

**VALSTYBINIO SOCIALINIO DRAUDIMO ĮMOKOS DALIES
PADIDINTO PAJAMINGUMO
PENSIJŲ FONDO "DNB pensija 2"
2013 M. I PUSMEČIO ATASKAITOS**

TURINYS

I. BENDROJI INFORMACIJA	3
II. GRYNŲJŲ AKTYVŲ, APSKAITOS VIENETŲ SKAIČIUS IR VERTĖ	3
III. ATSKAITYMAI IŠ PENSIJŲ TURTO	3
IV. INFORMACIJA APIE PENSIJŲ FONDO INVESTICINIŲ PRIEMONIŲ PORTFELĮ	3
V. PENSIJŲ FONDO LYGINAMASIS INDEKSAS, INVESTICIJŲ GRĄŽA IR RIZIKOS RODIKLIAI	4
VI. PENSIJŲ FONDO FINANSINĖ BŪKLĖ	4
GRYNŲJŲ AKTYVŲ ATASKAITA	5
GRYNŲJŲ AKTYVŲ POKYČIŲ ATASKAITA	6
AIŠKINAMASIS RAŠTAS	7
VII. INFORMACIJA APIE PENSIJŲ FONDO DALYVIUS	25
VIII. IŠORINIAI PINIGŲ SRAUTAI	25
IX. INFORMACIJA APIE GARANTIJŲ REZERVĄ	25
X. INFORMACIJA APIE PENSIJŲ FONDO REIKMĖMS PASISKOLINTAS LĖŠAS	25
XI. KITA INFORMACIJA	25
XII. ATSAKINGI ASMENYS	26

I. Bendroji informacija

1. Duomenys apie Pensijų fondą

Aiškinamojo rašto bendroji dalis, pagrindiniai duomenys apie pensijų fondą.

2. Ataskaitinis laikotarpis, už kurį pateikta ataskaita

Ataskaita parengta už laikotarpį nuo 2013 m. sausio 1 d. iki 2013 m. birželio 30 d.

3. Duomenys apie valdymo įmonę

Aiškinamojo rašto bendroji dalis, pagrindiniai duomenys apie pensijų fondą.

4. Duomenys apie depozitoriumą

Aiškinamojo rašto bendroji dalis, pagrindiniai duomenys apie pensijų fondą.

II. GRYNŲJŲ AKTYVŲ, APSKAITOS VIENETŲ SKAIČIUS IR VERTĖ

5. Grynųjų aktyvų, apskaitos vienetų skaičių ir vertę

Aiškinamojo rašto 1 pastaba.

6. Per ataskaitinį laikotarpį konvertuotų apskaitos vienetų skaičius bei bendros konvertavimo sumos

Aiškinamojo rašto 2 pastaba.

III. ATSKAITYMAI IŠ PENSIJŲ TURTO

7. Atskaitymai iš pensijų turto

Aiškinamojo rašto 5 pastaba.

8. Mokėjimai tarpininkams

Aiškinamojo rašto 6 pastaba.

9. Informacija apie visus susitarimus dėl mokėjimų pasidalijimo, taip pat apie paslėptuosius komisinius (jų teikėjas, vertė, suteiktų prekių ir (ar) paslaugų pobūdis ir kt.).

-

10. Konkretus pavyzdys, iliustruojantis atskaitymų įtaką galutinei dalyviui tenkančiai investicijų grąžai (teikiama tik metų ataskaitoje):

-

IV. INFORMACIJA APIE PENSIJŲ FONDO INVESTICINIŲ PRIEMONIŲ PORTFELĮ

11. Ataskaitinio laikotarpio pabaigos investicinių priemonių portfelio sudėtis

Aiškinamojo rašto 3 pastaba.

12. Investicijų pasiskirstymas pagal investavimo strategiją atitinkančius kriterijus

Aiškinamojo rašto 4 pastaba.

13. Per ataskaitinį laikotarpį įvykdyti išvestinių finansinių priemonių sandoriai

-

14. 11 punkte nurodytų išvestinių finansinių priemonių rūšis, su jomis susijusią riziką, kiekybinės ribos ir metodais, kuriais vertinama su išvestinių finansinių priemonių sandoriais susijusi pensijų fondo rizika

-

15. Iš išvestinių finansinių priemonių sandorių kylančių įsipareigojimų bendra vertė ataskaitinio laikotarpio pabaigoje

-

16. Analizė, kaip turimas investicinių priemonių portfelis atitinka (neatitinka) pensijų fondo investavimo strategiją

Aiškinamojo rašto 3 pastaba.

17. Veiksniai, per ataskaitinį laikotarpį turėjusieji didžiausią įtaką investicinių priemonių portfelio struktūros ir jo vertės pokyčiams

Aiškinamojo rašto 3 pastaba.

V. PENSIJŲ FONDO LYGINAMASIS INDEKSAS, INVESTICIJŲ GRAŽA IR RIZIKOS RODIKLIAI

18. Pensijų fondo lyginamasis indeksas ir trumpas jo apibūdinimas (sudėtis, jei lyginamasis indeksas yra sudėtinis, kokias finansų rinkas, turto klases atspindi). Jeigu per ataskaitinį laikotarpį lyginamasis indeksas buvo pakeistas, turi būti pateikta informacija ir apie prieš tai galiojusį lyginamąjį indeksą, jo pakeitimo priežastis bei data, kada jis buvo pakeistas.

-

19. To paties laikotarpio pensijų fondo apskaitos vieneto vertės pokyčio, investicinių priemonių portfelio metinės investicijų grąžos ir lyginamojo indekso (jei jis pasirinktas) reikšmės pokyčio ir kiti rodikliai per paskutinius dešimt fondo veiklos metų, išdėstyti palyginamojoje lentelėje. Jeigu fondas veikia trumpiau nei dešimt metų, pateikti to laikotarpio, kurį portfelis buvo valdomas, metinę investicijų grąžą. Prie palyginamosios lentelės pridėti joje pateiktų apskaitos vieneto vertės pokyčio ir lyginamojo indekso reikšmės pokyčio rodiklių diagramą ir rodiklių paaiškinimus.

-

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

-

21. Vidutinė investicijų grąža, vidutinis apskaitos vieneto vertės ir lyginamojo indekso reikšmės pokytis (jei jis pasirinktas) per paskutinius trejus, penkerius, dešimt metų (vidutinė grynoji investicijų grąža, vidutinis apskaitos vieneto vertės ir lyginamojo indekso reikšmės pokytis apskaičiuojami kaip geometrinis, atitinkamai, metinių grynosios investicijų grąžos, metinių apskaitos vieneto vertės pokyčių ir lyginamojo indekso reikšmės pokyčių vidurkis). Kiekvienam fondo tipui pildoma lentelė:

-

22. Kiti rodikliai, atskleidžiantys investicinių priemonių portfelio riziką. Atskleidžiant investicijų rizikos rodiklius, turi būti pateikiami jų paaiškinimai ir apskaičiavimo metodika.

VI. PENSIJŲ FONDO FINANSINĖ BŪKLĖ

23. Pensijų fondo finansines ataskaitas, parengtas vadovaujantis Lietuvos Respublikos įstatymų ir teisės aktų reikalavimais

23.1. grynujų aktyvų ataskaita

23.2. grynujų aktyvų pokyčių ataskaita

23.3. aiškinamasis raštas.

UAB DNB investicijų valdymas

Įmonės kodas 226299280, J. Basanavičiaus g. 26, Vilnius, Lietuva

Padidinto pajamingumo pensijų Fondas „DNB pensija 2“

GRYNŲJŲ AKTYVŲ ATASKAITA

2013 m. birželio 30 d.

(litas)				
Eil. Nr.	Straipsniai	Pastabos Nr.	Finansiniai metai	Praėję finansiniai metai ¹
A.	TURTAS		205 086 646	189 842 277
I.	PINIGAI	3, 4	9 984 642	5 750 003
II.	TERMINUOTIEJI INDĖLIAI	3, 4		9 553 665
III.	PINIGŲ RINKOS PRIEMONĖS			-
III.1.	Valstybės išdo vekseliai			-
III.2.	Kitos pinigų rinkos priemonės			-
IV.	PERLEIDŽIAMIEJI VERTYBINIAI POPIERIAI	3, 4	195 102 003	174 538 609
IV.1.	Ne nuosavybės vertybiniai popieriai		140 703 587	126 466 054
IV.1.1.	Vyriausybės ir centrinių bankų arba jų garantuoti ne nuosavybės vertybiniai popieriai		122 874 558	108 400 760
IV.1.2.	Kiti ne nuosavybės vertybiniai popieriai		17 829 029	18 065 294
IV.2.	Nuosavybės vertybiniai popieriai			14 370
IV.3.	Kitų kolektyvinio investavimo subjektų investiciniai vienetai ir akcijos		54 398 417	48 058 185
V.	GAUTINOS SUMOS			-
V.1.	Investicijų pardavimo sandorių gautinos sumos			-
V.2.	Kitos gautinos sumos			-
VI.	INVESTICINIS IR KITAS TURTAS			-
VI.1.	Investicinis turtas			-
VI.2.	Išvestinės finansinės priemonės			-
VI.3.	Kitas turtas			-
B.	ĮSIPAREIGOJIMAI		156 396	151 303
I.	Finansinio ir investicinio turto pirkimo įsipareigojimai			-
II.	Įsipareigojimai kredito įstaigoms			-
III.	Įsipareigojimai pagal išvestinių finansinių priemonių sutartis			-
VI.	Valdymo įmonei ir depozitoriumui mokėtinos sumos		156 396	151 303
V.	Kitos mokėtinos sumos ir įsipareigojimai			-
C.	GRYNIEJI AKTYVAI	1	204 930 250	189 690 974

UAB DNB investicijų valdymas
Įmonės kodas 226299280, J. Basanavičiaus g. 26, Vilnius, Lietuva

Padidinto pajamingumo pensijų Fondas „DNB pensija 2“

GRYNŲJŲ AKTYVŲ POKYČIŲ ATASKAITA
2013 m. birželio 30 d.

