

DnB NORD

INVESTICIJŲ VALDYMAS

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

2010 METŲ II KETVIRČIO ATASKAITA

Vilnius, 2010 m.

TURINYS

I. BENDROSIOS NUOSTATOS	4
1. Pagrindiniai duomenys apie pensijų fondą.....	4
2. Ataskaitinis laikotarpis, už kurį parengta metų ataskaita.....	4
3. Duomenys apie valdymo įmonę	4
4. Duomenys apie depozitoriumą.....	4
II. GRYNŲJŲ AKTYVŲ, APSKAITOS VIENETŲ SKAIČIUS IR VERTĖS POKYČIAI.....	4
5. Grynųjų aktyvų, apskaitos vienetų skaičius ir vertės pokyčiai	4
6. Konvertuotų apskaitos vienetų skaičius bei bendros konvertavimo sumos	4
III. ATSKAITYMAI IŠ PENSIJŲ TURTO	5
7. Atskaitymai iš pensijų turto	5
8. Mokesčiai tarpininkams	5
9. Informacija apie egzistuojančius susitarimus dėl mokesčių pasidalinimo bei paslėptuosius mokesčius	5
10. Mokesčių įtaka galutinei dalyviui tenkančiai investicijų gražai	5
IV. INFORMACIJA APIE PENSIJŲ FONDO INVESTICIJŲ PORTFELĮ	6
11. Ataskaitinio laikotarpio pabaigos investicijų portfelio sudėtis	6
12. Investicijų pasiskirstymas.....	12
13. 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).....	12
14. 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.	13
15. Bendra įsipareigojimų, kylančių iš sandorių su išvestinėmis investicinėmis priemonėmis, vertė ataskaitinio laikotarpio pabaigoje (atskirai nurodyti sumas pagal skirtingas įsigytų išvestinių investicinių priemonių kategorijas).	13
16. Pateikti analizę, kaip turimas investicijų portfelis atitinka (neatitinka) pensijų fondo investavimo strategiją (investicijų kryptis, investicijų specializaciją, geografinę zoną ir pan.).....	13
17. Nurodyti veiksniai, kurie turėjo didžiausią įtaką per ataskaitinį laikotarpį investicijų portfelio struktūros ir jo vertės pokyčiams.	13
V. INFORMACIJA APIE PENSIJŲ FONDO INVESTICIJŲ PORTFELĮ	13
VI. PENSIJŲ FONDO INVESTICIJŲ GRAŽA IR RIZIKOS RODIKLIAI.....	13
VII. PENSIJŲ FONDO FINANSINĖ BŪKLĖ.....	13

23. Pensijų fondo finansinės ataskaitos parengtos vadovaujantis LR įstatymų ir teisės aktų reikalavimais.....	13
VII.INFORMACIJA APIE PENSIJŲ FONDO DALYVIUS	24
24. Bendri duomenys apie pensijų fondo dalyvius.....	24
25. Per ataskaitinį laikotarpį prisijungusių dalyvių skaičius.....	24
26. Per ataskaitinį laikotarpį pasitraukusių dalyvių skaičius.....	24
27. Pensijų fondo dalyvių struktūra pagal amžių ir lytį ataskaitinio laikotarpio pabaigoje	25
VIII. IŠORINIAI PINIGŲ SRAUTAI	25
28. Per ataskaitinį laikotarpį faktiškai gautos lėšos.....	25
29. Per ataskaitinį laikotarpį išmokėtos lėšos.....	25
IX. INFORMACIJA APIE GARANTIJŲ REZERVĄ	25
30. 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
31. Pensijų fondo reikmėms pasiskolintos lėšos.....	25
XI. KITI REIKALAVIMAI.....	26
32. Paaiškinimai ir komentarai apie pensijų fondo veiklą	26
33. Informacija apie konsultantus	26
34. Informacija apie ataskaitą parengusius asmenis (jei jie nėra bendrovės darbuotojai).....	26
35. 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
36. Asmenys, atsakingi už ataskaitoje pateiktą informaciją	27

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. Ataskaitinis laikotarpis, už kurį parengta metų ataskaita

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

3. 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 444
Faks:	(8-5) 2393 473.
Elektroninio pašto adresas:	investicija@dnbnord.lt
Leidimo verstis valdymo įmonės veikla numeris:	VĮK –003
Pensijų fondo valdytojas:	Naglis Paičius

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) 2393 444
Faks.:	(8-5) 239 37 83

II. GRYNŲJŲ AKTYVŲ, APSKAITOS VIENETŲ SKAIČIUS IR VERTĖS POKYČIAI

5. Grynujų aktyvų, apskaitos vienetų skaičius ir vertės pokyčiai

	Ataskaitinio laikotarpio pradžioje (2009 12 31)	Ataskaitinio laikotarpio pabaigoje (2010 06 30)	Prieš metus (2009 06 30)	Prieš dvejus metus (2008 06 30)
GAV	16 204 103	16 209 227	13 927 166	17 794 431
APSKAITOS VIENETO VERTĖ (LT)	1,1419	1,1882	1,0006	1,1123
APSKAITOS VIENETŲ SKAIČIUS	14 189 894	13 641 731	13 918 598	15 997 256

6. Konvertuotų apskaitos vienetų skaičius bei bendros konvertavimo sumos

	Apskaitos vienetų skaičius	Vertė (Lt)
Vienetų skaičius (konvertuojant pinigines lėšas į apskaitos vienetų)	479 186	568 583
Vienetų skaičius (konvertuojant vienetų į pinigines lėšas)	1 027 348	1 201 212

III. ATSKAITYMAI IŠ PENSIJŲ TURTO

7. 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 gryųjų aktyvų vertės
	maksimalus, nustatytas sudarymo dokumentuose	ataskaitiniu laikotarpiu taikytas			
Valdymo mokestis:	1,50%	1,50%	118 293	118 033	0.73%
<i>nekintamas mokestis</i>	<i>1,50%</i>	<i>1,50%</i>	<i>118 293</i>	<i>118 033</i>	<i>0.73%</i>
<i>sėkmės mokestis</i>	-	-	-	-	-
Depozitoriumo mokestis	0.25%	0.15%	11 909	11 882	0.07%
Sandorių sudarymo išlaidos	****	****	130	130	0.00%
Audito išlaidos	***	***	2 611	2 550	0.02%
Kitos veiklos išlaidos (Išlaidos už bankines paslaugas)	***	***	3	3	0.00%
Išlaidų, įskaičiuojamų į BIK, suma			-		
BIK % nuo GAV *			-		
Visų išlaidų suma			132 946	132 598	0.82%
PAR (praėjusio analogiško ataskaitinio laikotarpio PAR)**			-		

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

**Portfolio 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 gryųjų 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.

