

**VALSTYBINIO SOCIALINIO DRAUDIMO ĮMOKOS DALIES KAUPIMO PENSIJŲ FONDO  
„MP EXTREMO II“ 2009 METŲ ATASKAITA**

**I. BENDROJI INFORMACIJA**

1. Pensijų fondo pavadinimas **MP EXTREMO II**, visas pensijų fondo taisyklių, pagal kurias jis veikia, pavadinimas **VALSTYBINIO SOCIALINIO DRAUDIMO ĮMOKOS DALIES KAUPIMO PENSIJŲ FONDO „MP EXTREMO II“ taisyklės**, Komisijos pensijų fondo taisyklėms suteiktas numeris **PF-V03-P004-031(001)**.
2. Ataskaitinis laikotarpis, už kurį pateikta ataskaita: **2009.01.01.-2009.12.31**
3. Duomenys apie valdymo įmonę:
  - 3.1. pavadinimas **UAB „MP Pension Funds Baltic“**, įmonės kodas **300668928**;
  - 3.2. buveinė (adresas) Registracijos adresas **Rūdninkų g. 18 / Visų Šventųjų g. 2, Vilnius**, padalinio Kaune adresas **Savanorių pr. 349, Kaunas**;
  - 3.3. telefono **(8 37) 719302**, fakso numeriai **(8 37) 719562**, el. pašto adresas [info@mppf.lt](mailto:info@mppf.lt), interneto svetainės adresas [www.mppf.lt](http://www.mppf.lt), [www.mpensija.lt](http://www.mpensija.lt);
  - 3.4. veiklos licencijos numeris **VJP-004**;
  - 3.5. pensijų fondo valdytojo vardas, pavardė, pareigos: **Justas Krikščiūnas, fondų valdytojas**;
4. Depozitoriumo pavadinimas **AB bankas „Swedbank“**, kodas **112029651**, adresas **Savanorių pr. 19, Vilnius**, telefono numeris **(8 5) 2684228** ir fakso numeris **(8 5) 2684170**.

**II. GRYNŲJŲ AKTYVŲ, APSKAITOS VIENETŲ SKAIČIUS IR VERTĖ**

5. Nurodyti grynųjų aktyvų, apskaitos vienetų skaičių ir vertę:

	Ataskaitinio laikotarpio pradžioje (2009.01.01)	Ataskaitinio laikotarpio pabaigoje (2009.12.31)	Prieš metus (2008.12.31)	Prieš dvejus metus (2007.12.31)
Grynųjų aktyvų vertė, Lt	3056307.3470	21609369.0551	3056307.3470	73313.5174
Apskaitos vienetų vertė, Lt	1.0379	1.1497	1.0379	1.0048
Apskaitos vienetų skaičius	2944813.0581	18796363.1524	2944813.0581	72962.6610

6. Nurodyti per ataskaitinį laikotarpį konvertuotų apskaitos vienetų skaičių bei bendras konvertavimo sumas:

	Apskaitos vienetų skaičius	Vertė, Lt
Apskaitos vienetų skaičius (konvertuojant pinigines lėšas į apskaitos vienetus)	15920201.24	17320098.30
Apskaitos vienetų skaičius (konvertuojant vienetus į pinigines lėšas)	68651.15	74327.29

**III. ATSKAITYMAI IŠ PENSIJŲ TURTO**

7. Atskaitymai iš pensijų turto (pildoma fondo tipą atitinkanti lentelė):  
Atskaitymai iš valstybinio socialinio draudimo įmokos dalies kaupimo pensijų fondo pensijų turto (jei per ataskaitinį laikotarpį keitėsi atskaitymų dydis, atskirai pateikti sumas pagal kiekvieną dydį); jei yra skaičiuojamas sąlyginis tikėtinas bendrasis išlaidų koeficientas, pateikti papildomą informaciją, nurodytą taisyklių 42.6 punkte:

Atskaitymai	Taisyklėse nustatyti maksimalūs dydžiai	Faktiškai taikomi atskaitymų dydžiai	Per ataskaitinį laikotarpį priskaičiuota atskaitymų suma, Lt	Per ataskaitinį laikotarpį sumokėtų atskaitymų suma, Lt
Nuo įmokų	3 %	2 %	45 873	45 873
Nuo turto vertės	1 %	0,99 %	97 552	87 962
Už keitimą:				
<i>fondo keitimas toje pačioje bendrovėje daugiau kaip kartą per metus</i>	0 %	0 %		
<i>pensijų kaupimo bendrovės keitimas kartą per metus</i>	0,2 %	0 %		
<i>pensijų kaupimo bendrovės keitimas daugiau kaip kartą per metus</i>	0,2 %	0 %		
Iš viso			143 425	133 835