				(litas)
Eil. Nr.	Straipsniai	Pastabos Nr.	Finansiniai metai	Praėję finansiniai metai
I.	GRYNŲJŲ AKTYVŲ VERTĖ ATASKAITINIO LAIKOTARPIO PRADŽIOJE	1	189 690 974	150 524 710
II.	GRYNŲJŲ AKTYVŲ VERTĖS PADIDĖJIMAS			
II.1.	Dalyvių įmokos į fondą	7	8 217 371	5 511 963
II.2.	Iš kitų fondų gautos sumos	7	8 807 929	9 857 111
II.3.	Garantinės įmokos			
II.4.	Palūkanų pajamos		15 131	289 629
II.5.	Dividendai		14 691	28 314
II.6.	Pelnas dėl investicijų vertės pasikeitimo ir pardavimo		5 577 217	8 112 694
II.7.	Pelnas dėl užsienio valiutos kursų pokyčio		31 747	18 762
II.8.	Išvestinių finansinių priemonių sandorių pelnas			
II.9.	Kitas grynųjų aktyvų vertės padidėjimas			1 639
	PADIDĖJO IŠ VISO:		22 664 086	23 820 112
III.	GRYNŲJŲ AKTYVŲ VERTĖS SUMAŽĖJIMAS			
III.1.	Išmokos fondo dalyviams	7	450 266	245 789
III.2.	Išmokos kitiems fondams	7	2 970 872	1 663 645
III.3.	Nuostoliai dėl investicijų vertės pasikeitimo ir pardavimo		2 867 967	288 511
III.4.	Nuostoliai dėl užsienio valiutos kursų pokyčio		2 423	2 473
III.5.	Išvestinių finansinių priemonių sandorių nuostoliai			
III.6.	Valdymo sąnaudos:		1 133 283	924 424
III.6.1.	Atlyginimas valdymo įmonei	5	1 133 754	922 218
III.6.2.	Atlyginimas depozitoriumui			
III.6.3.	Atlyginimas tarpininkams		1 093	2 206
III.6.4.	Audito sąnaudos			
III.6.5.	Kitos sąnaudos			
III.7.	Kitas grynųjų aktyvų vertės sumažėjimas			
III.8.	Sąnaudų kompensavimas (-)		(1 564)	(4 679)
III.9.	Pelno paskirstymas			
	SUMAŽĖJO IŠ VISO:		7 424 810	3 120 163
IV.	GRYNŲJŲ AKTYVŲ VERTĖ ATASKAITINIO LAIKOTARPIO PABAIGOJE	1	204 930 250	171 224 659

AIŠKINAMASIS RAŠTAS

Bendroji dalis

Pagrindiniai duomenys apie Pensijų fondą

Pensijų Fondo pavadinimas: Valstybinio socialinio draudimo įmokos dalies kaupimo padidinto pajamingumo pensijų Fondas „DNB pensija 2“

Pensijų Fondo įsteigimo data: 2003 m. rugsėjo 11 d.

Bendrovė:	Pavadinimas:	UAB DNB investicijų valdymas
	Buveinės adresas:	J. Basanavičiaus g. 26, Vilnius, Lietuva
	Įmonės kodas:	226299280
	Tel.:	(8-5) 2393 444
	Faks.:	(8-5) 2393 783.
	Elektroninio pašto adresas:	investicija@dnb.lt
	Pensijų fondo valdytojai:	Naglis Paičius, Regimantas Valentonis

Depozitoriumas:	Depozitoriumo pavadinimas:	AB DNB bankas
	Buveinės adresas:	J. Basanavičiaus g. 26, Vilnius, Lietuva
	Įmonės kodas:	112029270
	Tel.:	(8-5) 2393 444
	Faks.:	(8-5) 2393 783

Audito įmonė:	UAB „Ernst & Young Baltic“
	Audito įmonės pažymėjimo Nr. 001335
	Subačiaus g. 7, Vilnius, Lietuva

Ataskaitinis laikotarpis: nuo 2013 m. sausio 1 d. iki 2013 m. birželio 30 d.

Apskaitos politika

UAB DNB investicijų valdymas (toliau – Bendrovė), tvarkydama pensijų fondo buhalterinę apskaitą ir sudarydama finansines ataskaitas, vadovaujasi verslo apskaitos standartais (VAS), Lietuvos Respublikos buhalterinės apskaitos įstatymu ir kitais teisės aktais. 2011 metais pradėtas taikyti 39 verslo apskaitos standartas „Kolektyvinio investavimo subjektų ir pensijų fondų apskaita, finansinės ataskaitos“, priimtas 2010 m. gruodžio 13 d.

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.

Šiose finansinėse ataskaitose pateikiami suminiai skaičiai dėl apvalinimo gali nesutapti su juos sudarančių skaičių suma.

Pagrindiniai Fondo investavimo principai

Pagrindinis Pensijų fondo investicinės politikos principas yra Fondo Dalyviams priklausančio turto vertės apsaugojimas bei padidintas Pensijų fondo dalyviams priklausančio turto augimas ilgalaikėje perspektyvoje. Pensijų fondo turtas yra investuojamas pagal Pensijų fondo taisykles bei pagal galiojančius įstatymus ir teisės aktus, siekiant maksimalios naudos Pensijų fondo Dalyviams. Tikintis padidinto ilgalaikio pelningumo, iki 25 proc. visų Pensijų fondo grynujų aktyvų bus investuota į nuosavybės vertybinius popierius ar į kolektyvinio investavimo subjektų (investicinių fondų), investuojančių į nuosavybės vertybinius popierius, išleistus vertybinius popierius. Likvidumo užtikrinimui bei rizikos sumažinimui, ne mažiau kaip 75 proc. Pensijų fondo turto bus investuota į skolas, pinigų rinkos bei kitus fiksuotų pajamų instrumentus.

Pensijų fondo investavimo strategija apima Europos Sąjungos bei kitus geografinius regionus, kurie atitinka įstatymuose nustatytus reikalavimus bei Pensijų fondo taisykles.

Bendrovė gali investuoti Fondo turtą į:

1. vertybinius popierius ar pinigų rinkos priemones, kuriais prekiaujama rinkose, kurios pagal Vertybinių popierių rinkos įstatymą laikomos reguliuojamomis ir veikiančiomis Europos Sąjungos valstybėje narėje;

Pagrindiniai Fondo investavimo principai (tęsinys)

2. vertybinius popierius ar pinigų rinkos priemones, kuriais prekiaujama pripažintose ir visuomenei prieinamose reguliuojamose rinkose, esančiose šalyse, kurios priklauso Ekonominio bendradarbiavimo ir plėtros organizacijai¹;
3. investicinius vienetų ir akcijų kolektyvinio investavimo subjektų, kurie tenkina įstatymų nustatytus reikalavimus;
4. ne ilgesniam kaip 12 mėnesių terminui padėtus indėlius, kuriuos galima atsiimti pareikalavus, esančius kredito įstaigose, kurių registruota buveinė yra Lietuvos Respublikoje, Europos Sąjungos valstybėje narėje arba kitoje valstybėje, kurioje riziką ribojanti priežiūra yra ne blogesnė kaip Europos Sąjungoje;
5. pinigų rinkos priemones, kuriomis reguliuojamoje rinkoje neprekiuojama, jei tų priemonių emisija ar emitentas yra reguliuojami siekiant apsaugoti investuotojus ir jų santaupas ir jeigu tos priemonės tenkina Papildomo savanoriško pensijų kaupimo įstatyme nustatytus reikalavimus;
6. išvestines investicines priemones, nurodytas Finansinės rizikos valdymo politikoje, skirtas Pensijų fondo rizikai valdyti;
7. į kitus finansinius instrumentus aprašytus Fondo taisyklėse.

Investicijų portfelio struktūra

Fondo investicijų portfelio diversifikavimas yra vykdomas pagal galiojančius įstatymus ir Fondo taisykles. Papildomai investuojamam Fondo turtui keliami šie reikalavimai:

1. Ne daugiau kaip 25 proc. nuo grynujų Pensijų fondo aktyvų vertės galima investuoti į nuosavybės vertybinius popierius ar į kolektyvinio investavimo subjektų, investuojančių į nuosavybės vertybinius popierius, išleistus vertybinius popierius ar investicinius vienetus.
2. Į skolos vertybinius popierius bei pinigų rinkos priemones galima investuoti iki 100 proc. Pensijų fondo aktyvų vertės.
3. Investicijos į indėlius gali sudaryti iki 100 proc. Pensijų fondo aktyvų vertės.
4. Į vieno emitento vertybinius popierius ir pinigų rinkos priemones gali būti investuota ne daugiau kaip 5 proc. pensijų turtą sudarančių grynujų aktyvų, išskyrus šio straipsnio 5, 9 ir 10 dalyse numatytus atvejus.
5. Į vieno emitento vertybinius popierius ar pinigų rinkos priemones gali būti investuota daugiau kaip 5 proc., bet ne daugiau kaip 10 proc. grynujų aktyvų, su sąlyga, kad tokių investicijų bendra suma nebus didesnė kaip 40 proc. grynujų aktyvų (šis apribojimas netaikomas indėliams).
6. Į įmonių, priklausančių grupei, kuri turi sudaryti konsoliduotas finansines ataskaitas, išleistus vertybinius popierius ir pinigų rinkos priemones gali būti investuota ne daugiau kaip 20 proc. grynujų aktyvų.
7. Investicijos į indėlius vienoje kredito įstaigoje negali sudaryti daugiau kaip 20 proc. Pensijų fondo turtą sudarančių grynujų aktyvų.
8. Bendra investicijų į vieno asmens išleistus vertybinius popierius, pinigų rinkos priemones ar indėlius suma negali būti didesnė kaip 20 proc. Pensijų fondo turtą sudarančių grynujų aktyvų.
9. Investicijos į Lietuvos Respublikos, Europos Sąjungos valstybės narės ar jų savivaldybių, kitos valstybės ar tarptautinės organizacijos, kuriai priklauso bent viena Europos Sąjungos valstybė, išleistus arba garantuotus vieno emitento vertybinius popierius ar pinigų rinkos priemones negali būti didesnės kaip 35 proc. pensijų turtą sudarančių grynujų aktyvų. Gavus atskirą Vertybinių popierių komisijos leidimą į šioje dalyje numatytus vieno emitento vertybinius popierius ar pinigų rinkos priemones galima investuoti iki 100 proc. pensijų turtą sudarančių grynujų aktyvų. Tokiu atveju, kai vieno emitento vertybiniai popieriai ar pinigų rinkos priemonės sudaro daugiau nei 35 proc. pensijų turtą sudarančių grynujų aktyvų, turi būti investuota ne mažiau kaip į 6 tokio emitento išleistas vertybinių popierių emisijas, o į vienos emisijos vertybinius popierius investuota ne daugiau kaip 30 proc. grynujų aktyvų.