8. Mokesčiai tarpininkams

Per ataskaitinį laikotarpį sumokėta AB bankas DnB NORD Lietuva Investicinės bankininkystės departamento Kapitalo rinkų skyriui 130 Lt už tarpininkavimo paslaugas vertybinių popierių sandoriuose.

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

-

10. Mokesčių įtaka galutinei dalyviui tenkančiai investicijų grąžai

-

IV. Informacija apie pensijų fondo investicijų portfelį

11. 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	Balsų dalis emitente, %	Išpirkimo / konvertavimo data / terminas	Dalis GA, %
1	2	3	4	5	6	7	8	12	13	14	15	16	17	18	19
1 Nuosavybės vertybiniai popieriai															
1.1 Nuosavybės vertybiniai popieriai, įtraukti į Oficialųjį ar jį atitinkantį prekybos sąrašą															
-	AB TEO LT	LT	LT0000123911	LTL	37 479		37 479	90 364	76 457		www.market.lt.omxgroup.com				0.47
Iš viso:					37 479		37 479	90 364	76 457						0.47
1.2 Nuosavybės vertybiniai popieriai, įtraukti į Papildomąjį ar jį atitinkantį prekybos sąrašą															
-															
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	76 457						0.47
2 Ne nuosavybės vertybiniai popieriai															
1.4 Nuosavybės vertybiniai popieriai, kuriais prekiaujama reguliuojamose rinkose, kurios specializuojasi mažų ir vidutinių įmonių srityje															
-															
Iš viso:															
2.1 Ne nuosavybės vertybiniai popieriai, įtraukti į Oficialųjį ar jį atitinkantį prekybos sąrašą															
-															
Iš viso:															
2.2 Ne nuosavybės vertybiniai popieriai, įtraukti į Papildomąjį ar jį atitinkantį prekybos sąrašą															
-	Lietuvos Respublika	LT	LT0000611014	LTL	7 300		730 000	699 162	667 192	5.90				2016.02.10	4.12
-	Lietuvos Respublika	LT	LT1000600163	EUR	222		766 522	717 546	763 059	1.50				2010.10.20	4.71
-	AB DnB NORD bankas	LT	LT0000410094	LTL	4 500		450 000	415 260	448 582	1.22				2010.10.05	2.77
-	Lietuvos Respublika	LT	LT1000600213	EUR	1 265		436 779	409 254	424 690	2.80				2011.07.07	2.62
-	Lietuvos Respublika	LT	LT0000601957	LTL	4 000		400 000	388 973	395 501	2.10				2011.01.12	2.44
-	Lietuvos Respublika	LT	LT1000600239	EUR	1 042		359 782	345 016	354 195	2.45				2011.02.22	2.19
-	Lietuvos Respublika	LT	LT0000603227	LTL	7 200		720 000	801 359	802 331	4.65				2012.10.29	4.95
-	AB DnB NORD bankas	LT	LT0000402489	LTL	6 000		600 000	559 405	563 537	3.81				2012.03.05	3.48
Iš viso:					31 529		4 463 083	4 335 976	4 419 088						27.26
2.3 Ne nuosavybės vertybiniai popieriai, kuriais prekiaujama kitose reguliuojamose rinkose															

Pensijų fondas "DnB NORD papildoma pensija"

Ataskaita už 2010 m. II ketvirtį

-	FRANCE TELECOM	FR	XS0286704787	EUR	111		383 261	374 231	405 322	1.77				2012.02.21	2.50
-	Vodafone Group PLC	GB	XS0236598164	EUR	200		690 560	651 832	727 609	2.24				2012.11.29	4.49
-	RWE FINANCE BV	NL	XS0147030554	EUR	50		172 640	184 559	196 877	1.75				2012.10.26	1.21
-	TELEFONICA EM. 06/16	ES	XS0241946630	EUR	60		207 168	189 091	215 587	3.92				2016.02.02	1.33
-	GE CAPITAL EURO FUND	IE	XS0244082219	EUR	60		207 168	197 410	215 728	2.39				2013.02.14	1.33
-	EWE AG	DE	DE000A0DLU51	EUR	60		207 168	199 710	229 178	2.51				2014.10.14	1.41
-	Lietuvos Respublika	LT	XS0163880502	EUR	122		421 242	359 241	427 367	4.51				2013.03.05	2.64
-	DONG Energy A/S	DK	XS0253170335	EUR	90		310 752	304 723	319 383	1.87				2011.06.21	1.97
-	CARGILL INC	US	XS0252760607	EUR	27		93 226	85 768	99 428	2.21				2013.04.29	0.61
-	CEZ AS	CZ	XS0271020850	EUR	25		86 320	80 062	93 182	2.52				2013.10.17	0.57
-	Olandijos karalystė	NL	NL0006173015	EUR	50		172 640	170 530	178 810	0.77				2011.01.15	1.10
-	Lietuvos Respublika	LT	XS0327304001	EUR	43		148 470	134 727	147 678	5.25				2018.02.07	0.91
-	SOCIETE GENERALE	FR	XS0471703461	LVL	1		243 380	243 380	273 612	2.44				2010.12.07	1.69
-	Lenkijos Respublika	PL	XS0498285351	EUR	50		172 640	172 581	173 947	3.79				2017.03.29	1.07
	Iš viso:				949		3 516 634	3 347 845	3 703 708						22.85
2.4	Išleidžiami nauji ne nuosavybės vertybiniai popieriai														
-															
	Iš viso:														
	Iš viso Ne nuosavybės vertybiniai popieriai:				32 478		7 979 717	7 683 820	8 122 796						50.11
3	Kolektyvinio investavimo subjektai														
3.1	Kolektyvinio investavimo subjektų, atitinkančių Kolektyvinio investavimo subjektų 61 str. 1d. reikalavimus, vienetai (akcijos)														
-	BL-EQUITIES EUROPE	LU	LU0093570330	EUR	35	BANQUE DE LUXEMBOURG S. A.		291 637	394 618		www.bdl.lu	KIS 3			2.43
-	Nordea 1 North American Value Fund	LU	LU0076314649	USD	1 580	Nordea Investment Funds S. A.		314 008	112 759		www.nordea.lu	KIS 3			0.70

