

**PAPILDOMO SAVANORIŠKO PENSIJŲ KAUPIMO FONDO
"DNB NORD PAPILDOMA PENSIJA"**

2009 METŲ II KETVIRČIO ATASKAITA

Vilnius, 2009 m.

TURINYS

I. BENDROSIOS NUOSTATOS	4
1. Pagrindiniai duomenys apie pensijų fondą	4
2. Pagrindiniai duomenys apie valdymo įmonę	4
3. Asmenys, atsakingi už ataskaitoje pateiktą informaciją	4
4. Duomenys apie depozitoriumą	4
5. Ataskaitinis laikotarpis, už kurį parengta metų ataskaita	4
II. GRYNŲJŲ AKTYVŲ, APSKAITOS VIENETŲ SKAIČIUS IR VERTĖS POKYČIAI	4
6. Grynųjų aktyvų, apskaitos vienetų skaičius ir vertės pokyčiai	4
7. Konvertuotų apskaitos vienetų skaičius bei bendros konvertavimo sumos	5
III. ATSKAITYMAI IŠ PENSIJŲ TURTO	5
8. Atskaitymai iš pensijų turto	5
9. Mokesčiai tarpininkams	5
10. Informacija apie egzistuojančius susitarimus dėl mokesčių pasidalinimo bei paslėptuosius mokesčius	5
11. Mokesčių įtaka galutinei dalyviui tenkančiai investicijų gražai	5
IV. INFORMACIJA APIE PENSIJŲ FONDO INVESTICIJŲ PORTFELĮ	6
12. Ataskaitinio laikotarpio pabaigos investicijų portfelio sudėtis	6
13. Investicijų pasiskirstymas	11
14. Per ataskaitinį laikotarpį įvykdyti sandoriai su išvestinėmis investicinėmis priemonėmis, išskyrus tuos, kurie nurodyti šio priedo 12 punkte (pagal išvestinių investicinių priemonių rūšis nurodyti sandorių vertes, išvestinių investicinių priemonių panaudojimo tikslus (valiutų keitimo, palūkanų normos, susiję su nuosavybe, ir kt.), sandorius reguliuojamose rinkose ir šalių tarpusavio sandorius bei kitą svarbią informaciją)	11
15. Aprašyti šio priedo 12 punkte nurodytų išvestinių priemonių rūšis, su jomis susijusią riziką, kiekybines ribas ir metodus, kuriais vertinama su išvestinių investicinių priemonių sandoriais susijusi pensijų fondo rizika, ir nurodyti, kaip panaudojama išvestinė investicinė priemonė gali apsaugoti investicinį sandorį (investicinę poziciją) nuo rizikos.	11
16. Bendra įsipareigojimų, kylančių iš sandorių su išvestinėmis investicinėmis priemonėmis, vertė ataskaitinio laikotarpio pabaigoje (atskirai nurodyti sumas pagal skirtingas įsigytų išvestinių investicinių priemonių kategorijas).	11
17. Pateikti analizę, kaip turimas investicijų portfelis atitinka (neatitinka) pensijų fondo investavimo strategiją (investicijų kryptis, investicijų specializaciją, geografinę zoną ir pan.)	12
18. Nurodyti veiksniai, kurie turėjo didžiausią įtaką per ataskaitinį laikotarpį investicijų portfelio struktūros ir jo vertės pokyčiams.	12
V. INFORMACIJA APIE PENSIJŲ FONDO INVESTICIJŲ PORTFELĮ	12
VI. PENSIJŲ FONDO INVESTICIJŲ GRAŽA IR RIZIKOS RODIKLIAI	12
VII. PENSIJŲ FONDO FINANSINĖ BŪKLĖ	12
24. Pensijų fondo finansinės ataskaitos parengtos vadovaujantis LR įstatymų ir teisės aktų reikalavimais	12
VII. INFORMACIJA APIE PENSIJŲ FONDO DALYVIUS	23
25. Bendri duomenys apie pensijų fondo dalyvius	23
26. Per ataskaitinį laikotarpį prisijungusių dalyvių skaičius	23
27. Per ataskaitinį laikotarpį pasitraukusių dalyvių skaičius	23
28. Pensijų fondo dalyvių struktūra	24
VIII. IŠORINIAI PINIGŲ SRAUTAI	24
29. Per ataskaitinį laikotarpį faktiškai gautos lėšos	24
30. Per ataskaitinį laikotarpį išmokėtos lėšos	24
IX. INFORMACIJA APIE GARANTIJŲ REZERVĄ	25
31. Jei pensijų fondo taisyklėse numatytas įsipareigojimas garantuoti tam tikrą pajamingumą, nurodyti garantuojamo pajamingumo dydį, per ataskaitinį laikotarpį į garantinį rezervą įmokėtų įmokų sumą, pateikti jo investicijų portfelį, jei buvo panaudotas, nurodyti panaudojimo priežastis, panaudotą sumą, rezervo dydį ataskaitinio laikotarpio pabaigoje ir kitą svarbią informaciją	25
X. INFORMACIJA APIE PENSIJŲ FONDO REIKMĖMS PASISKOLINTAS LĖŠAS	25

32. Pensijų fondo reikmėms pasiskolintos lėšos.....	25
XI. KITI REIKALAVIMAI.....	25
33. Paaiškinimai ir komentarai apie pensijų fondo veiklą	25
34. Informacija apie konsultantus	26
35. Informacija apie ataskaitą parengusius asmenis (jei jie nėra bendrovės darbuotojai).....	26
36. Už ataskaitos parengimą atsakingų Įmonės valdymo organų narių, darbuotojų ir administracijos vadovo patvirtinimas, kad ataskaitoje pateikta informacija atitinka tikrovę ir nėra nutylėtų faktų, galinčių daryti esminę įtaką pensijų fondo veiklos rezultatų vertinimui	26

I. BENDROSIOS NUOSTATOS

1. Pagrindiniai duomenys apie pensijų fondą

Pensijų fondo pavadinimas: Papildomo savanoriško pensijų kaupimo fondas "DnB NORD papildoma pensija"
Pensijų fondo taisyklių pavadinimas: Papildomo savanoriško pensijų kaupimo fondo "DnB NORD papildoma pensija" taisyklės
Pensijų fondo taisyklių numeris: PF-S01-K003-019(002)

2. Pagrindiniai duomenys apie valdymo įmonę

Pavadinimas: UAB DnB NORD investicijų valdymas
Įmonės kodas: 226299280
Buveinės adresas: J. Basanavičiaus g. 26, 03601 Vilnius-6, Lietuva
Tel: (8-5) 2393 567, (8-5) 2393 773.
Faks: (8-5) 2393 473.
Elektroninio pašto adresas: investicija@dnbnord.lt
Leidimo verstis valdymo įmonės veikla numeris: VĮK -003
Pensijų fondo valdytojas: Loreta Načajienė

3. Asmenys, atsakingi už ataskaitoje pateiktą informaciją

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

Generalinis direktorius	Šarūnas Ruzgys	Tel: (8-5) 2393 567 Faks: (8-5) 2393 473 Sarunas.Ruzgys@dnbnord.lt
Vyriausioji finansininkė	Dalia Vaitulevičienė	Tel: (8-5) 2393 510 Faks: (8-5) 2393 473 Dalia.Vaituleviciene@dnbnord.lt

3.2. Už ataskaitą atsakingi konsultantai

Rengiant šią ataskaitą konsultantų paslaugomis nebuvo naudojamosi.

4. Duomenys apie depozitoriumą

Depozitoriumo pavadinimas: AB DnB NORD bankas (toliau tekste – Depozitoriumas)
Registracijos kodas: 112029270
Buveinės adresas: J. Basanavičiaus g. 26, Vilnius, Lietuva
Tel.: (8-5) 213 90 60, (8-5) 239 37 71, (8-5) 239 37 74
Faks.: (8-5) 239 37 83

5. Ataskaitinis laikotarpis, už kurį parengta metų ataskaita

Ataskaita parengta už laikotarpį nuo 2009 m. sausio 1 d. iki 2009 m. birželio 30 d.

II. GRYNŲJŲ AKTYVŲ, APSKAITOS VIENETŲ SKAIČIUS IR VERTĖS POKYČIAI

6. Grynujų aktyvų, apskaitos vienetų skaičius ir vertės pokyčiai

	Ataskaitinio laikotarpio pradžioje (2008 12 31)	Ataskaitinio laikotarpio pabaigoje (2009 06 30)	Prieš metus (2008 06 30)	Prieš dvejus metus (2007 06 30)
GAV	13 581 271	13 927 166	17 794 431	14 504 517
APSKAITOS VIENETO VERTĖ (LT)	0,9089	1,0006	1,1123	1,1741
APSKAITOS VIENETŲ SKAIČIUS	14 942 099	13 918 598	15 997 256	11 923 138

7. Konvertuotų apskaitos vienetų skaičius bei bendros konvertavimo sumos

	Apskaitos vienetų skaičius	Vertė (Lt)
Vienetų skaičius (konvertuojant pinigines lėšas į apskaitos vienetus)	430 564	406 104
Vienetų skaičius (konvertuojant vienetus į pinigines lėšas)	1 454 065	1 360 075

III. ATSKAITYMAI IŠ PENSIJŲ TURTO

8. Atskaitymai iš pensijų turto

Atskaitymai	Mokesčio dydis		Per ataskaitinį laikotarpį priskaičiuotų mokesčių suma (Lt)	Per ataskaitinį laikotarpį sumokėtų mokesčių suma (Lt)	% nuo ataskaitinio laikotarpio vidutinės grynujų aktyvų vertės
	maksimalus, nustatytas sudarymo dokumentuose	ataskaitiniu laikotarpiu taikytas			
Valdymo mokestis:	1,50%	1,50%	97 173	96 742	0.72%
<i>nekintamas mokestis</i>	1,50%	1,50%	97 173	96 742	0.72%
<i>sėkmės mokestis</i>	-	-	-	-	-
Depozitoriumo mokestis	0.25%	0.15%	9 782	9 739	0.07%
Sandorių sudarymo išlaidos	****	****	958	958	0.01%
Audito išlaidos	***	***	2 229	4 584	0.02%
Kitos veiklos išlaidos (Išlaidos už bankines paslaugas)	***	***	4	4	0.00%
Išlaidų, įskaičiuojamų į BIK, suma			-		
BIK % nuo GAV *			-		
Visų išlaidų suma			110 147	112 026	0.81%
PAR (praėjusio analogiško ataskaitinio laikotarpio PAR)**			-		

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

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

***Išlaidos, dengiamos iš Pensijų turto, tai išlaidos už bankines paslaugas, Pensijų fondo audito išlaidos ir sandorių sudarymo išlaidos bendras maksimalus išvardintų išlaidų dydis negali viršyti 1.5 procento per vienerius finansinius metus nuo Pensijų fondo grynujų aktyvų vertės. Pensijų fondo sąskaita bei Pensijų fondo interesais sudaromų sandorių faktinės išlaidos pagal sutartis tarpininkams, sudarančios ne daugiau kaip 1 procentą nuo sudarytų sandorių vertės, bet ne mažiau kaip 25 Lt nuo kiekvieno sandorio.

9. Mokesčiai tarpininkams

Per ataskaitinį laikotarpį sumokėta AB bankas DnB NORD Lietuva Investicinės bankininkystės departamento Kapitalo rinkų skyriui 958 Lt už tarpininkavimo paslaugas vertybinių popierių sandoriuose.