¹ Australijos vertybinių popierių birža (Australija), Vienos vertybinių popierių birža (Austrija), EASDAQ (Belgija), Barselonos 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, Ciuricho birža, Ženevos birža, Bazelio birža (Šveicarija), Stambulo vertybinių popierių birža (Turkija), Niujorko vertybinių popierių birža (JAV), NASDAQ (JAV).

10. Investicijos į obligacijas, išleistas tokios Europos Sąjungos valstybėje registruotą buveinę turinčios kredito įstaigos, kuri, siekiant apsaugoti obligacijų savininkų interesus, yra tos valstybės specialiai prižiūrima pagal teisės aktus, o iš obligacijų leidimo gauta suma visam obligacijų galiojimo laikui investuojama į tokį turtą, kurio pakaktų patenkinti obligacijų savininkų reikalavimus, ir iš kurio – emitento nemokumo atveju – obligacijų savininkų reikalavimai išmokėti pagrindinę sumą ir palūkanas būtų patenkinti pirmumo teise, negali būti didesnės kaip 25 proc. gryųjų aktyvų. Kai į tokias vieno emitento obligacijas investuojama daugiau kaip 5 proc., bet ne daugiau kaip 25 proc. gryųjų aktyvų, bendra tokių investicijų suma negali būti didesnė kaip 80 proc. gryųjų aktyvų.

11. Šio straipsnio 9 ir 10 dalyse numatyti vertybiniai popieriai ir pinigų rinkos priemonės nėra įskaitomi skaičiuojant investicijas, kurioms pagal šio straipsnio 5 dalį taikoma maksimali leistina 40 proc. riba. Šio straipsnio 1–10 dalyse numatytos ribos negali būti sudedamos, todėl investicijų į vieno asmens išleistus vertybinius popierius, pinigų rinkos priemones, indėlius suma, negavus atskiros Vertybinių popierių komisijos leidimo, kaip, kad aprašyta 9 dalyje, negali būti didesnė kaip 35 proc. Pensijų fondo turtą sudarančių gryųjų aktyvų.

12. Pensijų fondo turtą gali sudaryti išleidžiami nauji vertybiniai popieriai, jeigu emisijos sąlygose yra numatytas įsipareigojimas įtraukti šiuos vertybinius popierius į vertybinių popierių biržos oficialųjį prekybos sąrašą ar reguliuojamos rinkos prekybos sąrašą ir jeigu į sąrašą bus įtraukiama ne vėliau kaip per 1 metus nuo išleidimo.

13. Bendra investicijų į kolektyvinio investavimo subjektus, kurie veikia ne pagal 1985 m. gruodžio 20 d. Tarybos direktyvos 85/611/EEB dėl įstatymų ir kitų teisės aktų, susijusių su kolektyvinio investavimo į perleidžiamus vertybinius popierius subjektais (KIAVPS), derinimo (su paskutiniais pakeitimais) nustatytas taisyklės, gali būti ne didesnė kaip 20 proc. pensijų fondo gryųjų aktyvų.

14. Pensijų fondo turtas į Bendrovės arba susijusių valdymo įmonių valdomų kolektyvinio investavimo subjektų investicinius vienetų ar akcijas gali būti investuojamas tik gryųjų aktyvų verte.

Finansinės rizikos valdymo metodai

Investuojant Pensijų fondo turtą yra susiduriama su įvairiomis finansinėmis rizikomis ir siekiant sumažinti jų poveikį Pensijų fondo veiklai jos bus atitinkamai kontroliuojamos.

Kredito rizika – rizika patirti nuostolius dėl skolos vertybinių popierių emitento nesugebėjimo įvykdyti savo skolinius įsipareigojimus. Siekiant sumažinti kredito riziką, didžioji dalis Pensijų fondo lėšų investuojamos į žemos rizikos (aukšto investicinio reitingo) skolos popierius.

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.

Palūkanų normos rizika – rizika patirti nuostolius dėl nepalankių palūkanų pokyčių, kurie gali turėti įtakos skolos vertybinių popierių kainoms. Siekiama, kad Fondo turtą sudarančių vertybinių popierių ir pinigų rinkos priemonių vidutinė trukmė atitiktų Fondo dalyvių vidutinę sutarties trukmę.

Valiutos kurso pokyčio rizika – rizika patirti nuostolius dėl nepalankaus užsienio valiutos kurso pokyčio lito atžvilgiu, kuris sąlygoja neigiamą turto, laikomo ta užsienio valiuta, pokytį. Siekiant sumažinti valiutų kurso pokyčių riziką didžioji dalis lėšų investuojama litais bei bazine valiuta, kuri nesvyruoja lito atžvilgiu.

Rinkos likvidumo rizika – rizika patirti nuostolius dėl mažo rinkos likvidumo, kuris neleidžia parduoti vertybinius popierius ar pinigų rinkos priemones norimu laiku ir už norimą kainą, arba apskritai atima galimybę parduoti turimą turtą (investiciją). Siekiant sumažinti rinkos likvidumo riziką daugiausiai investuojama į tuos vertybinius popierius, kurie kotiruojami pripažintose pasaulio biržose ar rinkose arba kurių kainą reguliariai skelbia vertybinių popierių tarpininkai ar visuotinės informavimo priemonės.

Sandorio šalies rizika – rizika patirti nuostolius dėl sandorio šalies nesugebėjimo įvykdyti savo finansinius įsipareigojimus, kurie buvo įgyti sudarant sandorį. Siekiant sumažinti sandorio šalies riziką, investicijų bendrovė sudaro sandorius su žemos rizikos (aukšto investicinio reitingo) kredito institucijomis, o jų nesant, su patikimais partneriais, specializuojančiais atitinkamoje srityje.

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 yra naudojamosi mokėjimų agento paslaugomis, arba prekybinė veikla yra vykdoma organizuotose rinkose, kuriose atsiskaitymams taikomi visuotiniai pripažinti principai.

Akcijų kainos, palūkanų normų, valiutos kurso, kredito rizikos gali būti valdomos naudojant išvestines investicines priemones: išankstinius, ateities, apsikeitimo, pasirinkimo sandorius ir priemones bei jų derinius. 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.

Grynųjų aktyvų padidėjimo ir sumažėjimo pripažinimo principai

Grynųjų aktyvų padidėjimas tai:

1. Dalyvių įmokų į Fondą straipsnyje parodoma į pensinį fondą gautų kaupiamųjų pensijų įmokų suma.
2. Iš kitų fondų gautų sumų straipsnyje parodoma iš pensijų fondų gautos ir gautinos dalyviui priklausančios sumos, kai dalyvis pereina į pensijų fondą iš kitų pensijų fondų.
3. Garantinių įmokų straipsnyje parodoma gautų ir gautinų garantinių įmokų suma, jeigu trečia šalis yra įsipareigojusi garantuoti tam tikrą pajamingumą.
4. Palūkanų pajamų straipsnyje parodomas finansinio turto, kai jis negali būti patikimai įvertintas tikrąja verte, palūkanos. Amortizuota savikaina įvertinto finansinio turto palūkanų pajamos apskaičiuojamos taikant apskaičiuotų palūkanų metodą.
5. Dividendų straipsnyje parodomi nuosavybės vertybinių popierių dividendai (gauti ir paskelbti).
6. Pelną dėl investicijų vertės pasikeitimo ir pardavimo straipsnyje parodomas pinigų rinkos priemonių, vertybinių popierių, investicinio turto, išvestinių finansinių priemonių ir kitų investicijų vertės padidėjimo ir jų pardavimo sandorių pelnas, įskaitant ir tikrąją vertę įvertinto turto vertės pokytį dėl užsienio valiutos kursų pokyčio.
7. Pelną dėl užsienio valiutos kursų pokyčio straipsnyje parodomi teigiami pasikeitimai, susidarę atsiskaitant užsienio valiuta, finansinių ataskaitų valiutos ir užsienio valiutos oficialaus santykio pasikeitimo iš naujo įvertinant užsienio valiuta gautinas ir mokėtinas sumas, užsienio valiuta laikomus terminuotuosius indėlius, užsienio valiutą banko sąskaitose.
8. Išvestinių finansinių priemonių sandorių pelno straipsnyje parodomas teigiamas tikrosios vertės pasikeitimas, nustatytas vertinant iš išvestinės finansinės priemonės atsirandantį finansinį turtą ir finansinį įsipareigojimą. Pasikeitimas parodomas to laikotarpio, kada atsiranda, ataskaitoje.
9. Kito grynųjų aktyvų vertės padidėjimo straipsnyje parodomas pelnas dėl finansinių įsipareigojimų vertės sumažėjimo, delspinių pajamos, kitos pajamos ir kituose šios ataskaitos straipsniuose neparodytas grynųjų aktyvų vertės padidėjimas.

Grynųjų aktyvų sumažėjimas tai:

1. Išmokų fondo dalyviams straipsnyje parodoma per ataskaitinį laikotarpį iš Pensijų fondo sąskaitos privalomos mokėti išmokos.
2. Išmokų kitiems fondams straipsnyje parodoma kitiems subjektams sumokėtos ar privalomos sumokėti pensijų fondo dalyviui priklausančios pinigines lėšas, kai dalyvis pereina į kitą pensijų fondą.
3. Nuostolių dėl investicijų vertės pasikeitimo ir pardavimo straipsnyje parodomi pinigų rinkos priemonių, vertybinių popierių, investicinio turto, išvestinių finansinių priemonių ir kitų investicijų vertės sumažėjimo (nuvertėjimo) ir pardavimo nuostoliai, jeigu tokių yra. Taip pat įtraukiamas ir tikrąją vertę įvertinto turto vertės pokytis dėl užsienio valiutos kursų pasikeitimo. Panaikinus praėjusiais ataskaitiniais laikotarpiais pripažintus nuostolius dėl vertės sumažėjimo ar jų dalį, nuostolių sumažėjimas taip pat parodomas šiame straipsnyje.
4. Nuostolių dėl užsienio valiutos kursų pokyčio straipsnyje parodomi neigiami pasikeitimai, susidarę atsiskaitant užsienio valiuta, dėl finansinių ataskaitų valiutos ir užsienio valiutos oficialaus santykio pasikeitimo, įvertinant užsienio valiuta gautinas ir mokėtinas sumas, užsienio valiuta laikomus terminuotuosius indėlius, užsienio valiutą banko sąskaitose.
5. Išvestinių finansinių priemonių sandorių nuostolių straipsnyje parodomas neigiamas tikrosios vertės pasikeitimas, nustatytas vertinant iš išvestinės finansinės priemonės atsirandantį finansinį turtą ir finansinį įsipareigojimą. Pasikeitimas parodomas to laikotarpio, kada jis atsiranda, ataskaitoje. Kartu su finansiniu turtu ir finansiniu įsipareigojimu, atsirandančiais iš išvestinės finansinės priemonės sandorių, parodomas susijusios ataskaitinio laikotarpio šių sandorių sudarymo išlaidos.
6. Valdymo sąnaudų straipsnyje parodomas Pensijų fondo ataskaitinio laikotarpio sąnaudos, nustatytos pensijų fondo taisyklėse.
7. Kito grynųjų aktyvų vertės sumažėjimo straipsnyje parodomas kituose ataskaitos straipsniuose neparodytas grynųjų aktyvų vertės sumažėjimas.
8. Sąnaudų kompensavimo straipsnyje parodomas sumos, kuriomis mažinamos subjekto ataskaitinio laikotarpio sąnaudos, tai yra pensijų fondo taisyklėse nenumatytos arba nustatytas ribas viršijančios išlaidos, kurias apmoka bendrovė. Kompensavimo sumos ataskaitoje parodomas su minuso ženklu.