BAR (Valstybinio socialinio draudimo įmokos dalies kaupimo pensijų fondo bendrasis atskaitymų rodiklis)	0.0144
Sąlyginis BIK ir (arba) tikėtinas sąlyginis BIK * (bendrasis išlaidų koeficientas)	
PAR (Pensijų fondo investicinių priemonių portfelio apyvartumo rodiklis)*	47% (-335%)

Atskaitymai iš papildomo savanoriško pensijų kaupimo fondo turto (jei per ataskaitinį laikotarpį keitėsi atskaitymų dydis, sumas pateikti atskirai pagal kiekvieną dydį):

Atskaitymai	Atskaitymų dydis		Per ataskaitinį laikotarpį priskaičiuotų atskaitymų suma (Lt)	Per ataskaitinį laikotarpį sumokėtų mokesčių suma (Lt)	% nuo ataskaitinio laikotarpio vidutinės grynyųjų aktyvų vertės
	maksimalus, nustatytas sudarymo dokumentuose	ataskaitiniu laikotarpiu taikytas			
Už valdymą :					
<i>nekintamas dydis</i>					
<i>sėkmės mokesčiai</i>					
<i>depozitoriumui</i>					
<i>Už sandorių sudarymą</i>					
<i>Už auditą</i>					
<i>Kitos veiklos išlaidos (nurodyti išlaidų rūšis)</i>					
Išlaidų įskaičiuojamų į BIK, suma*					
BIK % nuo GAV *					
Visų išlaidų suma					
PAR (praėjusio analogiško ataskaitinio laikotarpio PAR)*					

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

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

8. Mokėjimai tarpininkams (nurodyti konkrečius tarpininkus ir jiems sumokėtas sumas, suteiktas paslaugas). Pažymėti, kurie tarpininkai susiję su fondo valdymo įmone.

- **MP Investment Bank HF Baltic Branch – 0,- Lt (valdymo įmonės dengiamos išlaidos);**
- **AB bankas „Swedbank“ – 24 096,93 Lt (valdymo įmonės dengiamos išlaidos).**

**MP Investment Bank yra susijęs su valdymo įmone kaip akcininkas, AB bankas „Swedbank“ - depozitoriumas.**

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

**Nėra.**

10. Pateikti konkretų pavyzdį, iliustruojantį atskaitymų įtaką galutinei dalyviui tenkančiai investicijų grąžai (pateikti tik metų ataskaitoje). Pavyzdyje pateikti skaičiavimus, kiek būtų atskaityta (litas) nuo pensijų fondo dalyvio įmokų esant dabartiniam atskaitymų dydžiui ir kokią sumą jis atgautų po 1, 3, 5, 10 metų, jei būtų investuota 10 000 Lt, o metinė investicijų grąža – 5 proc.

	Po 1 metų	Po 3 metų	Po 5 metų	Po 10 metų
Sumokėta atskaitymų Lt.	309	558	850	1 809
Sukaupta suma, jei nebūtų atskaitymų	10 500	11 576	12 763	16 289
Sukaupta suma, esant dabartiniam atskaitymų dydžiui	10 191	11 018	11 913	14 480

#### IV. INFORMACIJA APIE PENSIJŲ FONDO INVESTICINIŲ PRIEMONIŲ PORTFELĮ

##### 11. Ataskaitinio laikotarpio pabaigos investicinių priemonių portfelio sudėtis:

Emitento pavadinimas	Šalis	ISIN kodas	Kiekis, vnt.	Bendra nominali vertė	Bendra įsigijimo vertė	Bendra rinkos vertė	Rinka, pagal kurios duomenis nustatyta rinkos vertė (tinklalapio adresas)	Balsų dalis emitente, %	Dalis GA, %
Nuosavybės vertybiniai popieriai, įtraukti į Oficialųjį ar įj atitinkantį prekybos sąrašą									
AB "TEO LT"	LT	LT000012391	60 000	60 000	73 000	109 800	www.baltic.omxnordicexchange.com	0.0064	0.66
Iš viso:			60 000	60 000	73 000	109 800			0.66
Nuosavybės vertybiniai popieriai, įtraukti į Papildomąjį ar įj atitinkantį prekybos sąrašą									
Iš viso:									
Nuosavybės vertybiniai popieriai, kuriais prekiaujama kitose reguliuojamose rinkose									
Iš viso:									
Išleidžiami nauji nuosavybės vertybiniai popieriai									
Iš viso:									
Iš viso nuosavybės vertybinių popierių:				60 000	73 000	109 800	-	-	0.66