Pensiju fondas "DnB NORD papildoma pensija"

Ataskaita už 2010 m. II ketvirtį

-	Nordea 1 European Value Fund	LU	LU0064319337	EUR	2 300	Nordea Investment Funds S. A.		463 633	254 603		www.nordea.lu	KIS 3			1.57
-	iShares FTSEurofirst 80	IE	IE0004855221	EUR	5 790	Barclays Global Investors LTD		197 248	161 933		www.londonstockexchange.com	KIS 3			1.00
-	Pioneer Funds - European Small Companies	LU	LU0133552405	EUR	9 100	Pioneer Asset Management S.A.		279 086	246 022		www.pioneerinvestments.com	KIS 3			1.52
-	Pictet Funds Lux - Emerging Markets Index	LU	LU0188499254	USD	450	Pictet Gestion (Luxembourg) S.A.		194 694	270 259		www.pictetfunds.com	KIS 3			1.67
-	Nordea Nordic Equity fund	LU	LU0064675639	EUR	1 056	Nordea Investment Funds S. A.		271 755	163 494		www.nordea.lu	KIS 3			1.01
-	ING(L) Invest - European Telecom Fund	LU	LU0119206919	EUR	498	ING (L) Invest		311 842	260 314		www.ing.lu	KIS 3			1.61
-	Nordea 1 Danish Equity Fund	LU	LU0081951880	DKK	65	Nordea Investment Funds S. A.		6 094	5 797		www.nordea.lu	KIS 3			0.04
-	Evli Greater Russia B	FI	FI0008807565	EUR	314	Evli Greater Russia Managment LTD		253 781	213 478		www.evli.com	KIS 3			1.32
-	Morgan ST US Equity Growth Stanley Fund	LU	LU0073232471	USD	7 883	Morgan Standley Investment Management		691 069	667 129		www.Morganstanley.com	KIS 3			4.12
-	Fidelity Germany Fund	LU	LU0048580004	EUR	1 299	Fidelity International Ltd/Bermuda		125 154	106 081		www.fidelity-international.com	KIS 3			0.65
-	JPMorgan F-Emerg Euro EQ-A\$ Fund	LU	LU0074838565	USD	450	JPMorgan Asset Managment Europe SAR		62 681	62 300		www.Morganstanley.com	KIS 3			0.38
-	HSBC GIF Asia ex Japan Equity AD	LU	LU0043850808	USD	1 648	HSBC Investments Hong Kong Ltd/Hong		134 379	196 153		www.hsbc.com	KIS 3			1.21
-	Franklin Templeton Eastern Europe Fund	LU	LU0078277505	EUR	548	Franklin Templeton Investment Funds		58 698	50 234		www.templeton.lu	KIS 3			0.31

Pensiju fondas "DnB NORD papildoma pensija"

Ataskaita už 2010 m. II ketvirtį

-	Vanguard US 500 STK	IE	IE0002639668	USD	5 117	Vanguard Group Inc		142 117	150 554		www.globalvanguard.com	KIS 3			0.93
-	DWS Invest BRIC PLUS-FC	LU	LU0210302369	EUR	166	DWS Invest SA		164 764	127 062		www.dws-investments.com	KIS 3			0.78
-	Vanguard INV EURZ STK IDX	IE	IE0008248803	EUR	585	Vanguard Group Inc		296 647	207 881		www.globalvanguard.com	KIS 3			1.28
-	HENDERSON HORIZ-PAN EU SC-A2	LU	LU0046217351	EUR	2 274	Henderson Global Investor Ltd/Unite		188 186	144 793		www.henderson.com	KIS 3			0.89
-	Vanguard INV GLOB STK IDX	IE	IE00B03HCZ61	EUR	6 950	Vanguard Group Inc		286 642	232 399		www.globalvanguard.com	KIS 3			1.43
-	Pictet Funds Lux-Pasific (Ex Japan) Index	LU	LU0148538712	USD	183	Pictet Gestion (Luxembourg) S.A.		110 011	125 118		www.pictetfunds.com	KIS 3			0.77
-	ING (L) Invest Computer Technologies	LU	LU0119200128	USD	34	ING (L) Invest		61 026	55 095		www.ing.lu	KIS 3			0.34
-	Franklin Templeton Latin America Fund	LU	LU0128526570	USD	1 746	Franklin Templeton Investment Funds		274 646	379 431		www.templeton.lu	KIS 3			2.34
-	Fidelity Pacific Fund A	LU	LU0049112450	USD	6 083	Fidelity International Ltd/Bermuda		327 221	291 702		www.fidelity-international.com	KIS 3			1.80
-	Fidelity Fnds-Nordic Funds A	LU	LU0048588080	SEK	211	Fidelity International Ltd/Bermuda		51 651	41 671		www.fidelity-international.com	KIS 3			0.26
-	Fidelity Fnds-European AGGR Fund	LU	LU0083291335	EUR	2 810	Fidelity International Ltd/Bermuda		200 839	103 233		www.fidelity-international.com	KIS 3			0.64
-	Morgan ST Sicav EMG MK EQ-A	LU	LU0073229840	USD	2 290	Morgan Standley Investment Management		210 455	207 548		www.Morganstandley.com	KIS 3			1.28
-	Carlson Equity Asian Small Cap Fund	LU	LU0067059799	EUR	3 637	Carlson Fund Management Luxembourg		67 675	62 975		www.carlsonfund.de	KIS 3			0.39
-	JPM Emerging Markets Equity Fund	LU	LU0217576759	EUR	1 771	JP Morgan Asset Management		69 325	76 478		www.jpmorganfleming.com	KIS 3			0.47
-	Schroder ISF EURO Equity C ACC	LU	LU0106235459	EUR	4 810	Schroder ISF EURO Equity C ACC		494 289	328 363		www.schroders.com	KIS 3			2.03