Atskaitymų valdymo įmonei taisyklės

Atlyginimas Bendrovei už Fondo valdymą susideda iš pradinio Pensijų turto valdymo mokesčio ir metinio Fondo turto valdymo mokesčio.

Iš kiekvienos VSDF valdybos Bendrovei pervedamos pensijų įmokos Bendrovė išskaičiuoja pradinį Fondo turto valdymo mokestį, kurio dydis 2,95 proc. nuo pervedamos pensijų įmokos.

Iš Fondo turto Bendrovė išskaičiuoja turto valdymo mokestį, kurio dydis yra ne daugiau kaip 1 proc. nuo vidutinės metinės Fondo grynųjų aktyvų vertės. Valdymo mokestis priskaičiuojamas už kiekvieną darbo dieną ir kartą per mėnesį atskaitomas nuo Fondo turto. Valdymo mokestis už vieną dieną skaičiuojamas nustatytą valdymo mokestį padalinant iš faktinio kalendorinių metų darbo dienų skaičiaus keturių skaičių po kablelio tikslumu. Jei šie atskaitymai per vienerius kalendorinius metus viršija 1 proc. nuo Dalyvio pensijų sąskaitoje apskaitytų lėšų vidutinės metinės vertės, Bendrovė iki kitų kalendorinių metų 15 dienos perveda perviršį į Dalyvio pensijų sąskaitą ir konvertuoja jį į apskaitos vienetą.

Informacija Dalyviams apie valdymo mokesčių dydžius pateikiama Depozitoriumo interneto puslapyje (www.dnb.lt).

Jei Dalyvis pereina į Bendrovės pensijų fondą iš kitos pensijų kaupimo Bendrovės pensijų fondo, nuo iš kitos pensijų kaupimo Bendrovės pensijų fondo pervedamų Dalyvio piniginių lėšų atskaitymai neišskaičiuojami.

Atskaitymų valdymo įmonei taisyklės (tęsinys)

Dalyvio perėjimo į kitą Bendrovės ar kitos pensijų kaupimo Bendrovės valdomą pensijų fondą išlaidas sudaro Bendrovės išlaidos, susijusios su pensijų sąskaitos uždarymu bei lėšų pervedimu, jos sudaro iki 0,2 proc. Dalyvio vardu pervedamų piniginių lėšų ir yra atskaitomos nuo Dalyviui pervedamų piniginių lėšų sumos.

Taisyklių numatytais atvejais Bendrovė išskaičiuoja atskaitymus, lygius Taisyklių numatytų išlaidų ir išlaidų, susijusių su Dalyvio pritraukimu į pensijų kaupimo bendrovę, sumai, kuri sudaro iki 3,5 proc. Dalyvio vardu pervedamų piniginių lėšų ir yra atskaitoma iš Dalyviui pervedamų piniginių lėšų sumos.

Bendrovė iš pensijų turto nedengia jokių kitų išlaidų bei neišskaičiuoja jokių kitų atskaitymų, išskyrus atvejus, numatytus Taisyklėse. Išskaičiuoti atskaitymai tampa Bendrovės nuosavybe.

Investicijų įvertinimo metodai bei investicijų pervaldinimo periodiškumas

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

1. Fondo investicijų tikroji vertė skaičiuojama pagal LR Vertybinių popierių komisijos patvirtintą ir Fondo turto vertės skaičiavimo metu galiojančią Grynųjų 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;
5. vertybiniai popieriai pripažįstami grynųjų aktyvų ataskaitoje ir jų pripažinimas nutraukiamas taikant atsiskaitymo datos apskaitą.

Grynųjų aktyvų vertės (GAV) skaičiavimo metodika

Fondo grynųjų aktyvų vertė nustatoma iš Fondo turto rinkos vertės atėmus trumpalaikius ir ilgalaikius finansinius įsipareigojimus. Praėjusios darbo dienos apskaičiuota Fondo grynųjų aktyvų vertė iki kitos darbo dienos 12.00 val. paskelbiama tinklalapyje www.dnb.lt.

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

Apskaičiuojant grynųjų aktyvų vertę priemonių, kuriomis prekiaujama reguliuojamose rinkose, tikroji vertė nustatoma taip:

1. Skolos vertybiniai popieriai, įtraukti į Nasdaq OMX Vilnius biržos prekybos sąrašus, vertinami pagal paskutinę žinomą geriausią pirkimo kainą, gautą iki 14.00 val., kurią viešai skelbia AB DNB bankas, AB „Swedbank“ ir AB SEB bankas. 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 paskutinįją 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 aukščiausią aprašytą tvarką, prie vertybinio popieriaus kainos pridodant atkarpos išmoką, kuri būtų sukaupta kitą darbo dieną (T+1). Kitų skolos vertybinių popierių vertė apskaičiuojama prie vertybinio popieriaus kainos pridodant 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 Nasdaq OMX Vilnius 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 turtą įrašomi įsigijimo verte ir perkainojami kitą fondo darbo dieną pagal GAV skaičiavimo procedūras.

Grynųjų aktyvų vertės (GAV) skaičiavimo metodika (tęsinys)

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

1. Gryniesiems pinigams ir lėšos kredito įstaigose vertinami nominalia verte.
2. Terminuoti indėliai bankuose vertinami pagal amortizuotos savikainos vertę.
3. 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 procedūroje), kuris finansų rinkoje yra visuotinai taikomas ir pripažintas.

Bendrovės atskaitymai iš Fondo turto turi būti vertinami kaupimo principu, kiekvieną darbo dieną.

Atskaitymai nuo Dalyvio vardu įmokėtų pensijų įmokų atliekami tą pačią dieną, kai Dalyvio įmokos buvo konvertuotos į Fondo apskaitos vienetus.

Fondo grynųjų aktyvų vertė ir Apskaitos vieneto vertė skaičiuojama kiekvieną darbo dieną. Ne rečiau kaip kartą per mėnesį pagal Metodikoje pateiktą formulę skaičiuojama 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 grynųjų aktyvų vertės dydį.

Apskaitos vieneto vertės nustatymo taisyklės

Į Fondo sąskaitą pervestos Dalyviui priklausančios piniginės lėšos (pensijų įmokos, iš kito Bendrovės pensijų Fondo ar kitos pensijų kaupimo Bendrovės pensijų Fondo pervestos Dalyvio lėšos) konvertuojamos į apskaitos vienetus. Dalyvio dalis pensijų turte nustatoma pagal Dalyvio sąskaitoje įrašytų apskaitos vienetų skaičių.

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

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

AVS – apskaitos vienetų skaičius;

PPL – į Dalyvio sąskaitą pervestos piniginės lėšos;

A – Taisyklių nustatyti atskaitymai;

AVV – apskaitos vieneto vertė, apskaičiuojama ir skelbiama Taisyklių 2 priede nustatyta tvarka.

Apskaitos vienetų skaičius apvalinamas pagal matematines taisykles iki 4 skaičių po kablelio.

Apskaitos vienetai į pinigines lėšas konvertuojami piniginių lėšų pervedimo dienos apskaitos vieneto verte. Pervedamų piniginių lėšų suma apskaičiuojama pagal formulę:

$$PPLS = (AVS * AVV) - PA$$

PPLS – pervedamų piniginių lėšų suma;

AVS – apskaitos vienetų skaičius;

AVV – apskaitos vieneto vertė, apskaičiuojama ir skelbiama nustatyta tvarka;

PA – Taisyklių nustatyti atskaitymai.

Pobalansiniai įvykiai

Kitų reikšmingų įvykių po gryųjų aktyvų ataskaitos datos nebuvo.

AIŠKINAMOJO RAŠTO PASTABOS

1. Grynujų aktyvų, apskaitos vienetų skaičių ir vertė

	Ataskaitinio laikotarpio pradžioje (2011 12 31)	Ataskaitinio laikotarpio pabaigoje (2013 06 30)	Prieš metus (2012 06 30)	Prieš dvejus metus (2011 06 30)
Grynujų aktyvų vertė, Lt	189 690 974	204 930 250	171 221 591	141 067 020
Apskaitos vieneto vertė (Lt)	1,4548	1,4692	1,3872	1,3479
Apskaitos vienetų skaičius	130 393 634	139 487 100	123 433 578	104 660 661

2. Per ataskaitinį laikotarpį konvertuotų apskaitos vienetų skaičius bei bendros konvertavimo sumos

	Ataskaitinis laikotarpis 2013 m. I pusmetis		Ataskaitinis laikotarpis 2012 m. I pusmetis	
	Apskaitos vienetų skaičius	Vertė, Litus	Apskaitos vienetų skaičius	Vertė (Litus)
Apskaitos vienetų skaičius (konvertuojant pinigines lėšas į apskaitos vienetus)	11 406 818	16 860 894	11 078 723	15 206 504
Apskaitos vienetų skaičius (konvertuojant vienetus į pinigines lėšas)	2 313 351	3 421 138	1 388 972	1 909 434
Skirtumas	9 093 466	13 439 756	9 689 751	13 297 071

Pensijų fondas „DNB pensija 2“

2013 m. I pusmečio ataskaitos

3. Investicijų portfelio sudėtis

2013 m. birželio 30 d.

