83</i>	<i>208.968,72</i>	<i>7.616.297,13</i>
Nuosavybės vertybiniai popieriai	3.712.186,99	3.571.958,93	3.239.042,98	928.082,29	963.492,36	4.009.692,87
Kolektyvinio investavimo subjektų investiciniai vienetai ir akcijos	2.702.597,93	5.395.172,94	478.737,13	937.495,56	695.743,96	7.860.785,34

Kitos investicijos							
Iš viso	15.509.210,34	20.521.894,49	8.391.675,42	2.206.364,94	2.272.980,37	27.572.813,98	

Lentelė „Turto struktūra ataskaitinio laikotarpio pabaigoje“

Turto arba emitento pavadinimas	Valsybės, į kurias 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	205422,03	0,70
DNB NORD	Lietuva	LTL	250000,00	4,300	2008-02-07	259127,72	0,88
DNB NORD	Lietuva	LTL	200000,00	5,050	2008-10-08	199233,04	0,67
DNB NORD	Lietuva	LTL	100000,00	3,250	2008-03-17	100217,72	0,34
DNB NORD	Lietuva	LTL	163500,00	4,330	2009-09-26	157979,95	0,53
BACR	Didžioji Britanija	EUR	1035840,00	4,710	2019-09-30	1017422,45	3,44
BHH bankas	Vokietija	EUR	345280,00	4,125	2017-03-28	342593,02	1,16
BHP Billiton	Australija	EUR	345280,00	4,125	2011-05-05	343785,67	1,16
Bulgarijos Respublikos Vyriausybė	Bulgarija	EUR	176092,80	7,500	2013-01-15	208913,30	0,71
Bundesimmobilien Gesellschaft mbH	Austrija	EUR	586976,00	4,625	2012-09-27	594804,39	2,01
CAISSE REF. HYPOTHEK	Prancūzija	EUR	172640,00	3,500	2017-04-25	160864,62	0,54
CBRD bankas	Kroatija	EUR	376355,20	5,000	2017-06-14	375258,94	1,27
CEZ AS	Čekija	EUR	172640,00	4,125	2013-10-17	163437,53	0,55
Deutsche Genoss.-Hypothekenbank AG	Vokietija	EUR	690560,00	5,500	2010-04-01	733937,04	2,48
EESTI ENERGIA	Estija	EUR	31075,20	4,500	2020-11-18	29598,81	0,10
ERAP (su Prancūzijos vyriausybės garantija)	Prancūzija	EUR	690560,00	3,375	2008-04-25	704131,49	2,38
ERAP (su Prancūzijos vyriausybės garantija)	Prancūzija	EUR	276224,00	3,750	2010-04-25	280104,17	0,95
EUROHYPO SA	Liuksemburgas	EUR	690560,00	4,250	2018-06-04	679943,97	2,30
Europos investicijų bankas	Liuksemburgas	EUR	355638,40	3,625	2013-10-15	345313,51	1,17
Ispanijos Vyriausybė	Ispanija	EUR	241696,00	5,500	2017-07-30	266958,00	0,90
Kesko Oyj	Estija	LTL	500000,00	-	2008-05-29	484974,28	1,64
KFW (su Vokietijos vyriausybės garantija)	Vokietija	EUR	863200,00	4,125	2017-07-04	854740,75	2,89
Kipro Vyriausybė	Kipras	EUR	1035840,00	5,500	2012-02-27	1114346,54	3,77
Kroatijos Respublikos Vyriausybė	Kroatija	EUR	100131,20	5,000	2014-04-15	102716,50	0,35
Landwirtschaftliche Rentenbank (su Vokietijos vyriausybės garantija)	Vokietija	EUR	207168,00	4,125	2009-04-30	212302,57	0,72
Latvijos Respublikos Vyriausybė	Latvija	LVL	748023,80	5,000	2011-11-03	728852,18	2,47
Latvijos Respublikos Vyriausybė	Latvija	EUR	62150,40	5,375	2008-11-27	62795,56	0,21
Latvijos Respublikos Vyriausybė	Latvija	EUR	379808,00	4,250	2014-04-02	379855,61	1,29
Lenkijos Respublikos Vyriausybė	Lenkija	EUR	165734,40	5,500	2011-02-14	178329,22	0,60
Lenkijos Respublikos Vyriausybė	Lenkija	EUR	103584,00	4,500	2013-02-05	107193,75	0,36
Lietuvos Respublikos Vyriausybė	Lietuva	EUR	362544,00	3,750	2016-02-10	347950,63	1,18
Lietuvos Respublikos Vyriausybė	Lietuva	EUR	103584,00	4,850	2018-02-07	103448,81	0,35
OEBB Infrastruktur Bau AG (su Austrijos vyriausybės garantija)	Austrija	EUR	483392,00	3,875	2016-10-18	463081,33	1,57
Olandijos Vyriausybė	Olandija	EUR	221497,12	7,500	2010-04-15	249444,70	0,84
Olandijos Vyriausybė	Olandija	EUR	37980,80	5,000	2011-07-15	39915,57	0,14