Pensijų fondas "DnB NORD papildoma pensija"

Ataskaita už 2010 m. II ketvirtį

-	INVESCO ASEAN Equity Fund A	IE	IE0003702317	USD	603	INVESCO Asset Management Ireland		174 888	139 302		www.de.invesco.com	KIS 3			0.86
-	Morgan Stanl. Europe, Middle East & Nor. Africa	LU	LU0118140002	EUR	298	Morgan Standley Investment Management		82 380	56 429		www.Morganstanley.com	KIS 3			0.35
-	JPM MIDDLE EAST EQUITY A (DIST) - USD FUND	LU	LU0083573666	USD	5 611	JP Morgan Asset Management		514 899	331 606		www.Morganstanley.com	KIS 3			2.05
-	Fidelity Global Health Care Fund	LU	LU0114720955	EUR	3 128	Fidelity International Ltd/Bermuda		131 206	174 078		www.fidelity-international.com	KIS 3			1.07
-	DnB NORD pinigų rinkos fondas	LT	LTIF00000187	LTL	190	UAB DnB NORD investicijų valdymas		95 988	236 768		www.dnbnord.lt	KIS 1			1.46
-	FORTIS L FUND EQUITY HIGH DIVIDEND USA C FUND	LU	LU0377083059	USD	260	Fortis Investment Management Lux		41 064	45 779		www.fortisinvestments.com	KIS 3			0.28
-	FORTIS L FUND EQUITY ENERGY WORLD C FUND	LU	LU0080608945	EUR	92	Fortis Investment Management Lux		140 889	157 499		www.fortisinvestments.com	KIS 3			0.97
-	Parvest-Agriculture Classic Cap. Eur	LU	LU0363509208	EUR	582	BNP Paribas Asset Management Luxembourg		167 052	150 795		www.bnpparibas-am.com	KIS 3			0.93
-	Schroder ISF Emerg Asia A EUR Acc Fund	LU	LU0248172537	EUR	2 875	Schroder Investment Management S.A.		103 052	168 079		www.schroders.lu	KIS 3			1.04
-	HSBC GIF-GL EMERG MKT EQY-PD	LU	LU0449516144	USD	13 271	HSBC Investment Funds (Lux)			378 728		www.assetmanagement.hsbc.com	KIS 3			2.34
	Iš viso:				98 594			8 052 671	7 538 540						46.51
3.2	Kitų kolektyvinio investavimo subjektų vienetai														
-	Lithuania SME Fund	LT	Lithuania SME Fund	EUR	425	Baltcap Management		1 467	1 467		www.baltcap.com	KIS3			0.01

Pensijų fondas "DnB NORD papildoma pensija"

Ataskaita už 2010 m. II ketvirtį

	Iš viso:				425				1 467	1 467				0.01
	Iš viso Kolektyvinio investavimo subjektai:				99 019				8 054 139	7 540 008				46.51
4	Pinigų rinkos priemonės													
4.1	Pinigų rinkos priemonės, kuriomis prekiaujama reguliuojamose rinkose													
-														
	Iš viso:													
4.2	Kitos pinigų rinkos priemonės													
-														
	Iš viso:													
	Iš viso Pinigų rinkos priemonės:													
5	Indėliai kredito įstaigose													
-														
-														
	Iš viso:													
	Iš viso Indėliai kredito įstaigose:													
6	Išvestinės investicinės priemonės													
6.1	Išvestinės investicinės priemonės, kuriomis prekiaujama reguliuojamose rinkose													
-														
	Iš viso:													
6.2	Kitos išvestinės investicinės priemonės													
-														
	Iš viso:													
	Iš viso Išvestinės investicinės priemonės:													
7	Pinigai													
-	AB DnB NORD bankas	LT		USD					20 775	0.16				0.13
-	AB DnB NORD bankas	LT		LTL					86 207	0.31				0.53
-	AB DnB NORD bankas	LT		LTL					4 086	0.31				0.03
-	AB DnB NORD bankas	LT		EUR					383 620	0.31				2.37
	Iš viso:								494 688					3.05
	Iš viso Pinigai:								494 688					3.05
8	Kitos priemonės, nenumatytos Kolektyvinio investavimo subjektų įstatymo 57 str. 1 d.													
-														
-														
	Iš viso:													
	Iš viso Kitos priemonės, nenumatytos Kolektyvinio investavimo subjektų įstatymo 57 str. 1 d.:													
9	IŠ VISO:								16 233 949					100

12. Investicijų pasiskirstymas
12.1. pagal valiutas ir geografinę zoną

Investicijų pasiskirstymas	Rinkos vertė	Dalis aktyvuose (%)	Rinkos vertė ataskaitinio laikotarpio pradžioje	Dalis aktyvuose ataskaitinio laikotarpio pradžioje (%)
Pagal valiutas:				
DKK	5 797	0.04	5 271	0.03
EUR	9 197 967	56.75	9 259 407	57.14
LTL	3 280 663	20.24	3 600 802	22.22
LVL	273 612	1.69	249 993	1.54
USD	3 434 239	21.19	3 076 213	18.98
SEK	41 671	0.26	37 487	0.23
Iš viso:	16 233 949	100	16 229 173	100
Pagal geografinę zoną:				
Europos ekonominės erdvės valstybės (Islandija, Norvegija, Lichtenšteinas)	-	-	-	-
Kitos Europos Sąjungos valstybės	10 331 007	63.74	10 132 269	62.53
Japonija				
Lietuva	5 803 514	35.80	5 824 451	35.94
Kitos šalys	-	-	-	-
Jungtinės Amerikos Valstijos ir Kanada	99 428	0.61	272 453	1.68
Iš viso:	16 233 949	100	16 229 173	100
Pagal investavimo objektus:				
Akcijos	76 457	0.47	68 587	0.42
Akcijų kolektyvinio investavimo subjektai (akcijų fondai)	7 540 008	46.52	7 244 803	44.71
Vyriausybės VP	4 334 770	26.74	2 904 767	17.93
Kitos obligacijos	3 788 025	23.37	5 046 970	31.15
Pinigai ir pinigų ekvivalentai	494 688	3.05	964 047	5.95
Iš viso:	16 233 949	100	16 229 173	100

12.2. 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.)