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	9	10	11	12	13	14	15
2	Ne nuosavybės vertybiniai popieriai													
2.2	Ne nuosavybės vertybiniai popieriai, įtraukti į Papildomąjį ar jį atitinkantį prekybos sąrašą													
-	Lietuvos Respublika	LT	LT0000605107	LTL	35 000		3 500 000	3 554 145	3 755 535	1.30			2015.04.29	1.83
-	Lietuvos Respublika	LT	LT0000603250	LTL	29 900		2 990 000	3 016 798	3 028 392	1.70			2016.01.31	1.48
-	Lietuvos Respublika	LT	LT0000602146	LTL	10 000		1 000 000	999 034	1 016 353	0.70			2014.06.07	0.50
-	Lietuvos Respublika	LT	LT0000607061	LTL	9 000		900 000	919 359	952 440	3.10			2019.10.25	0.46
-	AB DNB bankas	LT	LT0000405052	LTL	13 000		1 300 000	1 362 153	1 398 411	1.25			2015.05.07	0.68
-	Lietuvos Respublika	LT	LT0000605115	LTL	50 280		5 028 000	5 246 824	5 658 189	1.90			2016.10.20	2.76
-	Lietuvos Respublika	LT	LT1000600270	EUR	1 600		5 524 480	5 518 496	6 271 808	2.50			2017.09.22	3.06
-	Lietuvos Respublika	LT	LT0000605123	LTL	7 400		740 000	829 806	811 262	2.20			2017.06.07	0.40
-	Lietuvos Respublika	LT	LT0000603243	LTL	10 000		1 000 000	1 046 587	1 063 506	1.30			2015.02.27	0.52
-	AB DNB bankas	LT	LT0000431132	LTL	26 000		2 600 000	2 592 707	2 687 820	0.45			2013.10.07	1.31
-	Lietuvos Respublika	LT	LT0000610057	LTL	84 315		8 431 500	9 664 012	9 483 768	3.90			2022.05.17	4.63
-	Lietuvos Respublika	LT	LT0000611014	LTL	29 500		2 950 000	2 804 048	3 145 845	1.70			2016.02.10	1.54
-	Lietuvos Respublika	LT	LT0000607053	LTL	38 758		3 875 800	4 079 512	4 317 223	2.90			2018.03.28	2.11
-	Lietuvos Respublika	LT	LT0000603235	LTL	47 000		4 700 000	4 765 004	4 904 455	0.50			2013.08.05	2.39
	Iš viso:				391 753		44 539 780	46 398 485	48 495 007					23.66
2.3	Ne nuosavybės vertybiniai popieriai, kuriais prekiaujama kitose reguliuojamose rinkose													
-	Austrijos Respublika	AU	AT0000A011T9	EUR	1 290		4 454 112	5 099 989	5 068 291	0.65			2016.09.15	2.47
-	Latvijos Respublika	LV	XS0189713992	EUR	130		448 864	433 154	465 029	0.84			2014.04.02	0.23
-	Latvijos Respublika	LV	XS0350977244	EUR	200		690 560	728 541	801 797	2.24			2018.03.05	0.39
-	Lietuvos Respublika	LT	XS0212170939	EUR	1 286		4 440 301	4 436 873	4 722 223	1.81			2016.02.10	2.30
-	Bulgarijos Respublika	BG	XS0802005289	EUR	700		2 416 960	2 588 143	2 648 508	2.81			2017.07.09	1.29
-	Čekijos Respublika	CZ	XS0368800073	EUR	780		2 693 184	2 998 828	3 125 477	1.65			2018.06.11	1.53
-	Lietuvos Respublika	LT	XS0327304001	EUR	1 631		5 631 517	6 112 624	6 120 332	3.25			2018.02.07	2.99
-	EWE AG	DE	DE000A0DLU51	EUR	315		1 087 632	1 048 477	1 173 451	0.64			2014.10.14	0.57
-	Lenkijos Respublika	PL	XS0242491230	EUR	2 849		9 837 027	10 678 017	10 605 750	1.13			2016.02.01	5.18
-	Slovakijos Respublika	SK	SK4120007204	EUR	470 000		1 622 816	1 760 918	1 824 926	2.13			2020.04.27	0.89
-	ELERING	EE	XS0645947457	EUR	400		1 381 120	1 451 820	1 571 037	2.64			2018.07.12	0.77
-	Latvijos Respublika	LV	XS0747927746	USD	1 695		4 491 072	4 901 179	4 922 234	3.00			2017.02.22	2.40
-	AS Latvenergo	LV	LV0000801165	EUR	172		593 882	590 600	588 480	3.00			2020.05.22	0.29
-	Slovakijos Respublika	SK	XS0299989813	EUR	200		690 560	740 195	776 102	1.23			2017.05.15	0.38
-	CEZ AS	CZ	XS0271020850	EUR	5		863 200	892 995	897 185	0.62			2013.10.17	0.44

Pensijų fondas „DNB pensija 2“

2013 m. I pusmečio ataskaitos

-	Lenkijos Respublika	PL	XS0410961014	EUR	600		2 071 680	2 189 279	2 181 156	0.95			2014.02.03	1.06
-	AS Latvenergo	LV	LV0000801090	EUR	635		2 192 528	2 193 427	2 234 374	2.70			2017.12.15	1.09
-	Prancūzijos Respublika	FR	FR0010288357	EUR	2 048 000		7 071 334	7 686 353	7 628 866	0.63			2016.04.25	3.72
-	Bulgarijos Respublika	BG	XS0145623624	USD	450		1 192 320	1 340 677	1 358 052	1.59			2015.01.15	0.66
-	EFSF	LU	EU000A1G0AU4	EUR	900		3 107 520	3 194 985	3 223 791	1.09			2017.09.15	1.57
-	Čekijos Respublika	CZ	XS0427020309	EUR	500		1 726 400	1 857 865	1 863 630	0.75			2014.11.05	0.91
-	TELEFONICA EM. 06/16	ES	XS0241946630	EUR	335		1 156 688	1 055 759	1 237 655	2.28			2016.02.02	0.60
-	Čekijos Respublika	CZ	XS0194957527	EUR	1 230		4 246 944	4 479 184	4 410 736	0.76			2014.06.23	2.15
-	Eesti Energia AS	EE	XS0763379343	EUR	700		2 416 960	2 503 060	2 664 467	2.79			2018.10.02	1.30
-	Olandijos karalystė	NL	NL0000102283	EUR	900 000		3 107 520	3 564 000	3 547 498	0.57			2016.07.15	1.73
-	Lietuvos Respublika	LT	XS0457764339	USD	1 418		3 757 133	4 143 300	4 118 193	2.43			2015.01.15	2.01
-	Lietuvos Respublika	LT	XS0435153068	EUR	2 444		8 438 643	9 559 313	9 053 190	2.01			2014.06.22	4.42
-	Eesti Energia AS	EE	XS0235372140	EUR	875		3 021 200	3 002 969	3 376 150	3.12			2020.11.18	1.65
Iš viso:					3 439 740		84 849 677	90 503 982	92 208 580					44.99
Iš viso Ne nuosavybės vertybiniai popieriai:					3 831 493		129 389 457	136 902 467	140 703 587					68.66
3	Kolektyvinio investavimo subjektai													
3.1	Kolektyvinio investavimo subjektų, atitinkančių Kolektyvinio investavimo subjektų 61 str. 1d. reikalavimus, vienetai (akcijos)													
-	Morgan ST US Equity Growth Stanley Fund	LU	LU0073232471	USD	21 959	Morgan Stanley Investment Management		1 429 259	2 647 831		www.Morganstanley.com	KIS 3		1.29
-	Fidelity Global Health Care Fund	LU	LU0114720955	EUR	61 372	Fidelity (FIL lux S.A)		3 706 157	4 776 381		www.fidelity-international.com	KIS 3		2.33
-	ING (L) - Invest Sustainable Equit Fund	LU	LU0191250769	EUR	1 279	ING Investment Management		863 200	933 131		www.ingim.com	Kis 3		0.46
-	Schroder ISF Emerg Asia A EUR Acc Fund	LU	LU0248173857	EUR	54 808	Schroder Investment Management S.A.		3 798 080	3 487 724		www.schroders.lu	KIS 3		1.70
-	SCHRODER INTL EURO CORPORATE ACC	LU	LU0113258742	EUR	61 587	Schroder Investment Management		3 970 720	4 025 399		www.schroders.lu	KIS 1		1.96
-	Franklin Templeton Latin America Fund	LU	LU0128526570	USD	5 070	Franklin Templeton Investment Funds		975 631	929 798		www.templeton.lu	KIS 3		0.45
-	Allianz RCM Euroland Equity Growth Fund	LU	LU0256883843	EUR	416	Allianz Global Investors Luxembourg S.A.		1 725 971	2 064 930		www.allianzglobalinvestors.lu	KIS 3		1.01
-	Parvest Equity USA Small Cap	LU	LU0823410997	USD	4 774	BNP Paribas Investment Partners		1 749 269	1 734 469		www.bnpparibas-ip.com	Kis 3		0.85
-	DB X - Trackers DAX ETF	LU	LU0274211480	EUR	10 780	Db x-trackers		2 340 661	2 927 818		www.dbxtrackers.com	KIS 3		1.43
-	COMSTAGE ETF NASDAQ 100	LU	LU0378449770	EUR	34 600	Commerz Derivatives Funds Solutions		2 000 946	2 715 243		www2.comstage.commerzbank.com	KIS 3		1.32