10. Informacija apie egzistuojančius susitarimus dėl mokesčių pasidalinimo bei paslėptuosius mokesčius

-

11. Mokesčių įtaka galutinei dalyviui tenkančiai investicijų grąžai

-

IV. Informacija apie pensijų fondo investicijų portfelį

12. Ataskaitinio laikotarpio pabaigos investicijų portfelio sudėtis

Kodas	Emitento (KIS, kredito įstaigos, banko pavadinimas)	Šalis	ISIN kodas / Priemonės pavadinimas	Valiuta	Kiekis, vnt.	Valdytojas	Bendra nominali vertė, Lt	Bendra įsigijimo vertė, Lt	Bendra rinkos vertė, Lt	Palūkanų norma, %	Rinka (šaltinis), pagal kurios duomenis nustatyta rinkos vertė (tinklalapio adresas)	KIS tipas	Išpirkimo / konvertavimo data / terminas	Dalis GA, %
1	2	3	4	5	6	7	8	12	13	14	15	16	18	19
1	Nuosavybės vertybiniai popieriai													
1.1	Nuosavybės vertybiniai popieriai, itraukti i Oficialuji ar ji atitinkanti prekybos saraša													
-	AB TEO LT	LT	LT0000123911	LTL	37 479		37 479	90 364	41 602		www.market.lt .omxgroup.com			0.30
	Iš viso:				37 479		37 479	90 364	41 602					0.30
1.2	Nuosavybės vertybiniai popieriai, itraukti i Papildomaji ar ji atitinkanti prekybos saraša													
-														
	Iš viso:													
1.3	Nuosavybės vertybiniai popieriai, kuriais prekiaujama kitose reguliuojamose rinkose													
-														
	Iš viso:													
1.5	Išleidžiami nauji nuosavybės vertybiniai popieriai													
-														
	Iš viso:													
	Iš viso Nuosavybės vertybiniai popieriai:				37 479		37 479	90 364	41 602					0.30
2	Ne nuosavybės vertybiniai popieriai													
1.4	Ne nuosavybės vertybiniai popieriai, kuriais prekiaujama reguliuojamose rinkose, kurios specializuojasi mažų ir vidutinių įmonių srityje													
-														
	Iš viso:													
2.1	Ne nuosavybės vertybiniai popieriai, itraukti i Oficialuji ar ji atitinkanti prekybos saraša													
-														
	Iš viso:													
2.2	Ne nuosavybės vertybiniai popieriai, itraukti i Papildomaji ar ji atitinkanti prekybos saraša													
-	Lietuvos Respublika	LT	LT0000605099	LTL	1 000		100 000	103 722	103 700	4.80			2009.07.16	0.74
-	Lietuvos Respublika	LT	LT0000607046	LTL	500		50 000	54 377	49 831	9.00			2010.02.11	0.36
-	Lietuvos Respublika	LT	LT0000611014	LTL	7 300		730 000	699 162	433 772	13.84			2016.02.10	3.11
-	AB DnB NORD bankas	LT	LT0000403388	LTL	1 390		139 000	138 950	142 140	8.99			2009.09.26	1.02
-	AB" Pieno žvaigždės"	LT	LT0000403354	LTL	700		70 000	69 979	70 391	18.75			2009.10.02	0.51
-	AB SEB VB	LT	LT0000402299	LTL	10 000		1 000 000	998 184	996 402	10.10			2010.03.09	7.15
-	Lietuvos Respublika	LT	LT1000600023	EUR	194		736 828	684 678	706 999	6.60			2010.02.22	5.08

Pensijų fondas "DnB NORD papildoma pensija"

Ataskaita už 2009 m. II ketvirtį

-	Lietuvos Respublika	LT	LT0000601833	LTL	7 200		720 000	689 847	710 488	7.65			2009.09.02	5.10
-	Lietuvos Respublika	LT	LT1000600064	EUR	94		324 563	300 427	308 099	6.70			2010.04.20	2.21
	Iš viso:				28 378		3 870 391	3 739 326	3 521 822					25.29
2.3 Ne nuosavybes vertybiniai popieriai, kuriai prekiaujama kitose reguliuojamose rinkose														
-	Slovakijos Respublika	SK	DE0001074763	EUR	47		162 282	169 584	170 990	2.44			2010.04.14	1.23
-	PEMEX	US	XS0166205053	EUR	25		86 320	91 434	89 759	3.37			2010.04.04	0.64
-	Turkijos Respublikos VVP	TR	XS0201333761	EUR	50		172 640	181 803	180 486	4.17			2009.09.21	1.30
-	HOLCIM FINANCE LUX SA	LU	XS0170227093	EUR	19		65 603	68 784	66 830	2.53			2010.06.23	0.48
-	BPB PLC	GB	XS0109134113	EUR	25		86 320	96 396	89 663	3.59			2010.03.17	0.64
-	GE CAPITAL EURO FUND	IE	XS0196856834	EUR	22		75 962	75 779	78 548	6.41			2009.07.22	0.56
-	IBM CORP	US	XS0212050792	EUR	23		79 414	77 223	80 893	1.85			2010.02.08	0.58
-	DEUTSCHE TELEKOM INT FIN	NL	XS0210319090	EUR	23		79 414	77 559	81 137	1.93			2010.01.19	0.58
-	AB Bankas Snoras	LT	XS0301140512	EUR	101		348 733	344 123	177 242	125.29			2010.05.21	1.27
-	FRANCE TELECOM	FR	XS0286704787	EUR	111		383 261	374 231	406 380	2.60			2012.02.21	2.92
-	Vodafone Group PLC	GB	XS0236598164	EUR	200		690 560	651 832	710 208	3.40			2012.11.29	5.10
-	RWE FINANCE BV	NL	XS0147030554	EUR	50		172 640	184 559	195 558	3.19			2012.10.26	1.40
-	TELEFONICA EM. 06/16	ES	XS0241946630	EUR	60		207 168	189 091	205 366	4.86			2016.02.02	1.47
-	GE CAPITAL EURO FUND	IE	XS0244082219	EUR	60		207 168	197 410	207 340	3.87			2013.02.14	1.49
-	EWE AG	DE	DE000A0DLU51	EUR	60		207 168	199 710	214 710	4.26			2014.10.14	1.54
-	Lietuvos Respublika	LT	XS0163880502	EUR	93		321 110	257 191	281 741	9.05			2013.03.05	2.02
-	Dangas	LU	XS0253170335	EUR	90		310 752	304 723	321 635	2.85			2011.06.21	2.31
-	CARGILL INC	US	XS0252760607	EUR	27		93 226	85 768	94 511	4.20			2013.04.29	0.68
-	CEZCO	CZ	XS0271020850	EUR	25		86 320	80 062	87 293	4.59			2013.10.17	0.63
-	Olandijos Karalystės	NL	NL0006173015	EUR	50		172 640	170 530	182 708	1.36			2011.01.15	1.31
-	Lietuvos Respublika	LT	XS0435153068	EUR	35		120 848	121 493	123 425	8.90			2014.06.22	0.89
	Iš viso:				1 196		4 129 549	3 999 287	4 046 422					29.05
2.4 Išleidžiami nauji ne nuosavybes vertybiniai popieriai														
-	AB DnB NORD bankas	LT	LT0000401978	LTL	700		70 000	63 497	63 631	10.75			2010.06.07	0.46
	Iš viso:				700		70 000	63 497	63 631					0.46
	Iš viso Obligacijos:				30 274		8 069 940	7 802 109	7 631 875					54.80
3 KIS														
3.1 Kolektyvinių investavimo subjektu, atitinkančių Kolektyvinio investavimo subjektų 61 str. 1d. reikalavimus, vienetai (akcijos)														
-	BL-EQUITIES EUROPE	LU	LU0093570330	EUR	35	BANQUE DE LUXEMBOURG S. A.		291 637	305 481		www.bdl.lu	KIS 3		2.19
-	Nordea 1 North American Value Fund	LU	LU0076314649	USD	1 580	Nordea Investment Funds S. A.		274 323	82 583		www.nordea.lu	KIS 3		0.59
-	Nordea 1 European Value Fund	LU	LU0064319337	EUR	2 300	Nordea Investment Funds S. A.		463 633	185 989		www.nordea.lu	KIS 3		1.34
-	iShares FTSEurofirst 80	IE	IE0004855221	EUR	5 790	Barclays Global Investors LTD		197 248	148 538		www.londonstockexchange.c	KIS 3		1.07

Pensiju fondas "DnB NORD papildoma pensija"

Ataskaita už 2009 m. II ketvirtį

-	Pioneer Funds - European Small Companies	LU	LU0133552405	EUR	9 100	Pioneer Asset Management S.A		279 086	194 179		www.pioneerinvestments.com	KIS 3		1.39
-	Pictet Emerging Markets	LU	LU0188499254	USD	450	Pictet Gestion (Luxembourg) S.A.		170 088	192 877		www.pictetfunds.com	KIS 3		1.38
-	Nordea Nordic Equity fund	LU	LU0064675639	EUR	1 056	Nordea Investment Funds S. A.		271 755	126 959		www.nordea.lu	KIS 3		0.91
-	European Telecom P CAP	LU	LU0119206919	EUR	498	ING (L) Invest		311 842	218 376		www.ing.lu	KIS 3		1.57
-	Nordea 1 Danish Equity Fund	LU	LU0081951880	DKK	65	Nordea Investment Funds S. A.		6 093	4 345		www.nordea.lu	KIS 3		0.03
-	Evli Greater Russia B	FI	FI0008807565	EUR	314	Evli Greater Russia Managment LTD		253 781	112 566		www.evli.com	KIS 3		0.81
-	Morgan ST US Equity Growth Stanley Fund	LU	LU0073232471	USD	7 883	Morgan Standley Investment Management		603 730	474 412		www.Morganstanley.com	KIS 3		3.41
-	Fidelity German Funds	LU	LU0048580004	EUR	1 299	Fidelity International Ltd/Bermuda		125 154	82 757		www.fidelity-international.com	KIS 3		0.59
-	JPMorgan F-Emerg Euro EQ-A\$ Fund	LU	LU0074838565	USD	450	JPMorgan Asset Managment Europe SAR		54 759	42 705		www.Morganstanley.com	KIS 3		0.31
-	HSBC Asia ex Japan Fund	LU	LU0043850808	USD	1 648	HSBC Investments Hong Kong Ltd/Hong		117 396	144 756		www.hsbcame.com	KIS 3		1.04
-	Franklin Templeton Investment Funds	LU	LU0078277505	EUR	548	Franklin Templeton Investment Funds		58 698	35 162		www.templeton.lu	KIS 3		0.25
-	Vanguard US 500 STK	IE	IE0002639668	USD	5 117	Vanguard Group Inc		124 156	115 850		www.globalvanguard.com	KIS 3		0.83
-	DWS Invest BRIC PLUS-FC	LU	LU0210302369	EUR	166	DWS Invest SA		164 764	91 740		www.globalvanguard.com	KIS 3		0.66
-	Vanguard INV 'EURZ STK IDX'	IE	IE0008248803	EUR	585	Vanguard Group Inc		296 647	185 598		www.globalvanguard.com	KIS 3		1.33
-	HENDERSON HORIZ-PAN EU SC-A2	LU	LU0046217351	EUR	2 274	Henderson Glabal Investor Ltd/Unite		188 186	99 251		www.henderson.com	KIS 3		0.71
-	Vanguard INV 'GLOB STK IDX'	IE	IE00B03HCZ61	EUR	6 950	Vanguard Group Inc		286 642	183 510		www.globalvanguard.com	KIS 3		1.32
-	HSBC GIF - GL EM MKT	LU	LU0234596715	USD	13 271	HSB MED LX		373 530	298 160		www.hsbcame.com	KIS 3		2.14
-	Pictet Emerging Markets	LU	LU0148538712	USD	183	Pictet Gestion (Luxembourg) S.A.		96 108	92 250		www.pictetfunds.com	KIS 3		0.66
-	ING (L) Invest Computer Technologies	LU	LU0119200128	USD	34	ING (L) Invest		53 313	42 237		www.ing.lu	KIS 3		0.30
-	Franklin Templeton Inv Lat	LU	LU0128526570	USD	1 746	Franklin Templeton Investment Funds		239 936	255 645		www.templeton.lu	KIS 3		1.84
-	Fidelity Pasific Fund	LU	LU0049112450	USD	6 083	Fidelity		285 866	206 267		www.fidelity-	KIS 3		1.48