Emitento pavadinimas	Šalis	ISIN kodas	Kiekis, vnt.	Bendra nominali vertė	Bendra įsigijimo vertė	Bendra rinkos vertė	Palūka-nų norma	Išpirkimo / konvertavimo data	Dalis GA, %
Ne nuosavybės vertybiniai popieriai, įtraukti į Oficialųjį ar įj atitinkantį prekybos sąrašą									
Iš viso:									
Ne nuosavybės vertybiniai popieriai, įtraukti į Papildomąjį ar įj atitinkantį prekybos sąrašą									
Iš viso:									
Ne nuosavybės vertybiniai popieriai, kuriais prekiaujama kitose reguliuojamose rinkose									
Iš viso:									
Išleidžiami nauji ne nuosavybės vertybiniai popieriai									
LR Vyriausybė	LT	XS0212170939	206.00	711276.8	646089.28	639720.72	6.25	2016.02.10	2.96
LR Vyriausybė	LT	XS0435153068	1189.00	4105379	4711448.59	4829835.35	9.38	2014.06.22	22.35
LR Vyriausybė	LT	XS0457764339	382.00	918786.4	894030.21	954205.34	6.75	2015.01.15	4.42
Iš viso:				5735442.4	6251568.08	6423761.41			29.73
Iš viso ne nuosavybės vertybinių popierių:				5735442.4	6251568.08	6423761.41	-	-	29.73

KIS pavadinimas	Šalis	ISIN kodas	Kiekis, vnt.	Valdytojas	Bendra įsigijimo vertė	Bendra rinkos vertė	Rinkos vertės nustatymo šaltinis (tinklalapio adresas)	KIS tipas*	Dalis GA, %
Kolektyvinio investavimo subjektų įstatymo 61 str. 1 d. reikalavimus atitinkančių kolektyvinio investavimo subjektų (KIS) vienetai (akcijos)									
iShares DAX	DE	DE0005933931	7558.00	Barclays Global Investors Limited	1408182.36	1456171.44	www.ishares.eu	KIS 3	6.74
iShares FTSE BRIC 50	DE	DE000A0MSAE7	20201.00	Barclays Global Investors Limited	1322700.76	1445220.27	www.deutscheboerse.com	KIS 3	6.69
Lyxor DJ Euro Stoxx 50	FR	FR0007054358	15061.00	Lyxor Asset Management	1425008.16	1544477.84	www.euronext.com	KIS 3	7.15

Lyxor ETF MSCI India	FR	FR0010361683	39469.00	Lyxor International Asset Management	1364040.04	1450003.91	www.lyxoreft.com	KIS 3	6.71
iShares MSCI AC FarEast ex. Japan	IE	IE00B0M63730	13497.00	Barclays Global Investors Limited	1214084.79	1275508.83	www.ishares.eu	KIS 3	5.90
XACT OBX	NO	NO0010262249	89700.00	Handelsbanken Fondforvaltning AS	1095178.05	1263531.65	www.oslobors.no	KIS 3	5.85
XACT OMXS30	SE	SE0000693293	38556.00	XACT Fonder AB	1160290.23	1210345.58	www.nasdaqomxbaltic.com	KIS 3	5.60
SPDR Trust Series 1	US	US78462F1030	4545.00	State Street Global Advisors	1120988.82	1218221.29	www.nyse.lt	KIS 3	5.64
Iš viso:					10110473.21	10863480.80			50.28
Kitų kolektyvinio investavimo subjektų vienetai (akcijos)									
Iš viso:									
Iš viso KIS vienetų (akcijų):				-	10110473.21	10863480.80	-	-	50.28

\* Nurodyti KIS tipą:

- KIS 1 – KIS, kurių investavimo strategijoje numatyta iki 100 proc. grynujų aktyvų investuoti į ne nuosavybės vertybinius popierius;
- KIS 2 – KIS, kurių investavimo strategijoje numatytas mišrus (subalansuotas) investavimas;
- KIS 3 – KIS, kurių investavimo strategijoje numatyta iki 100 proc. grynujų aktyvų investuoti į nuosavybės vertybinius popierius;
- KIS 4 – KIS, kurių investavimo strategijoje numatyta iki 100 proc. grynujų aktyvų investuoti į pinigų rinkos priemones;
- KIS 5 – visų kitų rūšių KIS (alternatyvaus investavimo, privataus kapitalo, nekilnojamojo turto, žaliavų ir kt.).