13. 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)

14. 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.

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

16. Pateikti analizę, kaip turimas investicijų portfelis atitinka (neatitinka) pensijų fondo investavimo strategiją (investicijų kryptis, investicijų specializaciją, 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 26.74 proc. visų pensijų fondo grynujų aktyvų vertės, kiti skolos vertybiniai popieriai – 23.37 proc., investicijos į kolektyvinio investavimo subjektų vienetus sudarė 46.52 proc., nuosavybės vertybiniai popieriai – 0.47 proc., pinigai ir pinigų ekvivalentai – 3.05 proc. visų pensijų fondo grynujų aktyvų vertės.

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

2010 m. II ketvirtį rinkose pasireiškė nerimas dėl valstybių viešųjų finansų stabilumo. Ypač skaudžiai atsiliepė euro zonos valstybėms, kurių skolos lygis ir biudžeto deficitas viršijo leistinus Maastrichto kriterijus (atitinkamai 60 proc. ir 3 proc.). Todėl vėl susimąstyta dėl galimo dvigubos V raidės ekonomikos atsigavimo. Investicijos iš rizikingesnių obligacijų plūdo į saugiomis laikomis obligacijas, pavyzdžiui, Vokietijos vyriausybės.

Dėl viešųjų finansų nestabilumo, ne tokio greito pasaulio ūkio atsigavimo, galimo Kinijos perkaitimo akcijų biržos fiksavo kritimus. 2010 m. II ketvirtį pasaulio MSCI World indeksas krito -13,26 proc., JAV S&P 500 krito -11.86 proc., besivystančių valstybių MSCI EM -9,14 proc. Stipriai pasireiškus investuotojų nepasitikėjimui per daug užsiskolinusiomis valstybėmis, t.y. tiesiog neperkant tų šalių obligacijų arba reikalaujant didesnių palūkanų, buvo priimti daugelio valstybių taupymo planai, mažinant biudžeto deficitą ir ne taip smarkiai didinant šalies skolos lygį. Tai turėtų pristabdyti iki tol manytą spartų atsigavimą, tačiau įnešti šiek tiek daugiau stabilumo ir išvengti antrosios dvigubos V kritimo.

V. INFORMACIJA APIE PENSIJŲ FONDO INVESTICIJŲ PORTFELĮ

VI. PENSIJŲ FONDO INVESTICIJŲ GRAŽA IR RIZIKOS RODIKLIAI

VII. PENSIJŲ FONDO FINANSINĖ BŪKLĖ

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

23.1. 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 2010 M. birželio 30 d. DUOMENIS

_____ Nr. _____

(Data)

(Lt)

Eil. Nr.	TURTAS	Pastabų Nr.	Ataskaitinis laikotarpis	Praėjęs ataskaitinis laikotarpis
I.	PINIGAI IR PINIGŲ EKVIVALENTAI		494 688	964 047
II.	TERMINUOTI INDĖLIAI			-
III.	INVESTICIJOS	2	15 739 261	15 265 126
1	Skolos vertybiniai popieriai		8 122 796	7 951 737
1.1.	Vyriausybių ir centrinių bankų arba jų garantuoti skolos vertybiniai popieriai		4 334 770	2 904 767
1.2.	Kiti skolos vertybiniai popieriai		3 788 025	5 046 970
2	Nuosavybės vertybiniai popieriai		76 457	68 586
3	Kolektyvinio investavimo subjektų investiciniai vienetai ir akcijos		7 540 008	7 244 803
4	Kitos investicijos			-
IV.	GAUTINOS SUMOS			-
1.	Investicijų pardavimo sandorių gautinos sumos			-
2.	Kitos gautinos sumos			-
	TURTO IŠ VISO:	1	16 233 949	16 229 173

Eil. Nr.	ĮSIPAREIGOJIMAI IR GRYNIEJI AKTYVAI	Pastabų Nr.	Ataskaitinis laikotarpis	Praėjęs ataskaitinis laikotarpis
V.	ĮSIPAREIGOJIMAI		24 722	25 070
1.	Investicijų pirkimo įsipareigojimai			-
2.	Mokėtinos sumos kaupimo bendrovei ir depozitoriumui		22 173	22 459
3.	Kitos mokėtinos sumos ir įsipareigojimai		2 550	2 611
VI.	GRYNIEJI AKTYVAI (I+II+III+IV-V)		16 209 227	16 204 103
	ĮSIPAREIGOJIMŲ IR GRYNŲJŲ AKTYVŲ IŠ VISO:		16 233 949	16 229 173

23.2. 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 2010 M. birželio 30 d. DUOMENIS

Nr. ____

(Data)

(Lt)

Eil. Nr.	Straipsniai	Ataskaitinis laikotarpis	Praėjęs atitinkamas ataskaitinis laikotarpis (2009 06 30)
I.	GRYNIJAI AKTYVAI ATASKAITINIO LAIKOTARPIO PRADŽIOJE	16 204 103	13 581 271
II.	PADIDĖJIMAS, IŠ VISO:	1 657 441	1 849 357
1	Pensijų įmokos	568 345	389 322
2	Iš kitų pensijų fondų pervestos sumos	239	16 783
3	Kaupimo bendrovės garantinės įmokos		-
4	Palūkanos ir dividendai	234 385	271 823
5	Investicijų pardavimo pelnas	39 235	26 577
6	Investicijų vertės padidėjimo suma	304 514	1 131 036
7	Turto vertės padidėjimas dėl užsienio valiutų kursų pasikeitimo	509 621	12 931
8	Kitos pajamos	1 101	884
III.	SUMAŽĖJIMAS, IŠ VISO:	1 652 318	1 503 462
1	Pensijų išmokos	1 198 384	1 360 075
2	Į kitus pensijų fondus pervestos sumos	2 828	-
3	Investicijų pardavimo nuostoliai	8 065	1 303
4	Investicijų vertės sumažėjimo suma	310 424	24 625
5	Turto vertės sumažėjimas dėl užsienio valiutų kursų pasikeitimo	19	7 313
6	Valdymo sąnaudos	129 915	106 956
7	Kitos sąnaudos	2 683	3 191
IV.	GRYNIJAI AKTYVAI ATASKAITINIO LAIKOTARPIO PABAIGOJE	16 209 226	13 927 166