Pensijų fondas "DnB NORD papildoma pensija"

Ataskaita už 2009 m. II ketvirtį

-	Fidelity Fnds-Nordic Funds A	LU	LU0048588080	SEK	211	International Ltd/Bermuda Fidelity International Ltd/Bermuda		44 874	31 084	www.international.com	KIS 3		0.22
-	Fidelity Fnds-European	LU	LU0083291335	EUR	2 810	Fidelity International Ltd/Bermuda		200 839	86 400	www.fidelity-international.com	KIS 3		0.62
-	JPM Emerging Markets Equity	LU	LU0073229840	USD	2 290	Morgan Standley Investment Management		183 857	148 925	www.Morganstanley.com	KIS 3		1.07
-	Carlson Equity Asian Small Cap Fund	LU	LU0067059799	EUR	3 637	Carlson Fund Management Luxembourg		67 675	43 525	www.carlsonfund.de	KIS 3		0.31
-	JPM Emerging Markets Equity	LU	LU0217576759	EUR	1 771	JP Morgan Asset Management		69 325	54 592	www.jpmorganfleming.com	KIS 3		0.39
-	Schroder ISF EURO Equity C ACC	LU	LU0106235459	EUR	4 810	Schroder ISF EURO Equity C ACC		494 289	299 463	www.schroders.com	KIS 3		2.15
-	INVESCO ASEAN Equity Fund A	IE	IE0003702317	USD	603	INVESCO Asset Management Ireland		152 786	89 895	www.de.invesco.com	KIS 3		0.65
-	Morgan Stanl. Europe, Middle East & Nor. Africa	LU	LU0118140002	EUR	298	Morgan Standley Investment Management		82 380	39 811	www.Morganstanley.com	KIS 3		0.29
-	JPM MIDDLE EAST EQUITY A (DIST) - USD	LU	LU0083573666	USD	5 611	JP Morgan Asset Management		449 824	249 319	www.Morganstanley.com	KIS 3		1.79
-	DnB NORD obligacijų fondas	LT	LTIF00000161	LTL	55 918	UAB DnB NORD investicijų valdymas		60 000	62 578	www.dnbnord.lt	KIS 1		0.45
-	Fidelity Global Health Care Fund	LU	LU0114720955	EUR	3 128	Fidelity International Ltd/Bermuda		131 206	133 798	www.fidelity-international.com	KIS 3		0.96
-	FORTIS L FUND EQUITY HIGH DIVIDEND USA C	LU	LU0377083059	USD	260	Fortis Investment Management Lux		35 874	34 586	www.fortisinvestments.com	KIS 3		0.25
-	FORTIS L FUND EQUITY ENERGY WORLD C	LU	LU0080608945	EUR	92	Fortis Investment Management Lux		140 889	140 652	www.fortisinvestments.com	KIS 3		1.01
-	Parvest-Agriculture Classic Cap. Eur	LU	LU0363509208	EUR	582	BNP Paribas Asset Management Luxembourg		167 052	171 935	www.bnpparibas-am.com	KIS 3		1.23
-	Schroder ISF Emerg Asia A EUR Acc Fund	LU	LU0248172537	EUR	2 875	Schroder Investment Management S.A.		103 052	122 411	www.schroders.lu	KIS 3		0.88
	Iš viso:				154 322			7 972 292	5 631 166				40.43
3.2	Kitu kolektyvinių investavimo subjektų vienetai												
-													

13. Investicijų pasiskirstymas
13.1. pagal valiutas ir geografinę zoną

Investicijų pasiskirstymas	Rinkos vertė	Dalis aktyvuose (%)	Rinkos vertė ataskaitinio laikotarpio pradžioje	Dalis aktyvuose ataskaitinio laikotarpio pradžioje (%)
Pagal valiutas:				
DKK	4 345	0.03	3 368	0.02
EUR	8 228 627	59.08	7 340 713	54.05
LTL	3 213 940	23.08	4 373 899	32.21
SEK	31 084	0.22	26 898	0.20
USD	2 470 467	17.74	1 859 570	13.69
Iš viso:	13 948 464	100	13 604 448	100
Pagal geografinę zoną:				
Europos ekonominės erdvės valstybės (Islandija, Norvegija, Lichtenšteinas)	-	-	-	-
Kitos Europos Sąjungos valstybės	8 691 341	62.41	8 240 439	60.68
Japonija	-	-	-	-
Lietuva	4 811 475	34.55	4 865 363	35.82
Kitos šalys	180 486	1.30	173 757	1.28
Jungtinės Amerikos Valstijos ir Kanada	265 163	1.90	324 889	2.39
Iš viso:	13 948 464	100	13 604 448	100
Pagal investavimo objektus:				
Akcijos	41 602	0.30	43 476	0.32
Akcijų kolektyvinio investavimo subjektai (akcijų fondai)	5 631 166	40.43	4 576 283	33.70
Vyriausybės VP	3 252 239	23.35	1 981 342	14.59
Kitos obligacijos	4 379 636	31.45	5 733 129	42.21
Pinigai ir pinigų ekvivalentai	643 821	4.62	1 270 219	9.35
Iš viso:	13 948 464	100	13 604 448	58

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

14. Per ataskaitinį laikotarpį įvykdyti sandoriai su išvestinėmis investicinėmis priemonėmis, išskyrus tuos, kurie nurodyti šio priedo 12 punkte (pagal išvestinių investicinių priemonių rūšis nurodyti sandorių vertes, išvestinių investicinių priemonių panaudojimo tikslus (valiutų keitimo, palūkanų normos, susiję su nuosavybe, ir kt.), sandorius reguliuojamose rinkose ir šalių tarpusavio sandorius bei kitą svarbią informaciją)

15. Aprašyti šio priedo 12 punkte nurodytų išvestinių priemonių rūšis, su jomis susijusią riziką, kiekybines ribas ir metodus, kuriais vertinama su išvestinių investicinių priemonių sandoriais susijusi pensijų fondo rizika, ir nurodyti, kaip panaudojama išvestinė investicinė priemonė gali apsaugoti investicinį sandorį (investicinę poziciją) nuo rizikos.

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

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

Pensijų fondo investavimo strategija remiasi prielaida, pagrįsta daugelio Dalyvių ilgalaikiu investavimo horizontu, todėl iki 50 procentų Pensijų fondo grynujų aktyvų lėšų gali būti investuojama akcijų rinkose, prisiimant su tuo susijusią riziką, ir siekiant aukštesnio pelningumo ilgu laikotarpiu. Didesnį tikėtiną akcijų rinkų pelningumo svyravimą siekiama atsverti vidutiniškai stabilesnį pelningumą generuojančiomis investicijomis, kaip kad vyriausybės vertybiniais popieriais, kredito įstaigų ir kitų bendrovių skolos vertybiniais popieriais, indėliais ir pan., kurie turi sudaryti ne mažiau nei 50 procentų Pensijų fondo grynujų aktyvų. Investuojant specializacija geografinėje zonoje ar pramonės šakoje nėra taikoma.

Ataskaitinio laikotarpio pabaigoje Vyriausybės vertybiniai popieriai sudarė 23,35 proc. visų pensijų fondo grynujų aktyvų vertės, kiti skolos vertybiniai popieriai – 31,45 proc., investicijos į kolektyvinio investavimo subjektų vienetus sudarė 40,43 proc., nuosavybės vertybiniai popieriai – 0,30 proc., pinigai ir pinigų ekvivalentai – 4,62 proc. visų pensijų fondo grynujų aktyvų vertės.

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

Optimizmo dėl pasaulio ekonomikos atsigavimo suteikė geresni negu prognozuota daugelio JAV bankų ar stambesnių pramonės ir prekybos įmonių pirmojo ketvirčio rezultatai JAV, spartesnis Kinijos, kitų Azijos šalių ekonominis augimas. Tai atsispindėjo ir daugelio investicinių fondų rezultatuose, kai pvz. nuo kovo pradžioje matyto rinkos „dugno“ netgi plačiai diversifikuoto DnB NORD akcijų fondų fondo vertė atsitiesė 28 proc., o į akcijas investuojančio savanoriško kaupimo pensijų fondo DnB NORD papildoma pensija 100 vertė padidėjo daugiau kaip 20 proc.

Tuo pačiu didėjo ir investuotojų apetitas rizikai perkant akcijas ir kiek atsitraukiant iš obligacijų rinkos. DnB NORD investicijų valdymas fondų valdytojais antro ketvirčio eigoje taip pat nuosajiai didino akcijų dalį savo valdomuose portfeliuose.

Žinoma toks staigus kilimas vėliau kiek sulėtėjo. Tačiau vertinant globalius didžiųjų ekonomikų rodiklius panašu, kad blogiausias periodas akcijų rinkose jau praeityje. Didesnė finansų analitikų dalis linkusi matyti ilgalaikes teigiamas tendencijas, galbūt su tam tikrais periodiniais korekciniais nuokrypiais. Tinkamas privačių investuotojų sprendimas būtų nuosekliai didinti akcijų (arba akcijų fondų vienetų) dalį savo bendrame investiciniame portfelyje, prisiimant kiek daugiau rizikos, tačiau ir tikintis gana ženklaus kapitalo prieaugio per vidutinės trukmės laikotarpį.

Antrąjį 2009 metų ketvirtį saugių investicijų poreikis nors ir išliko, tačiau jis šiek tiek sumažėjo, užleisdamas vietą beatsigaunančioms investicijoms į akcijų, t.y. rizikingesnes rinkas.

Lietuvos Respublikos Vyriausybės vertybinių popierių vertė ir toliau kilo, dėl mažėjusių palūkanų normų.

Tai lėmė gerėjanti situacija kredito rinkose. Šių investicijų paklausa vis dar išliko dėl prieš tai buvusio gana didelio jų nuvertinimo tarptautinėse rinkose.

Ataskaitos 33 punkte pateikta pensijų fondo investicijų struktūra 2009 m. birželio 30 d. bei pensijų fondo apskaitos vieneto vertės kitimas nuo įsteigimo iki 2009 06 30.