**Pastaba.** Investuojant į fondų fondus, juos priskirti tam tikrai KIS grupei pagal fondų fondų investavimo strategiją.

Emitento pavadinimas	Šalis	Priemonės pavadinimas	Kiekis, vnt.	Valiuta	Bendra rinkos vertė	Palūkanų norma	Galiojimo pabaigos data	Dalis GA, %
Pinigų rinkos priemonės, kuriomis prekiaujama reguliuojamose rinkose								
Iš viso:								
Kitos pinigų rinkos priemonės								
Iš viso:								
Iš viso pinigų rinkos priemonių:								
					-	-	-	-

Kredito įstaigos pavadinimas	Šalis	Valiuta	Bendra rinkos vertė	Palūkanų norma	Indėlio termino pabaiga	Dalis GA, %
Indėliai kredito įstaigose						
AB Danske bankas	LT	LTL	1574678.30	2.80	2010.01.04	7.29
AB SEB bankas	LT	LTL	501809.15	4.80	2010.02.26	2.32
AB EB bankas	LT	LTL	1501191.78	1.45	2010.01.11	6.95
Iš viso indėlių kredito įstaigose			-	3577679.23	-	16.56

Priemonės pavadinimas	Emitentas	Šalis	Kita sandorio šalis	Valiuta	Investicinis sandoris (pozicija)	Sandorio (pozicijos) vertė	Bendra rinkos vertė	Rinkos pavadinimas (tinklalapio adresas)	Galiojimo terminas	Dalis GA, %
Išvestinės finansinės priemonės, kuriomis prekiaujama reguliuojamose rinkose										
Iš viso:										
Kitos išvestinės finansinės priemonės										

Iš viso:									
Iš viso išvestinių finansinių priemonių			-	-	-	-	-	-	-

Banko pavadinimas	Valiuta	Bendra rinkos vertė	Palūkanų norma	Dalis GA, %
Pinigai				
AB bankas „Swedbank“	LTL	642372.45	0.10	2.97%
AB bankas „Swedbank“	USD	6.97	0.10	0.00%
AB bankas „Swedbank“	EUR	259655.88	0.10	1.20%
Iš viso pinigų:	-	155960	-	4.17

Pavadinimas	Trumpas apibūdinimas	Bendra vertė	Paskirtis	Dalis GA, %
Kitos priemonės (aiškiai įvardyti), nenurodytos Kolektyvinio investavimo subjektų įstatymo 57 str. 1. d				
Iš viso:		-	-	-

12. Investicijų pasiskirstymas pagal investavimo strategiją atitinkančius kriterijus (pildyti pagal investavimo strategiją atitinkančius kriterijus, pavyzdžiui, pagal turto rūšis, pramonės šakas, geografinę zoną, valiutas, rinkas, emitentų tipus (vyriausybė, bendrovės), emitentų kredito reitingus, priemonių galiojimo trukmę bei kt.):

Investicijų pasiskirstymas	Rinkos vertė	Dalis aktyvuose (%)	Rinkos vertė ataskaitinio laikotarpio pradžioje	Dalis aktyvuose ataskaitinio laikotarpio pradžioje (%)
Pagal investavimo objektus				
Akcijos	10973281	50.16%	69600	2.28%
Obligacijos	6423761	29.36%		
Alternatyvios investicijos	0	0.00%		
Pinigų rinkos priemonės	4479715	20.48%	2987524	97.75%
Išvestinės priemonės	0	0.00%		
Iš viso	21876757	100%	3057124	100%
Pagal sektorius				
Iš viso	-	-	-	-
Pagal valiutas				
EUR	12900594	58.97%	1673649	54.76%
LTL	4329851	19.79%	1383475	45.24%
USD	2172434	9.93%		
SEK	1210346	5.53%		
NOK	1263532	5.78%		
Iš viso	21876757	100%	3057124	100%
Pagal geografinę zoną				
Lietuva	11013276	50.34%	3057124	100%
Vokietija	2901391	13.26%		
Prancūzija	2994482	13.69%		
Airija	1275509	5.83%		
Norvegija	1263532	5.78%		
Švedija	1210346	5.53%		

Jungtinės Amerikos Valstijos	1218221	5.57%		
Iš viso	21876757	100%	3057124	100%
Pagal trukmę				
Iki pareikalavimo	11875316	54.28%	225560	7.38%
Iki metų	3577679	16.35%	2831563	92.65%
Virš metų	6423761	29.36%		
Iš viso	21876757	100%	3057124	100%

13. Per ataskaitinį laikotarpį įvykdyti išvestinių finansinių priemonių sandoriai, išskyrus tuos, kurie nurodyti šio priedo 11 punkte (pagal išvestinių finansinių priemonių rūšis nurodyti sandorių vertes, išvestinių finansinių priemonių panaudojimo tikslus (valiutų keitimo, palūkanų normos, susiję su nuosavybe, ir kt.), taip pat sandorius reguliuojamose rinkose ir šalių tarpusavio sandorius bei kitą svarbią informaciją).