Romanian Commercial Bank S.A.	Rumunija	EUR	345280,00	3,750	2008-12-05	341472,88	1,16
Siemens	Olandija	EUR	345280,00	5,750	2011-07-04	363645,71	1,23
Slovakijos Respublikos Vyriausybė	Slovakija	EUR	131206,40	4,375	2017-05-15	130855,26	0,44
Suomijos Respublikos Vyriausybė	Suomija	EUR	376355,20	5,375	2013-07-04	407271,49	1,38
Tesco PLC	Didžioji Britanija	EUR	414336,00	4,750	2010-04-13	427809,86	1,45
Tiuringijos žemė	Vokietija	EUR	517920,00	4,000	2017-03-15	510376,94	1,73
Vengrijos Respublikos Vyriausybė	Vengrija	EUR	172640,00	4,875	2012-06-21	176746,25	0,60
Vokietijos Respublikos Vyriausybė	Vokietija	EUR	65603,20	3,750	2009-01-04	67867,01	0,23
Vokietijos Respublikos Vyriausybė	Vokietija	EUR	95987,84	4,500	2013-01-04	101789,11	0,34
Vokietijos Respublikos Vyriausybė	Vokietija	EUR	75961,60	3,500	2009-10-09	75856,39	0,26
Zagrebacki Holding D.O.O.	Kroatija	EUR	517920,00	5,500	2017-07-10	499649,50	1,69
Nuosavybės vertybiniai popieriai							
Corporate Express NV	Olandija	EUR	133416,19			552565,40	1,87
DSM NV	Olandija	EUR	8286,72			178164,48	0,60
DUDA S.A.	Lenkija	PLN	28775,16			215813,67	0,73
Eesti Telekom	Estija	EUR	1103,35			13465,92	0,05
Erste bank	Austrija	EUR				331572,38	1,12
Farmacol	Lenkija	PLN	1914,26			80781,77	0,27
Grammer AG	Vokietija	EUR				166459,49	0,56
Komercni Banka	Čekija	CZK	46071,90			401931,26	1,36
MATAV	Vengrija	HUF	13488,75			121398,75	0,41
PKN Orlen	Lenkija	PLN	9092,74			377530,36	1,28
Raiffeisen Intl Bank Holding AG	Austrija	EUR				287956,61	0,97
Richter Gedeon	Vengrija	HUF	3678,75			152668,13	0,52
Telekomunikacja Polska	Lenkija	PLN	33308,12			249921,96	0,85
Thiel Logistik AG	Vokietija	EUR				189904,00	0,64
TUI AG	Vokietija	EUR				689558,69	2,33
Kolektyvinio investavimo subjektai							
Asia Pacific Fund INC	JAV	USD				504063,65	1,71
Balzac Euro Index-P	Prancūzija	EUR				292633,32	0,99
East Capital Turkish Fund	Švedija	SEK				951698,03	3,22
Hansa Russian Equity Fund E-unit	Estija	EUR				629126,68	2,13
ISHARES DJ STOXX 50	Airija	EUR				63721,42	0,22
ISHARES MSCI JAPAN INDEX FUND	JAV	USD				642570,55	2,17
ISHARES PLC-IFTSE 100	Airija	EUR				197724,59	0,67
ISHARES S&P LATIN AMERICA 40	JAV	USD				1267289,65	4,29
ISHARES S&P500/BARRA GROWTH	JAV	USD				1218596,78	4,12
State Street Europe Actions	Prancūzija	EUR				264539,31	0,90
State Street Midcap Europe	Prancūzija	EUR				248616,55	0,84
Trigon New Europe Small Cap Fund	Estija	EUR				703835,10	2,38
Trigon Second Wave Fund	Estija	EUR				876369,71	2,97
Pinigai							
AB bankas "Hansabankas"		LTL				22248,53	0,08
Indėliai							
AB bankas "Hansabankas"		LTL		4,500	2008-01-02	1201350,00	4,07
AB bankas "Hansabankas"		LTL		3,200	2008-01-02	500044,44	1,69
Kitas turtas							
Gautinos sumos		EUR				116861,92	0,40
Gautinos sumos		USD				135207,83	0,46
Iš viso:						29548526,70	100,00