V. INFORMACIJA APIE PENSIJŲ FONDO INVESTICIJŲ PORTFELĮ

VI. PENSIJŲ FONDO INVESTICIJŲ GRAŽA IR RIZIKOS RODIKLIAI

VII. PENSIJŲ FONDO FINANSINĖ BŪKLĖ

24. Pensijų fondo finansinės ataskaitos parengtos vadovaujantis LR įstatymų ir teisės aktų reikalavimais

24.1. Pensijų fondo balansas

UAB DnB NORD investicijų valdymas
(Kaupimo bendrovės pavadinimas)

226299280, J. Basanavičiaus g. 26, Vilnius, Lietuva
(Kaupimo bendrovės kodas, adresas)

(Tvirtinimo žyma)

Papildomo savanoriško kaupimo pensijų fondas „DnB NORD papildoma pensija“
(Pensijų fondo pavadinimas)

BALANSAS

PAGAL 2009 M. birželio 30 d. DUOMENIS

_____ Nr. _____

(Data)

(Lt)

Eil. Nr.	TURTAS	Pastabų Nr.	Ataskaitinis laikotarpis	Praėjęs ataskaitinis laikotarpis (2008 12 31)	Praėjęs ataskaitinis laikotarpis (2007 12 31)
I.	PINIGAI IR PINIGŲ EKVIVALENTAI		122 411	1 270 219	6 258 976
II.	TERMINUOTI INDĖLIAI		521 409	-	-
III.	INVESTICIJOS	2	13 304 643	12 334 229	15 277 554
1	Skolos vertybiniai popieriai		7 631 875	7 714 470	7 154 220
1.1.	Vyriausybių ir centrinių bankų arba jų garantuoti skolos vertybiniai popieriai		3 252 239	1 981 341	4 150 670
1.2.	Kiti skolos vertybiniai popieriai		4 379 636	5 733 129	3 003 550
2	Nuosavybės vertybiniai popieriai		41 602	43 476	48 061
3	Kolektyvinio investavimo subjektų investiciniai vienetai ir akcijos		5 631 166	4 576 283	8 075 273
4	Kitos investicijos		-	-	-
IV.	GAUTINOS SUMOS		-	-	-
1.	Investicijų pardavimo sandorių gautinos sumos		-	-	-
2.	Kitos gautinos sumos		-	-	-
	TURTO IŠ VISO:	1	13 948 464	13 604 448	21 536 530

Eil. Nr.	ĮSIPAREIGOJIMAI IR GRYNIEJI AKTYVAI	Pastabų Nr.	Ataskaitinis laikotarpis	Praėjęs ataskaitinis laikotarpis (2008 12 31)	Praėjęs ataskaitinis laikotarpis (2007 12 31)
V.	ĮSIPAREIGOJIMAI		21 298	23 177	21 516
1.	Investicijų pirkimo įsipareigojimai		-	-	-
2.	Mokėtinos sumos kaupimo bendrovei ir depozitoriumui		19 069	18 594	21 516
3.	Kitos mokėtinos sumos ir įsipareigojimai		2 229	4 583	-
VI.	GRYNIEJI AKTYVAI (I+II+III+IV-V)		13 927 166	13 581 271	21 515 014
	ĮSIPAREIGOJIMŲ IR GRYNŲJŲ AKTYVŲ IŠ VISO:		13 948 464	13 604 448	21 536 530

24.2. Grynujų aktyvų pokyčių ataskaita

UAB DnB NORD investicijų valdymas
(Kaupimo bendrovės pavadinimas)
226299280, J. Basanavičiaus g. 26, Vilnius, Lietuva
(Kaupimo bendrovės kodas, adresas)

Tvirtinimo žyma

Papildomo savanoriško kaupimo pensijų fondas „DnB NORD papildoma pensija“

(Pensijų fondo pavadinimas)

GRYNUJŲ AKTYVŲ POKYČIŲ ATASKAITA

PAGAL 2009 M. birželio 30 d. DUOMENIS

Nr. ____

(Data)

(Lt)

Eil. Nr.	Straipsniai	Ataskaitinis laikotarpis	Praėjęs atitinkamas ataskaitinis laikotarpis (2008 06 30)	Praėjęs atitinkamas ataskaitinis laikotarpis (2007 06 30)
I.	GRYNIJAI AKTYVAI ATASKAITINIO LAIKOTARPIO PRADŽIOJE	13 581 271	21 515 014	14 076 400
II.	PADIDĖJIMAS, IŠ VISO:	1 849 357	1 408 434	2 618 431
1	Pensijų įmokos	389 322	1 083 912	1 698 271
2	Iš kitų pensijų fondų pervestos sumos	16 783	-	-
3	Kaupimo bendrovės garantinės įmokos	-	-	-
4	Palūkanos ir dividendai	271 823	275 754	148 558
5	Investicijų pardavimo pelnas	26 577	7 927	8 249
6	Investicijų vertės padidėjimo suma	1 131 036	37 434	755 375
7	Turto vertės padidėjimas dėl užsienio valiutų kursų pasikeitimo	12 931	2 242	641
8	Kitos pajamos	884	1 165	7 338
III.	SUMAZĖJIMAS, IŠ VISO:	1 503 462	5 129 017	2 190 314
1	Pensijų išmokos	1 360 075	3 309 107	1 929 029
2	Iš kitus pensijų fondus pervestos sumos	-	6 504	-
3	Investicijų pardavimo nuostoliai	1 303	47 291	6 915
4	Investicijų vertės sumažėjimo suma	24 625	1 394 796	60 460
5	Turto vertės sumažėjimas dėl užsienio valiutų kursų pasikeitimo	7 313	211 893	77 415
6	Valdymo sąnaudos	106 956	152 646	113 477
7	Kitos sąnaudos	3 191	6 781	3 019
IV.	GRYNIJAI AKTYVAI ATASKAITINIO LAIKOTARPIO PABAIGOJE	13 927 166	17 794 431	14 504 517
		Ataskaitinio laikotarpio pabaigoje	Prieš metus	Prieš dvejus metus
V.	APSKAITOS VIENETO VERTĖ	1,0006	1,1123	1,1741
VI.	APSKAITOS VIENETŲ SKAICIUS	13 918 598	15 997 256	11 923 138

24.3. Aiškinamasis raštas

Bendroji dalis

Pensijų fondo pavadinimas:	Papildomo savanoriško kaupimo pensijų fondas „DnB NORD papildoma pensija“	
Pensijų fondo įsteigimo data:	2004 m. spalio 21 d.	
Kaupimo bendrovė:	Pavadinimas:	UAB DnB NORD investicijų valdymas
	Buveinės adresas:	J. Basanavičiaus g. 26, 03601 Vilnius-6, Lietuva
	Įmonės kodas:	226299280
	Tel.:	(8-5) 2393 567, (8-5) 2393 773.
	Faks:	(8-5) 2393 473.
	Elektroninio pašto adresas:	investicija@dnbnord.lt
	Pensijų fondo valdytojas:	Loreta Načajienė
Depozitoriumas:	Depozitoriumo pavadinimas:	AB DnB NORD bankas
	Buveinės adresas:	J. Basanavičiaus g. 26, Vilnius, Lietuva
	Įmonės kodas:	112029270
	Tel.:	(8-5) 213 90 60, (8-5) 239 37 71, (8-5) 239 37 74
	Faks.:	(8-5) 239 37 83
Audito įmonė:	UAB „Ernst & Young Baltic“ Audito įmonės pažymėjimo Nr. 001335 Subačiaus g. 7, Vilnius, Lietuva	

Apskaitos politika

UAB DnB NORD investicijų valdymas (toliau – bendrovė) tvarkant Pensijų fondo (toliau – Fondas) buhalterinę apskaitą ir rengdama Fondo finansines ataskaitas, vadovaujasi Lietuvos Respublikos buhalterinės apskaitos įstatymu, bendraisiais apskaitos principais, nustatytais Verslo apskaitos standartuose, Pensijų fondų buhalterinės apskaitos ir finansinių ataskaitų tvarka ir kitais teisės aktais.

Finansinės ataskaitos sudaromos naudojant Lietuvos Respublikos piniginių vienetą – litą.

Finansinės ataskaitos parengtos vadovaujantis veiklos tęstinumo principu ir prielaida, kad Fondas artimiausioje ateityje galės tęsti savo veiklą.

Fondo finansiniai metai sutampa su kalendoriniais metais.

Investavimo politika

Pensijų fondo investavimo strategija remiasi prielaida, pagrįsta daugelio Dalyvių ilgalaikiu investavimo horizontu, todėl iki 50 proc. Fondo grynųjų aktyvų lėšų gali būti investuojama akcijų rinkose, prisiimant su tuo susijusią riziką, ir siekiant aukštesnio pelningumo ilgu laikotarpiu. Didesnį tikėtiną akcijų rinkų pelningumo svyravimą siekiama atsverti vidutiniškai stabilesnį pelningumą generuojančiomis investicijomis, kaip kad vyriausybės vertybiniais popieriais, kredito įstaigų ir kitų bendrovių skolos vertybiniais popieriais, indėliais ir pan., kurie turi sudaryti ne mažiau nei 50 procentų Fondo grynųjų aktyvų. Investuojant specializacija geografinėje zonoje ar pramonės šakoje nėra taikoma.

Investicijų portfelio struktūra

Pensijų fondo investicijas gali sudaryti:

1. vertybiniai popieriai, pinigų rinkos priemonės, kuriomis prekiaujama pripažintose ir visuomenei prieinamose reguliuojamose rinkose, veikiančiose Europos Sąjungos valstybėje;
2. vertybiniai popieriai, pinigų rinkos priemonės, kuriomis prekiaujama pripažintose ir visuomenei prieinamose reguliuojamose rinkose, veikiančiose pagal nustatytas taisykles, esančiose šalyse, kurios priklauso Ekonominio bendradarbiavimo ir plėtros organizacijai¹;
3. vertybiniai popieriai, pinigų rinkos priemonės, kuriomis prekiaujama pripažintose ir visuomenei prieinamose reguliuojamose rinkose, veikiančiose ne Europos Sąjungos valstybėje, kuri yra nurodyta Pensijų fondo taisyklėse²;
4. išleidžiami nauji vertybiniai popieriai, jeigu emisijos sąlygose numatytas įsipareigojimas įtraukti šiuos vertybinius popierius į vertybinių popierių biržos oficialųjį prekybos sąrašą ar reguliuojamos rinkos prekybos sąrašą ir jeigu įtraukiama į sąrašą ne vėliau kaip per vienerius metus nuo išleidimo (jei tokia birža ar rinka yra nurodyta 1, ir 2 punktuose);
5. investiciniai vienetai ir akcijos kolektyvinio investavimo subjektų, atitinkančių LR teisės aktų nustatytus reikalavimus;
6. indėliai ne ilgesniam kaip 12 mėnesių terminui, kuriuos galima atsiimti pareikalavus, yra kredito įstaigose, kurių registruota buveinė yra Europos Sąjungos valstybėje arba kitoje valstybėje, kurioje riziką ribojanti priežiūra yra ne mažesnė kaip Europos Sąjungoje;
7. išvestinės finansinės ir investicinės priemonės, skirtos Pensijų fondo rizikai valdyti.

Pensijų fondas investuoja lėšas ne tik litais, bet ir kitomis valiutomis.