Pensijų fondas „DNB pensija 2“

2013 m. I pusmečio ataskaitos

-	MGI DAM Multi Manager Global Equity FUND	IE	IE00B6Z5SN00	USD	10 732	Mercer Global Investments Mgmt		2 980 671	3 582 469		www.mercer.com	KIS 3		1.75
-	DNB Fund - Global SRI-A	LU	LU0029375739	EUR	527 393	DNB Asset Management		3 781 677	4 682 840		www.dnb.no/lu	KIS 3		2.29
-	DNB-GLB Emerging MKTS SRI Fund	LU	LU0090738252	USD	468 017	DNB Asset Management		3 179 503	2 967 707		www.dnb.no/lu	KIS 3		1.45
-	Aberdeen GL Emerg MKT Smaller Companies I2	LU	LU0278915607	USD	73 911	ABERDEEN GLOBAL SERVICES SA		3 974 399	3 846 186		www.aberdeen-asset.com	Kis 3		1.88
-	ABERDEEN GL-ETHICAL WD EQUITY FUND	LU	LU0566482674	USD	81 644	ABERDEEN GLOBAL SERVICES S.A		1 990 061	2 378 122		www.aberdeen-asset.com	KIS 3		1.16
-	HSBC Euro Govt bond fund	FR	FR0000971293	EUR	618	HSBC Global Asset Management (France)		5 628 068	5 962 685		www.hsbcinvestments.fr	KIS 1		2.91
-	DB X-TR IBX EUR SOV EZ 3-5	LU	LU0290356954	EUR	4 480	Db x-trackers		2 758 041	2 835 848		www.dbxtrackers.de	KIS 1		1.38
-	Franklin Global Growth A Acc	LU	LU0122613069	USD	34 101	Franklin Templeton Investment Funds		1 059 841	1 073 394		www.franklintempleton.com	Kis 3		0.52
	Iš viso:				1 457 541			47 912 156	53 571 975					26.14
3.2	Kitų kolektyvinio investavimo subjektų vienetai													
-	Lithuania SME Fund	LT	Lithuania SME Fund	EUR	67 725	Baltcap Management		233 841	222 201		www.baltcap.com	KIS5		0.11
-	LORDS LB BALTIC FUND III	LT	LORDS LB BALTIC FUND III	EUR	175 632	UAB Lords LB asset management		604 240	604 240			KIS 5		0.29
	Iš viso:				243 357			838 081	826 441					0.40
	Iš viso Kolektyvinio investavimo subjektai:				1 700 898			48 750 237	54 398 417					26.54
7	Pinigai													
-	AB DNB bankas	LT		USD					517 432	0.10				0.25
-	AB DNB bankas	LT		NOK					206	1.18				0.00
-	AB DNB bankas	LT		LTL					90 479	0.00				0.04
-	AB DNB bankas	LT		EUR					2 635 059	0.00				1.29
-	AB DNB bankas	LT		LTL					6 741 468	0.00				3.29
	Iš viso:								9 984 642					4.87
	Iš viso Pinigai:								9 984 642					4.87
9	IŠ VISO:								205 086 646					100

Pensijų fondas „DNB pensija 2“

2013 m. I pusmečio ataskaitos

2012 m. birželio 30 d.

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 / dalis portfelyje, %
1	2	3	4	5	6	7	8	12	13	14	15	16	18	19
1	Nuosavybės vertybiniai popieriai													
1.1	Nuosavybės vertybiniai popieriai, įtraukti į Oficialųjį ar jį atitinkantį prekybos sąrašą													
-	AB Lesto	LT	LT0000128449	EUR	6 902		23 831	23 831	13 727					0.01
	Iš viso Nuosavybės vertybiniai popieriai:				6 902		23 831	23 831	13 727					0.01
2	Ne nuosavybės vertybiniai popieriai													
2.2	Ne nuosavybės vertybiniai popieriai, įtraukti į Papildomąjį ar jį atitinkantį prekybos sąrašą													
-	Lietuvos Respublika	LT	LT0000610040	LTL	20 000		2 000 000	2 086 238	2 096 660	1.30			2013.01.24	1.22
-	Lietuvos Respublika	LT	LT0000611014	LTL	29 500		2 950 000	2 807 372	2 944 265	4.25			2016.02.10	1.72
-	Lietuvos Respublika	LT	LT0000605107	LTL	35 000		3 500 000	3 554 145	3 678 374	3.30			2015.04.29	2.15
-	Lietuvos Respublika	LT	LT0000603235	LTL	47 000		4 700 000	4 852 020	5 028 911	1.60			2013.08.05	2.94
-	Lietuvos Respublika	LT	LT1000600270	EUR	1 600		5 524 480	5 570 797	5 876 245	4.40			2017.09.22	3.43
-	AB DNB bankas	LT	LT0000431132	LTL	26 000		2 600 000	2 592 707	2 716 223	1.97			2013.10.07	1.59
-	Lietuvos Respublika	LT	LT1000600304	EUR	6 000		2 071 680	1 998 028	2 064 448	1.10			2012.10.24	1.21
-	Lietuvos Respublika	LT	LT0000607053	LTL	47 139		4 713 900	4 642 389	4 823 253	5.00			2018.03.28	2.82
-	Lietuvos Respublika	LT	LT0000605115	LTL	44 000		4 400 000	4 459 083	4 614 386	4.40			2016.10.20	2.69
-	AB DNB bankas	LT	LT0000405052	LTL	13 000		1 300 000	1 362 153	1 372 430	3.21			2015.05.07	0.80
-	Lietuvos Respublika	LT	LT0000610057	LTL	6 500		650 000	649 168	654 401	5.50			2022.05.17	0.38
-	Lietuvos Respublika	LT	LT0000602146	LTL	10 000		1 000 000	999 034	999 692	2.40			2014.06.07	0.58
	Iš viso:				285 739		35 410 060	35 573 135	36 869 286					21.53
2.3	Ne nuosavybės vertybiniai popieriai, kuriais prekiaujama kitose reguliuojamose rinkose													
-	Latvijos Respublika	LV	XS0189713992	EUR	130		448 864	433 154	471 500	1.92			2014.04.02	0.28
-	Čekijos Respublika	CZ	XS0194957527	EUR	230		794 144	841 314	849 809	1.08			2014.06.23	0.50
-	Prancūzijos Respublika	FR	FR0110979186	EUR	72		248 602	254 349	259 755	0.59			2012.07.12	0.15
-	Vodafone Group PLC	GB	XS0236598164	EUR	415		1 432 912	1 352 551	1 479 326	0.92			2012.11.29	0.86
-	RWE FINANCE BV	NL	XS0147030554	EUR	285		984 048	1 051 987	1 040 997	1.03			2012.10.26	0.61
-	TELEFONICA EM. 06/16	ES	XS0241946630	EUR	335		1 156 688	1 055 759	1 082 763	7.04			2016.02.02	0.63
-	Prancūzijos Respublika	FR	FR0010854182	EUR	690		2 382 432	2 530 143	2 600 930	2.30			2020.04.25	1.52
-	Austrijos Respublika	AU	AT0000386115	EUR	690		2 382 432	2 651 491	2 772 741	2.17			2020.07.15	1.62
-	Eesti Energia AS	EE	XS0763379343	EUR	500		1 726 400	1 744 672	1 803 223	3.64			2018.10.02	1.05
-	Lietuvos Respublika	LT	XS0541528682	USD	500		1 381 200	1 367 388	1 478 301	3.95			2017.09.14	0.86
-	Norvegijos karalystė	NO	NO0010313356	NOK	4 370		2 001 853	2 244 078	2 265 710	1.54			2017.05.19	1.32
-	Bulgarijos Respublika	BG	XS0145623624	USD	450		1 243 080	1 397 753	1 429 739	3.61			2015.01.15	0.84
-	Latvijos Respublika	LV	XS0638326263	USD	250		690 600	644 330	695 552	5.19			2021.06.16	0.41
-	Latvijos Respublika	LV	XS0747927746	USD	450		1 243 080	1 289 368	1 302 743	4.56			2017.02.22	0.76

Pensijų fondas „DNB pensija 2“

2013 m. I pusmečio ataskaitos

-	Latvijos Respublika	LV	XS0350977244	EUR	200		690 560	728 541	758 879	3.88			2018.03.05	0.44
-	Slovakijos Respublika	SK	SK4120007204	EUR	470		1 622 816	1 615 724	1 666 392	3.71			2020.04.27	0.97
-	Čekijos Respublika	CZ	XS0368800073	EUR	780		2 693 184	2 998 828	3 085 448	2.40			2018.06.11	1.80
-	Slovakijos Respublika	SK	XS0299989813	EUR	200		690 560	740 195	742 347	2.83			2017.05.15	0.43
-	Lietuvos Respublika	LT	XS0457764339	USD	730		2 016 552	2 198 732	2 239 860	3.46			2015.01.15	1.31
-	ELERING	EE	XS0645947457	EUR	200		690 560	682 356	756 950	3.67			2018.07.12	0.44
-	Slovėnijos Respublika	SI	XS0292653994	EUR	450		1 553 760	1 498 892	1 510 095	4.80			2018.03.22	0.88
-	IBERDROLA FIN SA	ES	XS0362224254	EUR	100		345 280	342 172	350 308	4.27			2013.05.09	0.20
-	Lietuvos Respublika	LT	XS0327304001	EUR	2 115		7 302 672	7 457 599	7 648 541	4.28			2018.02.07	4.47
-	Lietuvos Respublika	LT	XS0435153068	EUR	1 564		5 400 179	6 321 860	6 162 048	2.14			2014.06.22	3.60
-	Čekijos Respublika	CZ	XS0427020309	EUR	500		1 726 400	1 857 865	1 907 765	1.21			2014.11.05	1.11
-	Lenkijos Respublika	PL	XS0242491230	EUR	250		863 200	878 090	929 453	1.83			2016.02.01	0.54
-	Eesti Energia AS	EE	XS0235372140	EUR	570		1 968 096	1 915 997	2 030 988	4.44			2020.11.18	1.19
-	GE CAPITAL EURO FUND	IE	XS0244082219	EUR	320		1 104 896	1 052 855	1 135 870	1.10			2013.02.14	0.66
-	EWE AG	DE	DE000A0DLU51	EUR	315		1 087 632	1 048 477	1 196 131	1.32			2014.10.14	0.70
-	Lietuvos Respublika	LT	XS0163880502	EUR	875		3 021 200	2 972 627	3 117 630	1.90			2013.03.05	1.82
-	Lietuvos Respublika	LT	XS0212170939	EUR	811		2 800 221	2 681 657	2 875 705	3.38			2016.02.10	1.68
-	CARGILL INC	US	XS0252760607	EUR	186		642 221	590 843	663 357	1.28			2013.04.29	0.39
-	CEZ AS	CZ	XS0271020850	EUR	237		818 314	758 986	868 571	1.59			2013.10.17	0.51
Iš viso:					20 240		55 154 637	57 200 633	59 179 429					34.56
2.4	Išleidžiami nauji ne nuosavybės vertybiniai popieriai													
-														
Iš viso:														
Iš viso Ne nuosavybės vertybiniai popieriai:					305 979		90 564 697	92 773 768	96 048 715					56.09
3	Kolektyvinio investavimo subjektai													
3.1	Kolektyvinio investavimo subjektų, atitinkančių Kolektyvinio investavimo subjektų 61 str. 1d. reikalavimus, vienetai (akcijos)													
-	DNB Fund - Global SRI-A	LU	LU0029375739	EUR	396 993	DNB Asset Management		2 745 850	2 951 606		www.dnb.no/lu	KIS 3		1.72
-	Fidelity Global Health Care Fund	LU	LU0114720955	EUR	38 228	Fidelity International Ltd/Bermuda		2 152 397	2 468 291		www.fidelity-international.com	KIS 3		1.44
-	MGI DAM Multi Manager Global Equity FUND	IE	IE00B6Z5SN00	USD	9 814	Mercer Global Investments Mgmt		2 831 324	2 832 802		www.mercer.com	KIS 3		1.65
-	DB X - Trackers DAX ETF	LU	LU0274211480	EUR	12 040	db Platinum Advisors		2 614 245	2 646 039		www.dbxtrackers.com	KIS 3		1.55
-	ABERDEEN GL-ETHICAL WD EQUITY FUND	LU	LU0566482674	USD	81 644	ABERDEEN GLOBAL SERVICES SA		2 074 783	2 123 565		www.aberdeen-asset.com	KIS 3		1.24
-	COMSTAGE ETF NASDAQ 100	LU	LU0378449770	EUR	34 600	Commerz Derivatives Funds Solutions		2 000 946	2 467 947		www2.comstage.commerzbank.com	KIS 3		1.44
-	DNB BRIC FUND	LU	LU0302238026	EUR	7 262	DNB asset Management		1 921 408	1 835 217		www.dnb.no/lu	KIS 3		1.07