		Ataskaitinio laikotarpio pabaigoje	Prieš metus	Prieš dvejus metus
V.	APSKAITOS VIENETO VERTĖ	1,1882	1,0006	1,1123
VI.	APSKAITOS VIENETŲ SKAIČIUS	13 641 731	13 918 598	15 997 256

23.3. 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 444
	Faks:	(8-5) 2393 473.
	Elektroninio pašto adresas:	investicija@dnbnord.lt
	Pensijų fondo valdytojas:	Naglis Paičius
Depozitoriumas:	Depozitoriumo pavadinimas:	AB DnB NORD bankas
	Buveinės adresas:	J. Basanavičiaus g. 26, Vilnius, Lietuva
	Įmonės kodas:	112029270
	Tel.:	(8-5) 2393 444
	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) tvarkydama 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.

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

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 pelningumą svyravimą siekiama atsverti vidutiniškai stabilesnį pelningumą generuojančiomis investicijomis, kaip kad vyriausybių 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 turta 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 turta:

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 turta 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;

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 turta (investicija). Siekiant sumažinti rinkos likvidumo riziką investuojama tikta į tuos vertybinius popierius, kurie kotiruojami pripažintose pasaulio rinkose arba kurių kainą reguliariai skelbia visuotinės informavimo priemonės;

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)

6. sandorio šalies rizika – rizika patirti nuostolius dėl sandorio šalies nesugebėjimo įvykdyti savo finansinius įsipareigojimus, kurie buvo prisiimti 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 sukaupti Dalyvio pinigai pervedami 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 sąnaudų – atskaitymai kaupimo bendrovei ir depozitoriumui už turto valdymą, kitos su Fondo valdymu susijusios sąnaudų, 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 dienos 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 dienos 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 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.

Grynųjų aktyvų vertės (GAV) skaičiavimo metodika

Apskaitos vieneto vertė apskaičiuojama Fondo grynųjų 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.dnb nord.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 atkarpos 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 turtą įrašomi įsigijimo verte ir perkainojami kitą fondo darbo dieną pagal GAV skaičiavimo procedūras.

Apskaičiuojant grynųjų aktyvų vertę priemonės, kuriomis reguliuojamose rinkose neprekiuojama, pagal Lietuvos Respublikos vertybinių popierių komisijos patvirtintą grynųjų 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.

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.

Pobalansiniai įvykiai

Reikšmingų įvykių po balanso sudarymo datos nebuvo.

AIŠKINAMOJO RAŠTO PASTABOS

1. Turto struktūra ataskaitinio laikotarpio pabaigoje

(Litais)

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, investicijų lyginamoji dalis (%)
1	2	3	4	5	6	7	8
AB TEO LT	LT	LTL				76 457	0.47
Iš viso Nuosavybės vertybiniai popieriai:						76 457	0.47
Lietuvos Respublika	LT	LTL	730 000	5.90	2016.02.10	667 192	4.11
Lietuvos Respublika	LT	EUR	766 522	1.50	2010.10.20	763 059	4.70
AB DnB NORD bankas	LT	LTL	450 000	1.22	2010.10.05	448 582	2.76
Lietuvos Respublika	LT	EUR	436 779	2.80	2011.07.07	424 690	2.62
Lietuvos Respublika	LT	LTL	400 000	2.10	2011.01.12	395 501	2.44
Lietuvos Respublika	LT	EUR	359 782	2.45	2011.02.22	354 195	2.18
Lietuvos Respublika	LT	LTL	720 000	4.65	2012.10.29	802 331	4.94
AB DnB NORD bankas	LT	LTL	600 000	3.81	2012.03.05	563 537	3.47
FRANCE TELECOM	FR	EUR	383 261	1.77	2012.02.21	405 322	2.50
Vodafone Group PLC	GB	EUR	690 560	2.24	2012.11.29	727 609	4.48
RWE FINANCE BV	NL	EUR	172 640	1.75	2012.10.26	196 877	1.21
TELEFONICA EM. 06/16	ES	EUR	207 168	3.92	2016.02.02	215 587	1.33
GE CAPITAL EURO FUND	IE	EUR	207 168	2.39	2013.02.14	215 728	1.33
EWE AG	DE	EUR	207 168	2.51	2014.10.14	229 178	1.41
Lietuvos Respublika	LT	EUR	421 242	4.51	2013.03.05	427 367	2.63
DONG Energy A/S	DK	EUR	310 752	1.87	2011.06.21	319 383	1.97
CARGILL INC	US	EUR	93 226	2.21	2013.04.29	99 428	0.61
CEZ AS	CZ	EUR	86 320	2.52	2013.10.17	93 182	0.57
Olandijos karalystė	NL	EUR	172 640	0.77	2011.01.15	178 810	1.10
Lietuvos Respublika	LT	EUR	148 470	5.25	2018.02.07	147 678	0.91
SOCIETE GENERALE	FR	LVL	243 380	2.44	2010.12.07	273 612	1.69
Lenkijos Respublika	PL	EUR	172 640	3.79	2017.03.29	173 947	1.07
Iš viso Ne nuosavybės vertybiniai popieriai:						8 122 796	50.04
BL-EQUITIES EUROPE	LU	EUR				394 618	2.43
Nordea 1 North American Value Fund	LU	USD				112 759	0.69
Nordea 1 European Value Fund	LU	EUR				254 603	1.57
iShares FTSEurofirst 80	IE	EUR				161 933	1.00
Pioneer Funds - European Small Companies	LU	EUR				246 022	1.52
Pictet Funds Lux - Emerging Markets Index	LU	USD				270 259	1.66
Nordea Nordic Equity fund	LU	EUR				163 494	1.01
ING(L) Invest - European Telecom Fund	LU	EUR				260 314	1.60
Nordea 1 Danish Equity Fund	LU	DKK				5 797	0.04
Evli Greater Russia B	FI	EUR				213 478	1.32
Morgan ST US Equity Growth Stanley Fund	LU	USD				667 129	4.11
Fidelity Germany Fund	LU	EUR				106 081	0.65
JPMorgan F-Emerg Euro EQ-A\$ Fund	LU	USD				62 300	0.38
HSBC GIF Asia ex Japan Equity AD	LU	USD				196 153	1.21
Franklin Templeton Eastern Europe Fund	LU	EUR				50 234	0.31
Vanguard US 500 STK	IE	USD				150 554	0.93
DWS Invest BRIC PLUS-FC	LU	EUR				127 062	0.78
Vanguard INV EURZ STK IDX	IE	EUR				207 881	1.28