Finansinės rizikos valdymo politika

Investuojant Pensijų fondo turtą yra susiduriama su įvairiomis finansinėmis rizikomis ir siekiant sumažinti jų poveikį Fondo veiklai jos atitinkamai kontroliuojamos. Finansinės rizikos, su kuriomis gali būti susiduriama investuojant Fondo turtą:

1. kredito rizika – rizika patirti nuostolius dėl skolos vertybinių popierių emitento nesugebėjimo įvykdyti savo skolinius įsipareigojimus. Siekiant sumažinti kredito riziką, dalis Pensijų fondo lėšų investuojamos į žemos rizikos skolos vertybinius popierius;
2. palūkanų normos rizika – rizika patirti nuostolius dėl nepalankių palūkanų pokyčių, kurie gali turėti įtakos skolos vertybinių popierių kainoms. Siekiant sumažinti palūkanų normų riziką, formuojant Pensijų fondo turtą sudarančių skolos vertybinių popierių portfelį gali būti atsižvelgiama į Fondo Dalyvių vidutinę sutarties trukmę;
3. valiutos kurso rizika – rizika patirti nuostolius dėl nepalankaus užsienio valiutos kurso pokyčio nacionalinės valiutos atžvilgiu, kuris sąlygoja neigiamą turto, laikomo ta užsienio valiuta, vertės pokytį. Siekiant sumažinti valiutų kurso pokyčių riziką dalis lėšų investuojama nacionaline valiuta bei bazine valiuta eurais, kurios kursas nesvyruoja nacionalinės valiutos atžvilgiu;

¹ Australijos vertybinių popierių birža (Australija), Vienos vertybinių popierių birža (Austrija), EASDAQ (Belgija), Barcelonos vertybinių popierių birža (Ispanija), Madrido vertybinių popierių birža (Ispanija), Amsterdamo vertybinių popierių birža (Nyderlandai), Airijos vertybinių popierių birža, Dublino vertybinių popierių birža (Airija), Italijos vertybinių popierių birža, Atėnų vertybinių popierių birža (Graikija), Liuksemburgo vertybinių popierių birža, Oslo vertybinių popierių birža (Norvegija), Lisabonos vertybinių popierių birža (Portugalija), Paryžiaus vertybinių popierių birža (EURONEXT) (Prancūzija), Stokholmo vertybinių popierių birža (Švedija), Frankfurto vertybinių popierių birža (Vokietija), Helsinkio vertybinių popierių birža (Suomija), Kopenhagos vertybinių popierių birža (Danija), Londono vertybinių popierių birža (Didžioji Britanija), Australijos vertybinių popierių birža, Toronto vertybinių popierių birža (Kanada), Prahos vertybinių popierių birža (Čekija), Budapešto vertybinių popierių birža (Vengrija), Tokijo vertybinių popierių birža (Japonija), Osakos vertybinių popierių birža (Japonija), Korėjos vertybinių popierių birža, Meksikos vertybinių popierių birža, Naujosios Zelandijos vertybinių popierių birža, Varšuvos vertybinių popierių birža (Lenkija), Bratislavos vertybinių popierių birža (Slovakija), Šveicarijos birža, Stambulo vertybinių popierių birža (Turkija), Niujorko vertybinių popierių birža (JAV), NASDAQ (JAV)

² Buenos Aires vertybinių popierių birža (Argentina), Panamos vertybinių popierių birža (Panama), Rio de Žaneiro vertybinių popierių birža, San Paulo vertybinių popierių birža (Brazilija), Johanburgo vertybinių popierių birža (Pietų Afrikos Respublika), Honkongo vertybinių popierių birža (Honkongas), Kuala Lumpuro vertybinių popierių birža (Malaizija), Tailando vertybinių popierių birža (Tailandas), Singapūro vertybinių popierių birža (Singapūras), Nacionalinė Indijos vertybinių popierių birža (Indija), Tel Avivo vertybinių popierių birža (Izraelis), Zagrebo vertybinių popierių birža (Kroatija), Bukarešto vertybinių popierių birža (Rumunija), Bulgarijos vertybinių popierių birža (Bulgarija), Maskvos vertybinių popierių birža, Rusijos birža (Rusija), Ukrainos vertybinių popierių birža (Ukraina)

4. akcijų kainos rizika – rizika patirti nuostolius dėl nepalankių akcijų kainų svyravimų. Akcijų kainos rizika mažinama užtikrinant Taisyklėse ir įstatymuose numatytą diversifikavimo ir kitų apribojimų vykdymą;
 5. rinkos likvidumo rizika – rizika patirti nuostolius dėl mažo rinkos likvidumo, kuris neleidžia parduoti vertybinius popierius norimu laiku ir už norimą kainą, arba apskritai atima galimybę parduoti turimą turtą (investiciją). Siekiant sumažinti rinkos likvidumo riziką investuojama tik į tuos vertybinius popierius, kurie kotiruojami pripažintose pasaulio rinkose arba kurių kainą reguliariai skelbia visuotinės informavimo priemonės;
 6. sandorio šalies rizika – rizika patirti nuostolius dėl sandorio šalies nesugebėjimo įvykdyti savo finansinius įsipareigojimus, kurie buvo priimti sudarant sandorį. Siekiant sumažinti sandorio šalies riziką, investicijų Valdymo įmonė sudaro sandorius daugiausia su žemos rizikos (investicinio reitingo) kredito įstaigomis ar finansų įstaigomis, o jų nesant, su patikimais partneriais, besispecializuojančiais atitinkamoje srityje;
 7. atsiskaitymų rizika – rizika patirti nuostolius, kai atsiskaitymo už sandorį metu sandorio šalis dėl tam tikrų priežasčių negali pervesti atitinkamų lėšų ar vertybinių popierių, nors ta sandorio šalis sandoriu įgytus įsipareigojimus jau yra patenkinusi. Siekiant sumažinti atsiskaitymų riziką, prekybinėje veikloje daugiausia naudojamosi mokėjimų agento paslaugomis, arba prekybinė veikla vykdoma organizuotose rinkose, kuriose atsiskaitymams taikomi visuotiniai pripažinti principai;
- Akcijų kainos, palūkanų normų, valiutos kurso, kredito rizikos gali būti valdomos naudojant išvestines investicines priemones: apsikaitimo, ateities, pasirinkimo ir išankstinius sandorius. Akcijų kainos rizika taip pat gali būti valdoma sudarant akcijų indeksų ateities sandorius, jeigu pastebima pakankama atitinkamo akcijų indekso koreliacija su Pensijų fondo investicijų dalimi.

Turto padidėjimo ir sumažėjimo pripažinimo principai

Turto padidėjimas tai:

1. pensijų įmokos – gautos įmokos;
2. iš kitų Pensijų fondų pervestos sumos – iš kitų Pensijų fondų gauti Dalyvių sukaupti pinigai, kai Dalyvis ateina į Pensijų fondą;
3. palūkanos ir dividendai – gautini ir gauti dividendai ir palūkanos;
4. investicijų pardavimo pelnas – pelnas, gautas pardavus investicijas;
5. investicijų vertės padidėjimo suma – investicijų vertės padidėjimo suma dėl jų įvertinimo tikraja verte;
6. turto vertės padidėjimas dėl užsienio valiutų kursų pasikeitimo – teigiami pasikeitimai, perkainojant gautinas ir mokėtinas sumas, užsienio valiuta laikomus terminuotus indėlius, pinigų ekvivalentus, denominuotus užsienio valiuta, užsienio valiutą banko sąskaitose, investicijas, denominuotas užsienio valiuta, dėl Lietuvos banko skelbiamo nacionalinės valiutos ir užsienio valiutos santykio pasikeitimo;
7. kitos pajamos – gauti ir gautini delspinigiai ir kitos pajamos, neįskaitytos į 1–6 punktuose nurodytus straipsnius.

Turto sumažėjimas tai:

1. pensijų išmokos – įstatymų ir Pensijų fondo Taisyklėse nustatyta tvarka išmokėtos ir mokėtinos Dalyviams ir jų paveldėtojams sumos;
2. į kitus Pensijų fondus pervestos sumos – mokėtini ir pervesti į kitus Pensijų fondus dalyvių sukaupti pinigai, kai dalyvis pereina į kitą Pensijų fondą;
3. investicijų pardavimo nuostoliai – nuostoliai, atsiradę dėl investicijų pardavimo, jeigu investicijos parduodamos už kainą, mažesnę už jų balansinę vertę;
4. investicijų vertės sumažėjimo suma – investicijų vertės sumažėjimo suma dėl jų įvertinimo tikraja verte;
5. turto vertės sumažėjimas dėl užsienio valiutų kursų pasikeitimo – neigiami pasikeitimai, perkainojant gautinas ir mokėtinas sumas, užsienio valiuta laikomus terminuotus indėlius, pinigų ekvivalentus, denominuotus užsienio valiuta, užsienio valiutą banko sąskaitose, investicijas, denominuotas užsienio valiuta, dėl Lietuvos banko skelbiamo nacionalinės valiutos ir užsienio valiutos santykio pasikeitimo;

6. valdymo sąnaudos – atskaitymai kaupimo bendrovei ir depozitoriumui už turto valdymą, kitos su Fondo valdymu susijusios sąnaudos, numatytos pensijų fondo taisyklėse.

Atskaitymų kaupimo bendrovei ir depozitoriumui taisyklės

Mokesčiai išskaičiuojami iš Fondo turto:

1. mokestis Valdymo įmonei už Pensijų fondo valdymą;
2. mokestis Depozitoriumui;
3. mokesčiai ir išlaidos, išskaičiuojamos dalyvavimo Pensijų fonde baigties atveju;
4. kitos išlaidos, dengiamos iš fondo turto.

Mokestis Valdymo įmonei už Pensijų fondo valdymą susideda iš:

1. pradinio Fondo turto valdymo mokesčio, kuris išskaičiuojamas iš kiekvienos naujai įmokamos pensijų įmokos ir kurio maksimalus dydis yra 3,95 procento nuo pervedamos pensijų įmokos. Tuo atveju, jeigu Dalyvis pereina į Pensijų fondą iš kitos valdymo įmonės valdomo Pensijų fondo, nuo iš kitos valdymo įmonės valdomo Fondo pervedamų Dalyvio piniginių lėšų pradinis valdymo mokestis neišskaičiuojamas; Grynujų aktyvų pokyčių ataskaitoje pensijų įmokos yra sumažintos pradinio valdymo mokesčio suma, kadangi į fondo sąskaitą yra pervedamos įmokos jau atskaičius minėtąjį mokestį.
2. metinio Fondo turto valdymo mokesčio, kuris išskaičiuojamas iš Fondo turto ir kurio maksimalus dydis yra 1,5 procento nuo vidutinės metinės Pensijų fondo grynujų aktyvų vertės. Fondo turto valdymo mokestis priskaičiuojamas už kiekvieną darbo dieną ir kartą per mėnesį atskaitomas nuo Fondo turto. Pensijų fondo turto valdymo mokestis už vieną dieną skaičiuojamas Fondo turto valdymo mokestį padalinant iš faktinio kalendorinių metų darbo dienų skaičiaus keturių skaičių po kablelio tikslumu. Jeigu šie atskaitymai per vienerius kalendorinius metus viršija 1,5 procento nuo Dalyvio Pensijų sąskaitoje apskaitytų lėšų vidutinės metinės vertės, Valdymo įmonė iki kitų kalendorinių metų 15 dienas perveda perviršį į Pensijų fondo sąskaitą.

Tikslus pradinio Fondo turto valdymo ir metinio Fondo turto valdymo mokesčių dydžius, kurie gali būti skirtingi, priklausomai nuo pensijų įmokos dydžio, užtikrinant visiems Dalyviams tapačias sąlygas, nustato Valdymo įmonės valdyba. Informacija Dalyviams apie galiojančius valdymo mokesčių dydžius pateikiama tinklapyje (www.dnb nord.lt).