Pensijų fondas „DNB pensija 2“

2013 m. I pusmečio ataskaitos

-	INVESCO ASEAN Equity Fund A	IE	IE0003702317	USD	7 677	INVESCO Asset Management Ireland		1 866 554	1 970 418	www.de.invesco.com	KIS 3		1.15
-	DNB-GLB Emerging MKTS SRI Fund	LU	LU0090738252	USD	38 250	DNB Asset Management		276 241	240 009	www.dnb.no/lu	KIS 3		0.14
-	Allianz RCM Euroland Equity Growth Fund	LU	LU0256883843	EUR	340	Duetscher Investment Trust		1 381 121	1 426 704	www.allianzglobalinvestors.lu	KIS 3		0.83
-	HSBC Euro Govt bond fund	FR	FR0000971293	EUR	454	HSBC Investments France		4 074 306	4 069 608	www.hsbcinvestments.fr	KIS 1		2.38
-	Morgan ST US Equity Growth Stanley Fund	LU	LU0073232471	USD	21 959	Morgan Standley Investment Management		1 490 106	2 375 982	www.Morganstanley.com	KIS 3		1.39
-	DNB pinigų rinkos fondas	LT	LTIF00000187	LTL	646	UAB DNB investicijų valdymas		747 070	834 947	www.dnb nord.lt	KIS 1		0.49
-	HENDERSON HORIZ-PAN EU SC-A2	LU	LU0046217351	EUR	8 070	Henderson Global Investor Ltd/Unite		613 837	558 946	www.henderson.com	KIS 3		0.33
-	Franklin Templeton Latin America Fund	LU	LU0128526570	USD	5 070	Franklin Templeton Investment Funds		1 017 166	1 058 602	www.templeton.lu	KIS 3		0.62
-	Pioneer Funds - European Poten	LU	LU0271656307	EUR	1 015	Pioneer Asset Management S.A		295 412	289 946	www.pioneerinvestments.com	KIS 3		0.17
-	DNB Asian Small Cap Fund	LU	LU0067059799	EUR	145 552	DNB Asset Management		1 908 151	1 805 906	www.dnb.no/lu	KIS 3		1.05
-	BNPP L1-Equity USA Small Cap Fund	LU	LU0126173995	USD	5 773	BNP Paribas Investment Partners		1 688 491	1 708 380	www.bnpparibas-ip.com	KIS 3		1.00
-	Morgan ST Sicav EMG MK EQ-A	LU	LU0073229840	USD	22 677	Morgan Standley Investment Management		2 109 823	2 144 257	www.Morganstanley.com	KIS 3		1.25
Iš viso:					838 064			33 809 230	35 809 173				20.91
3.2	Kitų kolektyvinio investavimo subjektų vienetai												
-	Lithuania SME Fund	LT	Lithuania SME Fund	EUR	37 538	Baltcap Management		129 609	100 686	www.baltcap.com	KIS5		0.06
Iš viso:					37 538			129 609	100 686				0.06
Iš viso Kolektyvinio investavimo subjektai:					875 602			33 938 839	35 909 859				20.97
4	Pinigų rinkos priemonės												
Iš viso:													

Iš viso Pinigų rinkos priemonės:											
5	Indėliai kredito įstaigose										
-	AB SEB bankas	LT		EUR				2 093 580	2.12		2012.08.29 1.22
-	Danske bankas	LT		EUR				2 091 016	2.00		2012.07.18 1.22
-	Nordea bankas	LT		LTL				6 047 600	2.04		2012.11.14 3.53
-	Nordea bankas	LT		LTL				3 014 713	1.65		2012.12.12 1.76
-	Danske bankas	LT		EUR				3 466 036	1.50		2012.10.03 2.02
-	Danske bankas	LT		LTL				1 504 813	1.50		2012.11.14 0.88
-	Nordea bankas	LT		LTL				3 007 091	1.27		2012.11.07 1.76
-	Danske bankas	LT		LTL				3 006 329	1.55		2013.02.11 1.76
-	Nordea bankas	LT		LTL				4 503 798	0.98		2012.08.29 2.63
-	Nordea bankas	LT		LTL				2 000 158	1.42		2013.03.29 1.17
	Iš viso:							30 735 131			17.95
	Iš viso Indėliai kredito įstaigose:							30 735 131			17.95
6	Išvestinės investicinės priemonės										
	Iš viso Išvestinės investicinės priemonės:										
7	Pinigai										
-	AB DNB bankas	LT		USD				16	0.10		0.00
-	AB DNB bankas	LT		NOK				85 194	1.16		0.05
-	AB DNB bankas	LT		EUR				2 766 671	0.10		1.62
-	AB DNB bankas	LT		LTL				5 792 187	0.11		3.38
	Iš viso:							8 644 067			5.05
	Iš viso Pinigai:							8 644 067			5.05
8	Kitos priemonės, nenumatytos Kolektyvinio investavimo subjektų įstatymo 57 str. 1 d.										
9	IŠ VISO:							171 351 500			100

2013 m. II ketvirtį daugumos vyriausybių vertybinių popierių pelningumai išaugo. Prie tokios situacijos susiklostymo labiausiai prisidėjo FED pasisakymai apie galimą kiekybinio skatinimo sumažinimą arba galimą jo nutraukimą. Kinijoje susidarė trumpalaikis likvidumo trūkumas.

Eurozonoje ekonominė padėtis iš esmės nesikeičia – vyriausybės susiduria su išaugusiu nedarbu, skolomis ir lėtėjančia ekonomika. Tai verčia ECB kartoti, kad palūkanų normos ir toliau bus palaikomos žemame lygyje, bus daroma viskas, kad ekonomika greičiau atsigaivytų. Prie eurozonos prisijungti pakviesta mūsų kaimynė Latvija.

2013 metų II ketvirčio pradžioje toliau tęsėsi akcijų kainų kilimas, tačiau antroje pusėje trendas apsisvertė ir į rinkas atėjo korekcinės nuotaikos. Pagrindinis veiksnys buvo JAV federalinių rezervų (FED) susirinkimai, jų protokolai bei komentarai sekę po jų. Jau kelis mėnesius iš eilės buvo pasirodžiusios kalbos, kad FED nariai gana aktyviai diskutuoja dėl galimo ekonomikos skatinimo sumažinimo ar nutraukimo. Birželio mėn. įvykusiame FED susirinkime buvo pakeistos JAV nedarbo rinkos prognozės ir pastebėta, kad darbo rinkos situacija gerėja sparčiau nei tikėtasi metų pradžioje. Be to, užsiminta, kad kiekybinis skatinimas bus nutrauktas, kai nedarbo lygis nukris žemiau nei 7 proc. (dabartinis lygis yra 7,6 proc.). Taigi, investuotojai į tai reagavo neigiamai parduodami akcijos. Taip pat, didėjantys sunkumai Kinijos finansiniame sektoriuje ir įvykęs trumpalaikis likvidumo stygius rinkos dalyvius privertė sunerimti ir sumažinti šios šalies augimo tempų prognozes. Nors ketvirčio pradžia buvo optimistinė, tačiau tikėtina mažėsiantis pinigų kiekis rinkoje pasaulio indeksą MSCI World EUR sumažino 1,28 proc., o besivystančių šalių MSCI EM, skaičiuojant EUR, net virš 10 proc.

4. Investicijų pasiskirstymas pagal investavimo strategiją atitinkančius kriterijus

Investicijų pasiskirstymas	Rinkos vertė	Dalis aktyvuose (%)	Rinkos vertė ataskaitinio laikotarpio pradžioje	Dalis aktyvuose ataskaitinio laikotarpio pradžioje (%)
Pagal valiutas:				
EUR	125 955 408	61,46	105 038 486	55,37
LT	49 055 145	23,94	57 672 542	30,40
AUD	-	-	1 126 350	0,59
USD	30 075 887	14,68	23 584 911	12,43
NOK	206	0,00	2 419 988	1,28
Iš viso	205 086 646	100	189 842 277	100
Pagal geografinę zoną:				
Europos ekonominės erdvės valstybės (Islandija, Norvegija, Lichtenšteinas)	-	-	-	-
Kitos Europos Sąjungos valstybės	121 766 616	59,42	104 985 225	55,35
Japonija	-	-	-	-
Lietuva	83 320 030	40,66	84 155 121	44,36
Kitos šalys	-	-	-	-
Jungtinės Amerikos Valstijos ir Kanada	-	-	701 931	0,37
Iš viso	205 086 646	100	189 842 277	100
Pagal investavimo objektus:				
Akcijos	-	-	14 370	0,01
Akcijų kolektyvinio investavimo subjektai (akcijų fondai)	54 398 417	26,54	48 058 185	25,33
Kitos obligacijos	17 829 029	8,70	18 065 294	9,52
Vyriausybių VP	122 874 558	59,96	108 400 760	57,15
Pinigai ir terminuotieji indėliai	9 984 642	4,87	15 303 667	8,07
Iš viso	205 086 646	100	189 842 277	100

Pagal kitus kriterijus Fondo investicijos neskirstomos.