1 pastaba “Pinigai ir pinigų ekvivalentai”

2007-12-31 dieną sudarė šios sumos:
Likutis gryniaisiais pinigais 22248,53 LTL .

2 pastaba “ Kitos gautinos sumos”

2007-12-31 dieną kitas gautinas sumas sudarė:

gautini dividendai	35207,83 LTL
išvestinių finansinių priemonių tikroji vertė	111846,90 LTL
kitos gautinos sumos	5015,02 LTL

3 pastaba “Mokėtinos sumos kaupimo bendrovei ir depozitoriumui”

2007-12-31 dieną sudarė 21733,09 LTL gautinas atskaitymas nuo pensijų fondo turto vertės už 2007 m. gruodžio mėnesį.

4 pastaba “Palūkanos ir dividendai”

2007-12-31 dieną sudarė šios sumos:	
palūkanos iš trumpalaikių indėlių	13933,93 LTL
skolos vertybinių popierių atkarpos mokėjimai	829853,87 LTL

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

2007-12-31 dieną sudarė banke turimų piniginių lėšų kursų pasikeitimas.

6 pastaba “ Kitos sąnaudos”

2007-12-31 Kitos sąnaudos susidarė dėl 2006 metais investicijų valdymo įmonės “ERGO Varahalduse AS” netiksliai apskaitytos valiutos pirkimo pardavimo sandorio kurso pokyčio koregavimo 2007 metų pradžioje.

VII. Informacija apie pensijų fondo dalyvius

25. Bendri duomenys apie pensijų fondo dalyvius:

		Dalyvių skaičius, vnt.
Ataskaitinio laikotarpio pradžioje:		11135
Prisijungę per ataskaitinį laikotarpį, iš viso:		10974
	Pirmą kartą sudarę pensijų kaupimo sutartis	10457
	Atėję iš kitų pensijų fondų, iš viso:	517
	iš tos pačios pensijų kaupimo bendrovės	379
	iš kitos pensijų kaupimo bendrovės	138
Pasitraukę per ataskaitinį laikotarpį, iš viso:		282
	Baigę dalyvavimą pensijų kaupime, iš viso:	104
	Gavę pensijų išmokas	3
	Pasinaudoję galimybe pasitraukti iš pensijų fondo per 30 dienų nuo sutarties pasirašymo	93
	Mirę	8
	Perėję į kitus pensijų fondus, iš viso:	178
	iš tos pačios pensijų kaupimo bendrovės	1
	iš kitos pensijų kaupimo bendrovės	177
Ataskaitinio laikotarpio pabaigoje, iš viso:		21827
	Pasinaudoję teise nukelti pensijų išmokos mokėjimą	10
	Gaunantys periodines pensijų išmokas	0
Pokytis		10692

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:	21827	9880	8826	3103	18
	Vyrai	10587	5169	3958	1444	16
	Moterys	11240	4711	4868	1659	2
Dalyvių dalis, %	Iš viso:	100,0	45,3	40,4	14,2	0,1
	Vyrai	48,5	23,7	18,1	6,6	0,1
	Moterys	51,5	21,6	22,3	7,6	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