Mokestis Depozitoriumui yra ne didesnis kaip 0,25 procento nuo vidutinės metinės Pensijų fondo grynujų aktyvų vertės. Depozitoriumo mokestis yra metinis. Jis priskaičiuojamas už kiekvieną darbo dieną ir kartą per mėnesį atskaitomas nuo Fondo turto ir pervedamas į Depozitoriumo sąskaitą. Maksimalus Depozitoriumo mokestis procentais už vieną darbo dieną skaičiuojamas nustatyta Depozitoriumo mokestį padalinant iš metinio darbo dienų skaičiaus, apvalinant keturių skaičių po kablelio tikslumu. Jeigu Depozitoriumo mokestis per vienerius kalendorinius metus viršija 0,25 procento nuo Pensijų fondo grynujų aktyvų vidutinės metinės vertės, Valdymo įmonė iki kitų kalendorinių metų 15 dienas perveda perviršį į Pensijų fondo sąskaitą.

Mokesčiai ir išlaidos, išskaičiuojamos dalyvavimo Pensijų fonde baigties atveju:

1. Dalyvio perėjimas į kitą Valdymo įmonės valdomą Pensijų fondą atliekamas nemokamai, nepriklausomai nuo perėjimo dažnumo;
2. Dalyvio perėjimo į kitos valdymo įmonės valdomą Pensijų fondą pirmą kartą per kalendorinius metus atveju, Valdymo įmonė atskaito su Dalyvio perėjimu susijusias išlaidas, kurios negali būti didesnės negu 0,5 procentų nuo Dalyvio vardu į kitą Pensijų fondą pervedamų piniginių lėšų sumos;
3. Dalyvio perėjimo į kitos valdymo įmonės valdomą Pensijų fondą ne pirmą kartą per kalendorinius metus atveju, Valdymo įmonė nuo Dalyvio vardu į kitą Pensijų fondą pervedamų piniginių lėšų sumos atskaito iki 2 procentų sumą, kurią sudaro su Dalyvio perėjimu susijusios išlaidos ir išlaidos, susijusios su Dalyvio pritraukimu į Valdymo įmonę;
4. Tuo atveju, jeigu Dalyvis nepereina į kitos valdymo įmonės valdomą Pensijų fondą, Valdymo įmonė nuo Dalyvio vardu pervedamų piniginių lėšų sumos atskaito iki 2 procentų sumą, kurią sudaro su Dalyvio lėšų pervedimu susijusios išlaidos ir išlaidos, susijusios su Dalyvio pritraukimu į Valdymo įmonę.

Kitų išlaidų, dengiamų iš Fondo turto, sąrašas:

1. Pensijų fondo sąskaita bei Pensijų fondo interesais sudaromų sandorių faktinės išlaidos pagal sutartis tarpininkams, sudarančios ne daugiau kaip 1 procentą nuo sudarytų sandorių vertės, bet ne mažiau kaip 25 Lt nuo kiekvieno sandorio;
2. išlaidos už bankines paslaugas;
3. Pensijų fondo audito išlaidos;
4. bendras maksimalus šiame punkte išvardintų išlaidų dydis negali viršyti 1.5 procento per vienerius finansinius metus nuo Pensijų fondo grynujų aktyvų vertės.

Valdymo įmonė iš Fondo turto nedengia jokių kitų išlaidų bei neišskaičiuoja jokių kitų atskaitymų, išskyrus atvejus, numatytus šiame straipsnyje. Taisyklėse numatyti maksimalūs atskaitymų dydžiai negali būti viršijami, tačiau jie gali būti mažesni. Išskaičiuoti atskaitymai tampa Valdymo įmonės nuosavybe.

Investicijų įvertinimo metodai, investicijų pervertinimo periodiškumas

Fondo turto vertė nustatoma kiekvieną darbo dieną. Pensijų turto vertė nustatoma taip:

1. Pensijų fondo investicijų tikroji vertė skaičiuojama pagal LR Vertybinių popierių komisijos patvirtintą ir Fondo turto vertės skaičiavimo metu galiojančią Grynujų aktyvų vertės skaičiavimo metodiką (toliau – Metodika);
2. aktyvai denominuoti užsienio valiuta – perskaičiuojami į nacionalinę valiutą, laikantis Lietuvos banko nustatyto tos dienos oficialaus tos valiutos ir nacionalinės valiutos santykio.
3. Įsipareigojimai skaičiuojami pagal Verslo apskaitos standartus.
4. Išvestinės finansinės priemonės laikomos kitomis investicijomis.

Grynujų aktyvų vertės (GAV) skaičiavimo metodika

Apskaitos vieneto vertė apskaičiuojama Fondo grynujų aktyvų vertę, apskaičiuotą pagal Metodiką, padalinus iš Apskaitos vienetų skaičiaus. Pradinė Apskaitos vieneto vertė – 1 Lt. Praėjusios darbo dienos apskaičiuota Apskaitos vieneto vertė iki kitos darbo dienos 12.00 val. paskelbiama tinklalapyje www.dbnord.lt.

1. Skolos vertybiniai popieriai, įtraukti į Vilniaus vertybinių popierių biržos prekybos sąrašus, vertinami pagal paskutinę žinomą geriausią pirkimo kainą, gautą iki 14.00 val., kurią viešai skelbia AB DnB NORD bankas, "Swedbank", AB, AB SEB bankas ir AB bankas "Snoras". Jeigu kuris nors vienas ar keli bankai neskelbia kurio nors vertybinio popieriaus kainos, tai geriausia kaina parenkama iš likusių bankų skelbiamų geriausių pirkimo kainų. Jei per paskutiniąją prekybos sesiją priemonė nebuvo kotiruojama, tai tikrosios vertės nustatymui naudojama paskutinė žinoma, tačiau ne daugiau kaip prieš 30 dienų buvusi geriausia pirkimo kaina, jei nuo paskutinės prekybos dienos neįvyko įvykių, dėl kurių dabartinė rinkos kaina yra reikšmingai mažesnė ar didesnė nei paskutinė žinoma.
2. Skolos vertybiniai popieriai, įtraukti į kitų reguliuojamų rinkų, kurios atitinka fondo sudarymo dokumentus, biržų prekybos sąrašus, vertinami pagal biržos paskelbtą uždarymo kainą, o jai nesant, pagal biržos uždarymo metu paskelbtą pirkimo kainą.
3. Lietuvos Respublikos vyriausybės vertybinių popierių, kurie turi atkarpas tikroji vertė, vertinimo dieną, apskaičiuojama pagal aukščiau aprašytą tvarką, prie vertybinio popieriaus kainos pridėdant atkarpos išmoką, kuri būtų sukaupta kitą darbo dieną (T+1). Kitų skolos vertybinių popierių vertė apskaičiuojama prie vertybinio popieriaus kainos pridėdant atkarpos išmoką, kuri būtų sukaupta T+3 darbo dieną.
4. Jei skolos vertybinis popierius nėra kotiruojamas, dėl to, kad artėja vertybinio popieriaus išpirkimo data, tai jo kaina apskaičiuojama imant paskutinį žinomą to popieriaus pelningumą.
5. Naujai išleidžiami vertybiniai popieriai apskaitomi pagal jų nustatytą platinimo kainą atitinkamą vertinimo dieną.

6. Nuosavybės vertybiniai popieriai, įtraukti į Vilniaus vertybinių popierių biržos prekybos sąrašus, vertinami pagal vertinimo dieną biržos paskelbtą to popieriaus uždarymo kainą.

7. Nuosavybės vertybiniai popieriai, įtraukti į kitų šalių reguliuojamų rinkų, kurios atitinka fondo sudarymo dokumentus, biržų prekybos sąrašus, vertinami pagal vertinimo dieną biržos paskelbtą to popieriaus uždarymo kainą.

8. Kolektyvinio investavimo subjektų vienetai (akcijos) vertinami pagal paskutinę viešai paskelbtą išpirkimo kainą.

9. Naujai įsigyti vertybiniai popieriai į fondo turta įrašomi įsigijimo verte ir perkainojami kitą fondo darbo dieną pagal GAV skaičiavimo procedūras.

Apskaičiuojant grynujų aktyvų vertę priemonės, kuriomis reguliuojamose rinkose neprekiuojama, pagal Lietuvos Respublikos vertybinių popierių komisijos patvirtintą grynujų aktyvų vertės skaičiavimo metodiką.

Grynieji pinigai ir lėšos kredito įstaigose vertinami nominalia verte.

Terminuoti indėliai bankuose vertinami pagal amortizuotos savikainos vertę.

Išvestinės investicinės priemonės vertė nustatoma pagal paskutinę analogiško anksčiau sudaryto sandorio rinkos vertę, jei per laikotarpį nuo sandorio sudarymo dienos iki vertinimo dienos nebuvo didelio ekonominių aplinkybių pasikeitimo. Jei minėta sąlyga netenkinama – vertinama pagal tikėtiną pardavimo kainą, nustatytą pagal parinktą vertinimo modelį (nurodytą vertinimo procedūrose), kuris finansų rinkoje yra visuotinai taikomas ir pripažintas.

Fondo GAV ir investicinio vieneto vertė turi būti apskaičiuojama kiekvieną darbo dieną. Ne rečiau kaip kartą per mėnesį pagal GAV metodikoje pateiktą formulę turi būti apskaičiuojama vidutinė praėjusio mėnesio vieneto vertė ir kaip ši vidutinė vertė kito nuo finansinių metų pradžios. Pasibaigus finansiniams metams, Bendrovė turi apskaičiuoti vidutinį atskiram dalyviui per metus tenkantį GAV dydį.

Apskaitos vieneto vertės nustatymo taisyklės

Kiekviena Pensijų sąskaita turi individualų sąskaitos numerį, kurį suteikia Valdymo įmonė arba Depozitoriumas.

Pensijų sąskaitoje fiksuojama tokia informacija:

1. Dalyvio vardas, pavardė, asmens kodas ir adresas;
2. pensijų įmokų užskaitymo į Pensijų sąskaitą data, Apskaitos vieneto vertė ir konvertuojamų Apskaitos vienetų skaičius;
3. bendras Apskaitos vienetų skaičius.

Į Pensijų fondo sąskaitą pervestos Dalyvio piniginės lėšos (pensijų įmokos, iš kito pensijų fondo pervestos Dalyvio lėšos) konvertuojamos į Apskaitos vienetus. Dalyvio dalis Fondo turte nustatoma pagal Dalyvio Pensijų sąskaitoje įrašytų Apskaitos vienetų skaičių.

Už pervestas lėšas Dalyviui apskaičiuojamų Apskaitos vienetų skaičius nustatomas pagal formulę:

$$AVS = \frac{PPL - A}{AVV}$$

kur:

AVS - Apskaitos vienetų skaičius;

PPL - į Dalyvio Pensijų sąskaitą pervestos piniginės lėšos;

A - Taisyklių nustatyti atskaitymai;

AVV - pinigų į Pensijų sąskaitą užskaitymo dienos Apskaitos vieneto vertė

Pensijų fondas "DnB NORD papildoma pensija"

Ataskaita už 2009 m. II ketvirtį

Apskaitos vienetų skaičius apvalinamas pagal matematinės taisyklės iki 4 skaičių po kablelio.

Pensijų sąskaitą tvarko Valdymo įmonė elektroniniu būdu, užtikrindama Pensijų sąskaitoje esančios informacijos apsaugą ir konfidencialumą.

Pervestos į Pensijų fondo sąskaitą Dalyviui priklausančios lėšos į Apskaitos vienetus konvertuojamos pinigų į Pensijų sąskaitą užskaitymo dienos Apskaitos vieneto verte, ne vėliau kaip kitą darbo dieną po piniginių lėšų gavimo.

Valdymo įmonė uždaro Dalyvio Pensijų sąskaitą pasibaigus Dalyvio dalyvavimui Pensijų fonde ir išmokėjus sukauptas lėšas šių Taisyklių nustatyta tvarka.