Pensijų fondas "DnB NORD papildoma pensija"
Ataskaita už 2010 m. II ketvirtį

HENDERSON HORIZ-PAN EU SC-A2	LU	EUR				144 793	0.89
Vanguard INV GLOB STK IDX	IE	EUR				232 399	1.43
Pictet Funds Lux-Pasific (Ex Japan) Index	LU	USD				125 118	0.77
ING (L) Invest Computer Technologies	LU	USD				55 095	0.34
Franklin Templeton Latin America Fund	LU	USD				379 431	2.34
Fidelity Pacific Fund A	LU	USD				291 702	1.80
Fidelity Fnds-Nordic Funds A	LU	SEK				41 671	0.26
Fidelity Fnds-European AGGR Fund	LU	EUR				103 233	0.64
Morgan ST Sicav EMG MK EQ-A	LU	USD				207 548	1.28
Carlson Equity Asian Small Cap Fund	LU	EUR				62 975	0.39
JPM Emerging Markets Equity Fund	LU	EUR				76 478	0.47
Schroder ISF EURO Equity C ACC	LU	EUR				328 363	2.02
INVESCO ASEAN Equity Fund A	IE	USD				139 302	0.86
Morgan Stanl. Europe, Middle East & Nor. Africa	LU	EUR				56 429	0.35
JPM MIDDLE EAST EQUITY A (DIST) - USD FUND	LU	USD				331 606	2.04
Fidelity Global Health Care Fund	LU	EUR				174 078	1.07
DnB NORD pinigų rinkos fondas	LT	LTL				236 768	1.46
FORTIS L FUND EQUITY HIGH DIVIDEND USA C FUND	LU	USD				45 779	0.28
FORTIS L FUND EQUITY ENERGY WORLD C FUND	LU	EUR				157 499	0.97
Parvest-Agriculture Classic Cap. Eur	LU	EUR				150 795	0.93
Schroder ISF Emerg Asia A EUR Acc Fund	LU	EUR				168 079	1.04
HSBC GIF-GL EMERG MKT EQY-PD	LU	USD				378 728	2.33
Lithuania SME Fund	LT	EUR				1 467	0.01
Iš viso Kolektyvinio investavimo subjektai:						7 540 008	46.45
AB DnB NORD bankas	LT	USD		0.16		20 775	0.13
AB DnB NORD bankas	LT	LTL		0.31		86 207	0.53
AB DnB NORD bankas	LT	LTL		0.31		4 086	0.03
AB DnB NORD bankas	LT	EUR		0.31		383 620	2.36
Iš viso Pinigai:						494 688	3.05
IŠ VISO:						16 233 949	100

2. Investicijų vertės pokytis

(Litais)

Balanso straipsniai \ Pokytis	Praėjusio ataskaitinio laikotarpio pabaigoje	Įsigyta	Parduota (išpirkta)	Vertės padidėjimas	Vertės sumažėjimas	Ataskaitinio laikotarpio pabaigoje
Skolos vertybiniai popieriai	7 951 737	2 920 508	3 067 881	354 980	36 548	8 122 796
<i>Vyriausybės ir centrinių bankų arba jų garantuoti skolos vertybiniai popieriai</i>	<i>2 904 767</i>	<i>2 361 102</i>	<i>1 093 025</i>	<i>178 820</i>	<i>16 894</i>	<i>4 334 770</i>
<i>Kiti skolos vertybiniai popieriai</i>	<i>5 046 970</i>	<i>559 405</i>	<i>1 974 856</i>	<i>176 160</i>	<i>19 653</i>	<i>3 788 026</i>
Nuosavybės vertybiniai popieriai	68 587	-	-	7 871	-	76 457
Kolektyvinio investavimo subjektų investiciniai vienetai ir akcijos	7 244 803	1 467	125 300	700 997	281 960	7 540 008
Kitos investicijos	-	-	-	-	-	-
Iš viso	15 265 126	2 921 975	3 193 181	1 063 848	318 508	15 739 261

VII. INFORMACIJA APIE PENSIJŲ FONDO DALYVIUS

24. Bendri duomenys apie pensijų fondo dalyvius

Dalyvių skaičius ataskaitinio laikotarpio pradžioje		6 596
Dalyvių skaičius ataskaitinio laikotarpio pabaigoje	dalyviai, pasinaudoję teise nukelti pensijų išmokos mokėjimą	-
	dalyviai, gaunantys periodines pensijų išmokas	-
	kiti dalyviai	6 850
	Iš viso	6 850
Dalyvių skaičiaus pokytis		254

25. Per ataskaitinį laikotarpį prisijungusių dalyvių skaičius

Bendras prisijungusių dalyvių skaičius		426
Dalyviai, pensijų kaupimo sutartis sudarę pirmą kartą		425
Iš kitų pensijų fondų atėję dalyviai	Iš tos pačios pensijų kaupimo bendrovės	1
	Iš kitos pensijų kaupimo bendrovės	-

26. Per ataskaitinį laikotarpį pasitraukusių dalyvių skaičius

Bendras pasitraukusių dalyvių skaičius		172
Į kitus pensijų fondus išėjusių dalyvių skaičius	valdomus tos pačios pensijų kaupimo bendrovės	-
	valdomus kitos pensijų kaupimo bendrovės	1
Baigusią dalyvavimą dalyvių skaičius	išstojusių (pildoma tik papildomo savanoriško pensijų kaupimo pensijų fondo atveju)	118
	sulaukusių nustatyto pensijos amžiaus ir pasinaudojusių teise į pensijų išmoką (vienkartinę išmoką, anuitetą ir jų derinį)	44
	dalyvių, pasinaudojusių Pensijų kaupimo įstatymo suteikta galimybe vienašališkai nutraukti pirmą kartą sudarytą sutartį	-
	mirusių dalyvių	9