5. Atskaitymai iš Pensijų fondo turto

2013 m. I pusmetis

Atskaitymai	Taisyklėse nustatyti maksimalūs dydžiai	Faktiškai taikomi atskaitymų dydžiai	Per ataskaitinį laikotarpį priskaičiuota atskaitymų suma, Litas
Nuo įmokų	2%	2%	164 406
Nuo turto vertės	1,00%	1,00%	969 348
Už keitimą:			1 256
<i>fondo keitimas toje pačioje bendrovėje daugiau kaip kartą per metus</i>	0,05%	0,05%	6
<i>pensijų kaupimo bendrovės keitimas kartą per metus</i>	0,05%	0,05%	1 250
<i>pensijų kaupimo bendrovės keitimas daugiau kaip kartą per metus</i>	0,05%	0,05%	-
Iš viso			1 135 010
BAR *			
Sąlyginis BIK ir (arba) tikėtinas sąlyginis BIK **			
PAR (portfelio apyvartumo rodiklis)***			

2012 m. I pusmetis

Atskaitymai	Taisyklėse nustatyti maksimalūs dydžiai	Faktiškai taikomi atskaitymų dydžiai	Per ataskaitinį laikotarpį priskaičiuota atskaitymų suma, Litas
Nuo įmokų	2,95%	2,95%	162 569
Nuo turto vertės	1,00%	0,95%	759 649
Už keitimą:			2 709
<i>fondo keitimas toje pačioje bendrovėje daugiau kaip kartą per metus</i>	0,20%	0,20%	
<i>pensijų kaupimo bendrovės keitimas kartą per metus</i>	0,20%	0,20%	2 709
<i>pensijų kaupimo bendrovės keitimas daugiau kaip kartą per metus</i>	3,50%	3,50%	
Iš viso			924 927
BAR *			
Sąlyginis BIK ir (arba) tikėtinas sąlyginis BIK **			
PAR (portfelio apyvartumo rodiklis)***			

*Bendras atskaitymų rodiklis (BAR) apskaičiuojamas bendrąsias veiklos išlaidas, kurias sudaro atskaitymai nuo pensijų įmokų ir nuo pensijų turto, dalijant iš vidutinės atitinkamo laikotarpio grynujų aktyvų vertės.

**Kai daugiau kaip 10 proc. grynujų aktyvų investuota į kitus kolektyvinio investavimo subjektus, apskaičiuojamas sąlyginis BIK ir (arba) tikėtinas sąlyginis BIK, atitinkantis tokią investicijų dalį.

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

6. Mokėjimai tarpininkams

Per ataskaitinį laikotarpį (2013 m. sausio 1 d. iki 2013 m. birželio 30 d.) Valdymo įmonė savo lėšomis sumokėjo 107 536 litus depozitoriumo mokesčio ir 1 388 litus už tarpininkavimo paslaugas vertybinių popierių sandoriuose AB DNB banko Investicinės bankininkystės departamento Kapitalo rinkų skyriui.

Per praėjusį atitinkamą ataskaitinį laikotarpį (2012 m. sausio 1 d. iki 2012 m. birželio 30 d.) Valdymo įmonė savo lėšomis sumokėjo 88 212 litus depozitoriumo mokesčio ir 4 622 litus už tarpininkavimo paslaugas vertybinių popierių sandoriuose AB DNB banko Investicinės bankininkystės departamento Kapitalo rinkų skyriui.

7. Gautos ir išmokėtos lėšos

		2013 m. I pusmetis	2012 m. I pusmetis
Bendra gautų lėšų suma		17 025 300	15 369 073
Periodinės įmokos į pensijų fondą	iš Valstybinio socialinio draudimo fondo	8 217 371	5 511 963
	paties dalyvio įmokėtos lėšos (pildoma tik papildomo savanoriško pensijų kaupimo pensijų fondo atveju)	-	-
	darbdavių ir kitų trečiųjų asmenų įmokėtos lėšos (pildoma tik papildomo savanoriško pensijų kaupimo pensijų fondo atveju)	-	-
Valstybinio socialinio draudimo fondo sumokėti delpinigia		-	-
Iš garantijų rezervo sumokėtos lėšos		-	-
Iš kitų pensijų fondų pervestos lėšos	iš tos pačios pensijų kaupimo bendrovės	280 411	279 499
	iš kitos pensijų kaupimo bendrovės	8 527 518	9 577 612
Kitos gautos lėšos (nurodyti šaltinį ir gautų lėšų sumą), iš viso		-	-

		2013 m. I pusmetis	2012 m. I pusmetis
Bendra išmokėtų lėšų suma		3 421 138	1 909 434
Pensijų išmokos	vienkartinės išmokos dalyviams	245 593	126 835
	periodinės išmokos dalyviams	-	-
	išmokos anuiteto įsigijimui	39 799	-
Į kitus pensijų fondus pervestos lėšos	valdomos tos pačios pensijų kaupimo bendrovės	470 167	333 379
	valdomos kitos pensijų kaupimo bendrovės	2 500 705	1 330 266
Išstojusiems dalyviams išmokėtos lėšos		-	-
Paveldėtojams išmokėtos lėšos		164 874	118 953
Kitais pagrindais išmokėtos lėšos (nurodyti šaltinį ir išmokėtų lėšų sumą), iš viso		-	-

VII. INFORMACIJA APIE PENSIJŲ FONDO DALYVIUS

-

VIII. IŠORINIAI PINIGŲ SRAUTAI

28. Per ataskaitinį laikotarpį faktiškai gautos lėšos
7 pastaba

29. Išmokėtos lėšos
7 pastaba

IX. INFORMACIJA APIE GARANTIJŲ REZERVĄ

30. Jei pensijų fondo taisyklėse yra įsipareigojimas garantuoti tam tikrą pajamingumą, nurodomas garantuojamo pajamingumo dydis ir kita svarbi informacija

-

X. INFORMACIJA APIE PENSIJŲ FONDO REIKMĖMS PASISKOLINTAS LĖŠAS

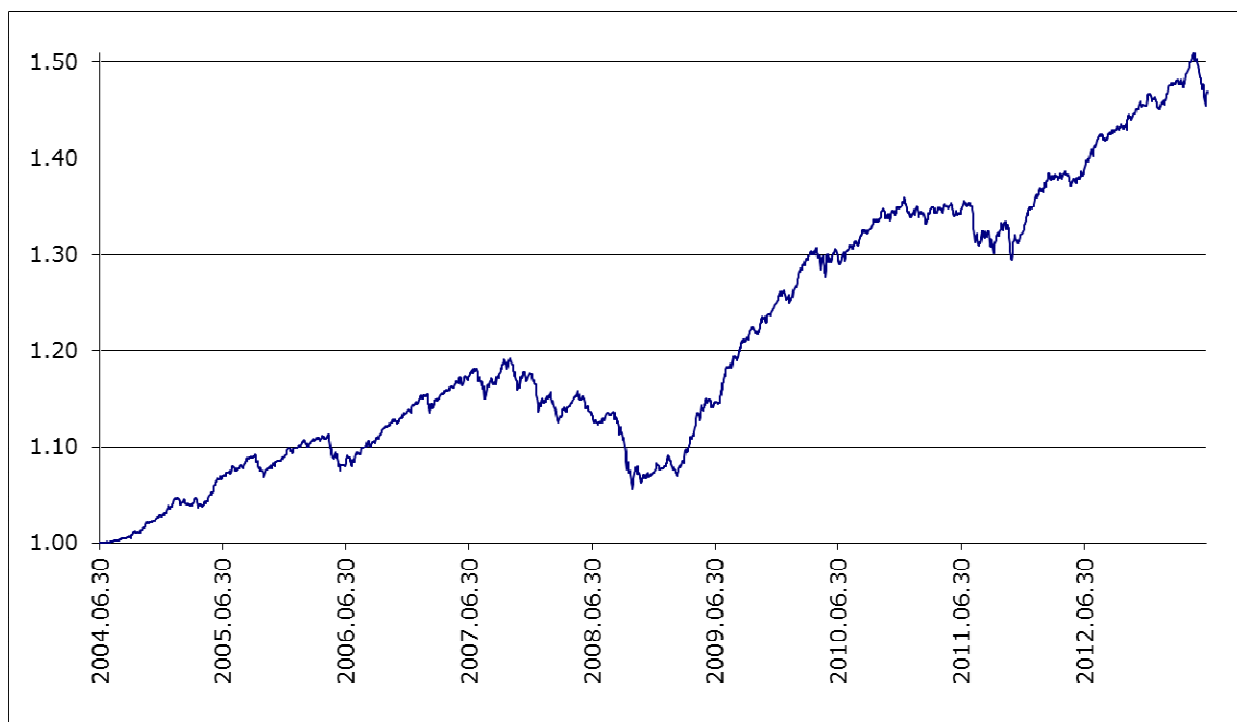
31. Pensijų fondo reikmėms pasiskolintos lėšos ataskaitinio laikotarpio pabaigoje
Pensijų fondo reikmėms nebuvo skolintasi.

XI. KITA INFORMACIJA

32. Paaiškinimai, komentarai, iliustruojamoji grafinė medžiaga ir kita svarbi informacija apie pensijų fondo veiklą, kad būtų galima tinkamai įvertinti fondo veiklos pokyčius ir rezultatus

Pateikiame pensijų fondo apskaitos vieneto vertės kitimą nuo fondo įsteigimo iki 2013 m. birželio 30 d.

Pensijų fondo apskaitos vieneto vertės kitimas 2004 06 15 - 2013 06 30



XII. ATSAKINGI ASMENYS

33. Konsultantų, kurių paslaugomis buvo naudotasi rengiant ataskaitą
Rengiant šią ataskaitą konsultantų paslaugomis nebuvo naudojamosi.

34. Ataskaitą parengusių asmenų vardai, pavardės, pareigos, darbovietė (jeigu ataskaitą rengę asmenys nėra bendrovės darbuotojai)

35. Valdymo įmonės administracijos vadovo, vyriausiojo finansininko, ataskaitą rengusių asmenų ir konsultantų patvirtinimas, kad joje pateikta informacija teisinga ir nėra nutylėtų faktų, galinčių daryti esminę įtaką pensijų fondo veiklos rezultatų vertinimui.

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

36. Asmenys, atsakingi už ataskaitoje pateiktą informaciją

36.1. už ataskaitą atsakingi įmonės valdymo organų nariai, darbuotojai ir administracijos vadovas (nurodyti vardus, pavardes, telefonų ir faksų numerius, el. pašto adresus)

Generalinis direktorius

Šarūnas Ruzgys

Tel: (8-5) 2393 444
Faks.: (8-5) 2393 473
Sarunas.Ruzgys@dnb.lt
Tel: (8-5) 2393 444
Faks.: (8-5) 2393 473
Dalia.Vaituleviciene@dnb.lt

Vyriausioji finansininkė

Dalia Vaitulevičienė

36.2. jeigu ataskaitą rengia konsultantai arba ji rengiama padedant konsultantams, nurodyti konsultantų vardus, pavardes, telefonų ir faksų numerius, el. pašto adresus