Pinigų ekvivalentai, tai banko sąskaitose esantys pinigai įvairia valiuta ir pinigų ekvivalentams priskiriamos trumpalaikės (iki trijų mėnesių) likvidžios investicijos, kurios gali būti greitai iškeičiamos į pinigų sumas ir kurių vertės pasikeitimo rizika yra nereikšminga. Pinigų rinkos priemonės priskiriamos pinigų ekvivalentams ir rodomos šiame straipsnyje. Investicijos į nuosavybės vertybinius popierius nepriskiriamos pinigų ekvivalentams.

Aiškinamojo rašto pastabos**1. Turto struktūra ataskaitinio laikotarpio pabaigoje**

(Lt)

Turto arba emitento pavadinimas	Valstybės, į kurios vertybinius popierius investuota, pavadinimas	Valiutos, kuria denominuota investicija, pavadinimas	Nominali vertė	Palūkanų norma	Investicijos pabaigos terminas	Tikroji vertė	Turto. investicijos lyginamoji dalis (%)
1	2	3	4	5	6	7	8
BL Equities Europe	LU	EUR	-	-	-	305 481	2.19
Nordea 1 North American Value Fund	LU	USD	-	-	-	82 583	0.59
Nordea 1 European Value Fund	LU	EUR	-	-	-	185 989	1.33
Pioneer Funds - European Small Companies	LU	EUR	-	-	-	194 179	1.39
Pictet Emerging Markets	LU	USD	-	-	-	192 877	1.38
Nordea 1 Nordic Equity fund	LU	EUR	-	-	-	126 959	0.91
ING(L) Invest European telecom P CAP	LU	EUR	-	-	-	218 376	1.57
Nordea Danish Equity Fund	LU	DKK	-	-	-	4 345	0.03
Morgan ST US Equity Growth Fund	LU	USD	-	-	-	474 412	3.40
HSBC GIF-Asia ex Japan Fund	LU	USD	-	-	-	144 756	1.04
Franklin Templeton East Eur	LU	EUR	-	-	-	35 162	0.25
Vanguard US 500 STK	IE	USD	-	-	-	115 850	0.83
DWS Invest BRIC PLUS-FC	LU	EUR	-	-	-	91 740	0.66
Vanguard INV 'EURZ STK IDX'	IE	EUR	-	-	-	185 598	1.33
HENDERSON HORIZ-PAN EU SC-A2	LU	EUR	-	-	-	99 251	0.71
Vanguard INV 'GLOB STK IDX'	IE	EUR	-	-	-	183 510	1.32
HSBC GIF-GL EM MKT EQ FR-M1D	LU	USD	-	-	-	298 160	2.14
PF-Pasific (Ex Japan) Index-P Cap	LU	USD	-	-	-	92 250	0.66
ING (L) Invest Computer Technologies	LU	USD	-	-	-	42 237	0.30
Franklin Templeton Lat A	LU	USD	-	-	-	255 645	1.83
Fidelity Funds-Pasific Funds A	LU	USD	-	-	-	206 267	1.48
Fidelity Fnds-Nordic Nunds A	LU	SEK	-	-	-	31 084	0.22
Morgan ST Sicav EMG MK EQ-A	LU	USD	-	-	-	148 925	1.07
Carlson Equity Asian Small Cap Fund	LU	EUR	-	-	-	43 525	0.31
JPM Emerging Markets Equity Fund	LU	EUR	-	-	-	54 592	0.39
EURO EQUITY C ACC	LU	EUR	-	-	-	299 463	2.15
Morgan Stanl. Europe, Middle	LU	EUR	-	-	-	39 811	0.29

Pensijų fondas "DnB NORD papildoma pensija"
Ataskaita už 2009 m. II ketvirtį

East & Nor. Africa								
DnB NORD obligacijų fondas	LT	LTL	-	-	-	62 578	0.45	
Fidelity Global Health care	LU	EUR	-	-	-	133 798	0.96	
FORTIS L FUND Equity High Dividend USA C	LU	USD	-	-	-	34 586	0.25	
FORTIS L FUND EQUITY ENERGY WORLD C	LU	EUR	-	-	-	140 652	1.01	
Parvest-Agriculture Classi EUR	LU	EUR	-	-	-	171 935	1.23	
Schroder Emerg Asia A EUR Acc	LU	EUR	-	-	-	122 411	0.88	
Fidelity German Funds	LU	EUR	-	-	-	82 757	0.59	
JPM MIDDLE EAST EQUITY A	LU	USD	-	-	-	249 319	1.79	
Evli Greater Russia B	FI	EUR	-	-	-	112 566	0.81	
Fidelity Fnds-European AGGR-A	LU	EUR	-	-	-	86 400	0.62	
iShares FTSEurofirst 80	IE	EUR	-	-	-	148 538	1.06	
JPMORGAN F-EMERG EURO EQ-A\$ FUND	LU	USD	-	-	-	42 705	0.31	
INVECO ASEAN Equity Fund A	IE	USD	-	-	-	89 895	0.64	
TEO LT PVA	LT	LTL	-	-	-	41 602	0.30	
Lietuvos Respublika	LT	LTL	50 000	9.00	2010.02.11	49 831	0.36	
AB DnB NORD bankas	LT	LTL	70 000	10.75	2010.06.07	63 631	0.46	
HOLCIM FINANCE LUX SA	LU	EUR	65 603	2.53	2010.06.23	66 830	0.48	
AB" Pieno žvaigždės"	LT	LTL	70 000	18.75	2009.10.02	70 391	0.50	
GE CAPITAL EURO FUND	IE	EUR	75 962	6.41	2009.07.22	78 548	0.56	
IBM CORP	US	EUR	79 414	1.85	2010.02.08	80 893	0.58	
DEUTSCHE TELEKOM INT FIN	NL	EUR	79 414	1.93	2010.01.19	81 137	0.58	
CEZCO	CZ	EUR	86 320	4.59	2013.10.17	87 293	0.63	
BPB PLC	GB	EUR	86 320	3.59	2010.03.17	89 663	0.64	
PEMEX	US	EUR	86 320	3.37	2010.04.04	89 759	0.64	
CARGILL INC	US	EUR	93 226	4.20	2013.04.29	94 511	0.68	
Lietuvos Respublika	LT	LTL	100 000	4.80	2009.07.16	103 700	0.74	
Lietuvos Respublika	LT	EUR	120 848	8.90	2014.06.22	123 425	0.88	
AB DnB NORD bankas	LT	LTL	139 000	8.99	2009.09.26	142 140	1.02	
Slovakijos Respublika	SK	EUR	162 282	2.44	2010.04.14	170 990	1.23	
AB Bankas Snoras	LT	EUR	348 733	125.29	2010.05.21	177 242	1.27	
Turkijos Respublikos VVP	TR	EUR	172 640	4.17	2009.09.21	180 486	1.29	
Olandijos Karalystės	NL	EUR	172 640	1.36	2011.01.15	182 708	1.31	
RWE FINANCE BV	NL	EUR	172 640	3.19	2012.10.26	195 558	1.40	
TELEFONICA EM. 06/16	ES	EUR	207 168	4.86	2016.02.02	205 366	1.47	
GE CAPITAL EURO FUND	IE	EUR	207 168	3.87	2013.02.14	207 340	1.49	
EWE AG	DE	EUR	207 168	4.26	2014.10.14	214 710	1.54	
Lietuvos Respublika	LT	EUR	321 110	9.05	2013.03.05	281 741	2.02	
Lietuvos Respublika	LT	EUR	324 563	6.70	2010.04.20	308 099	2.21	
Dangas	LU	EUR	310 752	2.85	2011.06.21	321 635	2.31	
FRANCE TELECOM	FR	EUR	383 261	2.60	2012.02.21	406 380	2.91	
Lietuvos Respublika	LT	LTL	730 000	13.84	2016.02.10	433 772	3.11	
Lietuvos Respublika	LT	EUR	736 828	6.60	2010.02.22	706 999	5.07	
Vodafone Group PLC	GB	EUR	690 560	3.40	2012.11.29	710 208	5.09	
Lietuvos Respublika	LT	LTL	720 000	7.65	2009.09.02	710 488	5.09	
AB SEB VB	LT	LTL	1 000 000	10.10	2010.03.09	996 402	7.14	
AB DnB NORD bankas	LT	LTL	-	11.59	2010.02.15	312 846	2.24	
AB DnB NORD bankas	LT	LTL	-	11.59	2010.02.15	208 564	1.50	
Norddeutsche Landesbank Girozentrale	DE	EUR	-	0.00	2009.07.01	104 387	0.75	
AB DnB NORD bankas	LT	LTL		0.26		14 625	0.10	
AB DnB NORD bankas	LT	LTL		0.26		3 372	0.02	
AB DnB NORD bankas	LT	EUR		0.26		28	0.00	
Iš viso	X	X	X	X	X	13 948 464	100.00	

2. Investicijų vertės pokytis

(Lt)

Pokytis Balanso straipsniai	Praėjusio ataskaitinio laikotarpio pabaigoje	Įsigyta	Parduota (išpirkta)	Vertės padidėjimas	Vertės sumažėjimas	Ataskaitinio laikotarpio pabaigoje
1	2	3	4	5	6	7
Skolos vertybiniai popieriai	7 714 470	2 227 752	5 955 597	525 514	590 986	7 631 875
<i>Vyriausybės ir centrinių bankų arba jų garantuoti skolos vertybiniai popieriai</i>	<i>1 981 341</i>	<i>2 164 255</i>	<i>1 017 464</i>	<i>135 895</i>	<i>11 789</i>	<i>3 252 239</i>
<i>Kiti skolos vertybiniai popieriai</i>	<i>5 733 129</i>	<i>63 497</i>	<i>1 774 576</i>	<i>363 410</i>	<i>5 823</i>	<i>4 379 636</i>
Nuosavybės vertybiniai popieriai	43 476	-	-	-	1 874	41 602
Kolektyvinio investavimo subjektų investiciniai vienetai ir akcijos	4 576 283	339 691	167 052	895 173	12 929	5 631 166
Kitos investicijos	-	-	-	-	-	-
Iš viso	12 334 229	2 567 443	6 122 649	1 420 687	605 788	13 304 644

VII. INFORMACIJA APIE PENSIJŲ FONDO DALYVIUS

25. Bendri duomenys apie pensijų fondo dalyvius

Dalyvių skaičius ataskaitinio laikotarpio pradžioje		6 777
Dalyvių skaičius ataskaitinio laikotarpio pabaigoje	dalyviai, pasinaudoję teise nukelti pensijų išmokos mokėjimą	-
	dalyviai, gaunantys periodines pensijų išmokas	-
	kiti dalyviai	
	Iš viso	6 577
Dalyvių skaičiaus pokytis		-200

26. Per ataskaitinį laikotarpį prisijungusių dalyvių skaičius

Bendras prisijungusių dalyvių skaičius		108
Dalyviai, pensijų kaupimo sutartis sudarę pirmą kartą		107
Iš kitų pensijų fondų atėję dalyviai	tos pačios pensijų kaupimo bendrovės	1
	kitos pensijų kaupimo bendrovės	-