27. Pensijų fondo dalyvių struktūra 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	805	2 953	2 256	836	6 850
	vyrų	470	1 612	874	369	3 325
	moterys	335	1 341	1 382	467	3 525
Dalyvių dalis, %	iš viso	11.75%	43.11%	32.93%	12.20%	100.00%
	vyrų	6.86%	23.53%	12.76%	5.39%	48.54%
	moterys	4.89%	19.58%	20.18%	6.82%	51.46%

VIII. IŠORINIAI PINIGŲ SRAUTAI

28. Per ataskaitinį laikotarpį faktiškai gautos lėšos

Bendra gautų lėšų suma		568 584
Periodinės įmokos į pensijų fondą	Iš Valstybinio socialinio draudimo fondo	-
	Paties dalyvio įmokėtos lėšos (pildoma tik papildomo savanoriško pensijų kaupimo pensijų fondo atveju)	568 345
	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	239
	Iš kitos pensijų kaupimo bendrovės	-
Kitos gautos lėšos (nurodyti šaltinį ir gautų lėšų sumą)		-

29. Per ataskaitinį laikotarpį išmokėtos lėšos

Bendra išmokėtų lėšų suma		1 201 212
Pensijų išmokos	Vienkartinės išmokos dalyviams	646 149
	Periodinės išmokos dalyviams	-
	Išmokos anuiteto įsigijimui	-
Į kitus pensijų fondus pervestos lėšos	Valdomus tos pačios pensijų kaupimo bendrovės	-
	Valdomus kitos pensijų kaupimo bendrovės	2 828
Išstojuosiemis dalyviams išmokėtos lėšos		497 310
Paveldėtojams išmokėtos lėšos		54 925
Kitais pagrindais išmokėtos lėšos		-

IX. INFORMACIJA APIE GARANTIJŲ REZERVĄ

30. 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.

-

X. INFORMACIJA APIE PENSIJŲ FONDO REIKMĖMS PASISKOLINTAS LĖŠAS

31. Pensijų fondo reikmėms pasiskolintos lėšos

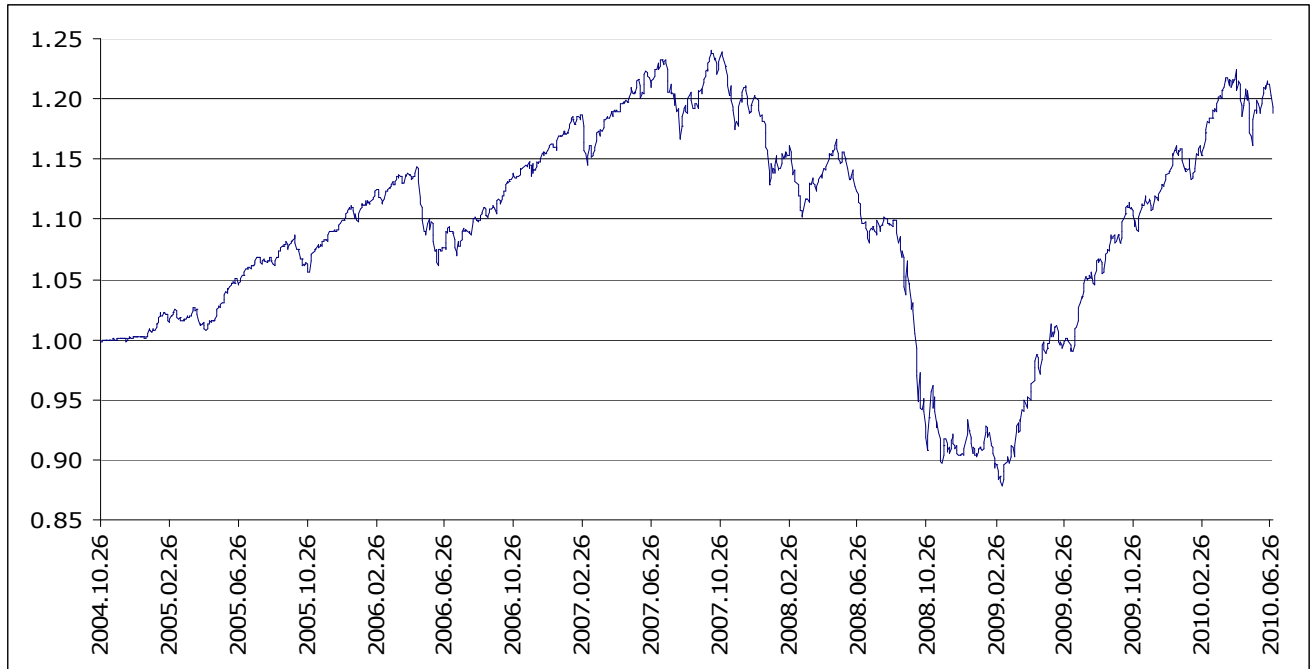
Pensijų fondo reikmėms nebuvo skolintasi.

XI. KITI REIKALAVIMAI

32. Paaškinimai ir komentarai apie pensijų fondo veiklą

Pateikiame pensijų fondo apskaitos vieneto vertės kitimą nuo įsteigimo iki 2010 06 30.

Pensijų fondo apskaitos vieneto vertės kitimas 2004 10 26 - 2010 06 30



33. Informacija apie konsultantus

Rengiant šią ataskaitą konsultantų paslaugomis nebuvo naudojamosi.

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

-

35. 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

36. Asmenys, atsakingi už ataskaitoje pateiktą informaciją

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

Generalinis direktorius	Šarūnas Ruzgys	Tel: (8-5) 2393 444 Faks.: (8-5) 2393 473 Sarunas.Ruzgys@dnbnord.lt
Vyriausioji finansininkė	Dalia Vaitulevičienė	Tel: (8-5) 2393 444 Faks.: (8-5) 2393 473 Dalia.Vaituleviciene@dnbnord.lt

36.2 Už ataskaitą atsakingi konsultantai

Rengiant šią ataskaitą konsultantų paslaugomis nebuvo naudojamosi.