27. Per ataskaitinį laikotarpį pasitraukusių dalyvių skaičius

Bendras pasitraukusių dalyvių skaičius		308
Į kitus pensijų fondus išėjusių dalyvių skaičius	valdomus tos pačios pensijų kaupimo bendrovės	-
	valdomus kitos pensijų kaupimo bendrovės	-
Baigusią dalyvavimą dalyvių skaičius	išstojusių (pildoma tik papildomo savanoriško pensijų kaupimo pensijų fondo atveju)	299
	sulaukusią nustatyto pensijos amžiaus ir pasinaudojusią teise į pensijų išmoką (vienkartinę išmoką, anuitetą ir jų derinį)	-
	dalyvių, pasinaudojusią Pensijų kaupimo įstatymo suteikta galimybe vienašališkai nutraukti pirmą kartą sudarytą sutartį	-
	mirusių dalyvių	9

28. Pensijų fondo dalyvių struktūra

28.1. pagal amžių ir lytį ataskaitinio laikotarpio pabaigoje

		Dalyviai pagal amžių				iš viso
		iki 30	nuo 30 iki 45	nuo 45 iki 60	nuo 60	
Dalyvių skaičius	iš viso	1 255	2 624	2 678	639	6 577
	vyrų	758	1 378	759	292	3 187
	moterų	497	1 246	1 300	347	3 390
Dalyvių dalis, %	iš viso	19.08%	39.91%	40.71%	9.71%	100.00%
	vyrų	11.52%	20.95%	11.54%	4.44%	48.45%
	moterų	7.56%	18.96%	19.76%	5.28%	51.55%

28.2. pagal įmokas mokančių dalyvių buvimo (*residence*) vietą

Valstybė	Dalyvių skaičius	Gautų įmokų suma
Lietuva	6 577	389 322
Kitos Europos Sąjungos valstybės	-	-
Kitos Europos ekonominės erdvės valstybės (Islandija, Lichtenšteinas, Norvegija)	-	-
Jungtinės Amerikos Valstijos ir Kanada	-	-
Japonija	-	-
Kitos valstybės	-	-
Iš viso	6 577	389 322

VIII. IŠORINIAI PINIGŲ SRAUTAI

29. Per ataskaitinį laikotarpį faktiškai gautos lėšos

Bendra gautų lėšų suma		406 105
Periodinės įmokos į pensijų fondą	Iš Valstybinio socialinio draudimo fondo	-
	Paties dalyvio įmokėtos lėšos (pildoma tik papildomo savanoriško pensijų kaupimo pensijų fondo atveju)	389 322
	Darbdavių ir kitų trečiųjų asmenų įmokėtos lėšos (pildoma tik papildomo savanoriško pensijų kaupimo pensijų fondo atveju)	-
Valstybinio socialinio draudimo fondo sumokėti delspinigiai		-
Iš garantijų rezervo sumokėtos lėšos		-
Iš kitų pensijų fondų pervestos lėšos	Iš tos pačios pensijų kaupimo bendrovės	16 783
	Iš kitos pensijų kaupimo bendrovės	-
Kitos gautos lėšos (nurodyti šaltinį ir gautų lėšų sumą)		-

30. Per ataskaitinį laikotarpį išmokėtos lėšos

Bendra išmokėtų lėšų suma		1 360 075
Pensijų išmokos	Vienkartinės išmokos dalyviams	-
	Periodinės išmokos dalyviams	-
	Išmokos anuiteto įsigijimui	-
Į kitus pensijų fondus pervestos lėšos	Valdomus tos pačios pensijų kaupimo bendrovės	-
	Valdomus kitos pensijų kaupimo bendrovės	-
Išstojusiesiems dalyviams išmokėtos lėšos		1 344 413
Paveldėtojams išmokėtos lėšos		15 662
Kitais pagrindais išmokėtos lėšos		-

IX. INFORMACIJA APIE GARANTIJŲ REZERVĄ

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

X. INFORMACIJA APIE PENSIJŲ FONDO REIKMĖMS PASISKOLINTAS LĖŠAS

32. Pensijų fondo reikmėms pasiskolintos lėšos

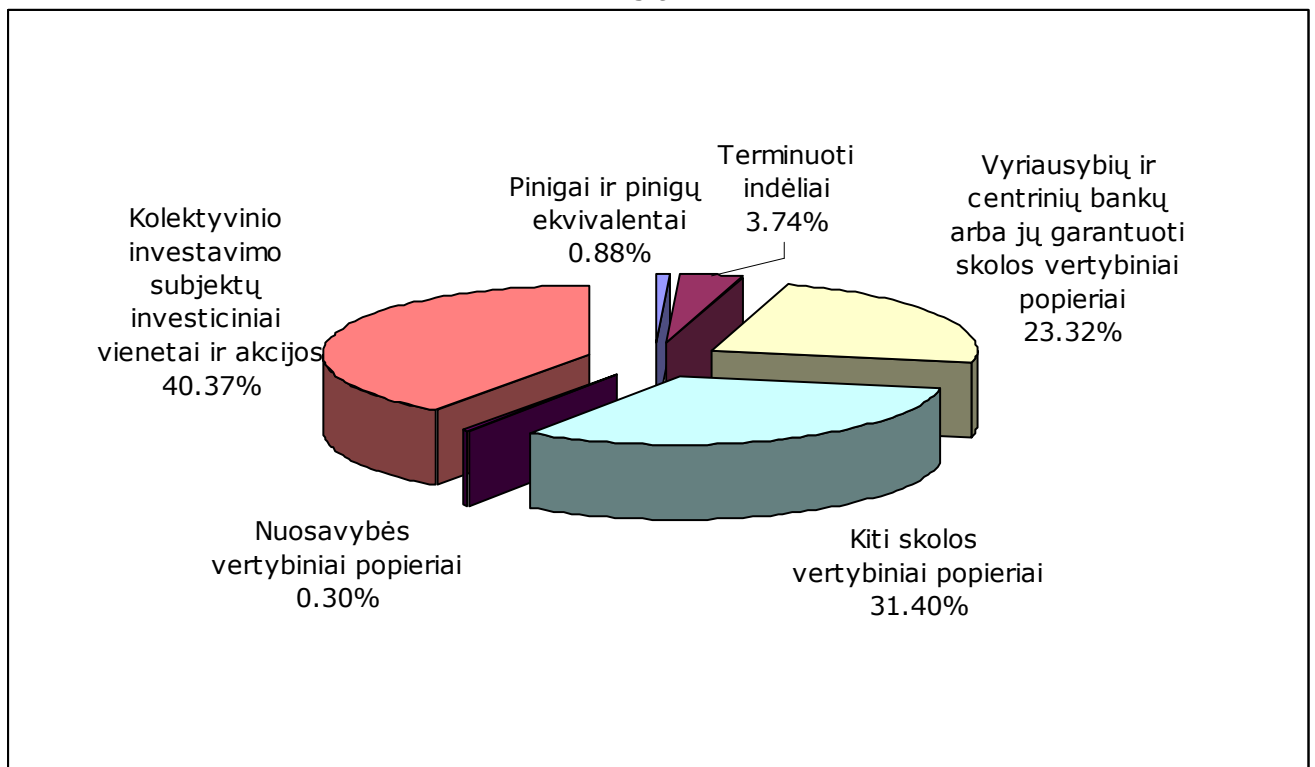
Pensijų fondo reikmėms nebuvo skolintasi.

XI. KITI REIKALAVIMAI

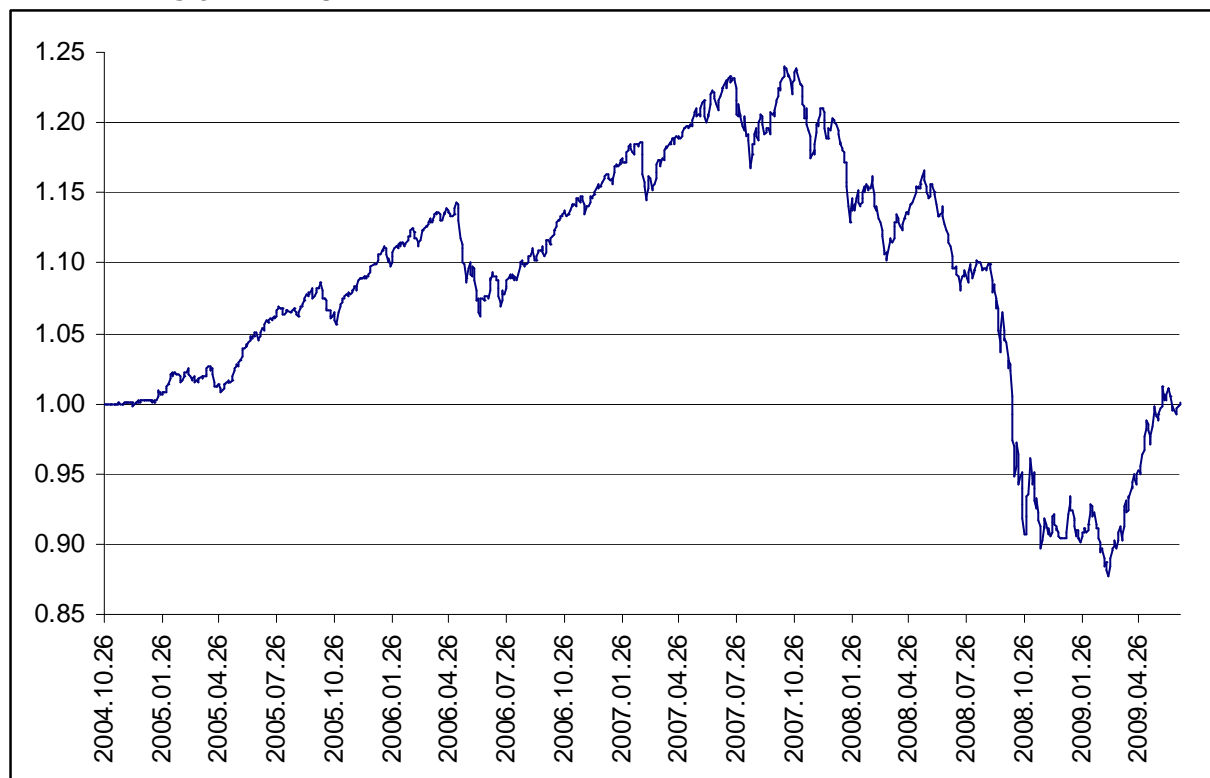
33. Paaškinimai ir komentarai apie pensijų fondo veiklą

Pateikiame visų pensijų fondo investicijų struktūrą 2009 m. birželio 30 d. bei pensijų fondo apskaitos vieneto vertės kitimą nuo įsteigimo iki 2009 06 30.

Investicijų struktūra



Pensijų fondo apskaitos vieneto vertės kitimas 2004 10 26 - 2008 06 30



34. Informacija apie konsultantus

Rengiant šią ataskaitą konsultantų paslaugomis nebuvo naudojamosi.

35. Informacija apie ataskaitą parengusius asmenis (jei jie nėra bendrovės darbuotojai)

-

36. Už ataskaitos parengimą atsakingų Įmonės valdymo organų narių, darbuotojų ir administracijos vadovo patvirtinimas, kad ataskaitoje pateikta informacija atitinka tikrovę ir nėra nutylėtų faktų, galinčių daryti esminę įtaką pensijų fondo veiklos rezultatų vertinimui

Žemiau pasirašę atsakingi asmenys patvirtina, kad ataskaitoje pateikta informacija atitinka tikrovę ir kad nėra nutylėtų faktų, galinčių turėti esminės įtakos pensijų fondo veiklos rezultatų vertinimui.

Generalinis direktorius

(parašas)

Šarūnas Ruzgys

Vyriausioji finansininkė

(parašas)

Dalia Vaitulevičienė