**Nebuvo.**

14. Aprašyti šio priedo 11 punkte nurodytų išvestinių finansinių priemonių rūšis, su jomis susijusią riziką, kiekybines ribas ir metodus, kuriais vertinama su išvestinių finansinių priemonių sandoriais susijusi pensijų fondo rizika, ir nurodyti, kaip išvestinė finansinė priemonė gali apsaugoti investicinių priemonių sandorį (investicinių priemonių poziciją) nuo rizikos.

**Nebuvo.**

15. Iš išvestinių finansinių priemonių sandorių kylančių įsipareigojimų bendra vertė ataskaitinio laikotarpio pabaigoje (atskirai nurodyti sumas pagal skirtingas įsigytų išvestinių finansinių priemonių kategorijas).

**Nebuvo.**

16. Pateikti analizę, kaip turimas investicinių priemonių portfelis atitinka (neatitinka) pensijų fondo investavimo strategiją (investicijų kryptis, investicijų specializaciją, geografinę zoną ir pan.).

**Pensijų fondo „MP Extremo II“ investicijų portfelis, ataskaitiniu laikotarpiu, atitiko taisyklėse nustatytą investicijų strategiją. Apie 50,2 proc. pensijų fondo grynujų aktyvų, ataskaitinio laikotarpio pabaigai, buvo investuojama akcijų rinkose, prisiimant su tuo susijusią riziką ir siekiant aukštesnio pelningumo ilgu laikotarpiu. Didesnį tikėtiną akcijų rinkų svyravimą buvo siekiama atsverti vidutinškai stabilesnį pelningumą generuojančiomis investicijomis į Lietuvos Respublikos vyriausybės vertybinius popierius bei euroobligacijas, į kurias buvo investuota apie 29,4 proc. pensijų fondo grynujų aktyvų vertės. Likusi, apie 20,5 proc. pensijų fondo grynujų aktyvų, buvo investuota į Lietuvos Respublikos kredito įstaigų terminuotus indėlius, neperžengiant taikytinos 20 proc. į vieną kredito įstaigą ribos, kaip yra numatyta Lietuvos Respublikos pensijų kaupimo įstatyme.**

17. Nurodyti veiksniai, per ataskaitinį laikotarpį turėjusius didžiausią įtaką investicinių priemonių portfelio struktūros ir jo vertės pokyčiams.

**Ataskaitiniu laikotarpiu pensijų fondo investicijų portfelio vertės pokyčiams didžiausią įtaką turėjo:**

1. akcijų rinkų svyravimai visame pasaulyje;
2. rinkos palūkanų (eurais ir litais) normos pokyčiai;
3. valiutos kursų svyravimai.

## 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.

**Orientacinis indeksas yra 100% MSCI All Countries World Index (in EUR) - yra laisvų akcijų rinkos kapitalizacijos indeksas, kuris apibūdina nuosavybės vertybinių popierių rinkos rezultatus išsivysčiusiose ir kylančiose šalyse.**

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.

	Per ataskaitinį laikotarpį	Prieš metus	Prieš 2 metus	Prieš 10 metų
Apskaitos vieneto vertės pokytis *	10.77%	3.30%	0.45%	-
Lyginamojo indekso pokytis	28.04%	-40.99%	-4.55%	-
Metinė grynoji investicijų grąža **	9.60%	0.85%	0.28%	-
Metinė bendroji investicijų grąža (pildoma papildomo savanoriško pensijų kaupimo fondui) **	-	-	-	-
Apskaitos vieneto vertės pokyčio standartinis nuokrypis **	3.89%	0.22%	0.11%	-
Lyginamojo indekso pokyčio standartinis nuokrypis **	19.99%	34.22%	165.51%	-
Apskaitos vieneto vertės ir lyginamojo indekso koreliacijos koeficientas **	46.00%	25.70%	-8.79%	-
Indekso sekimo paklaida **	16.79%	20.31%	206.25%	-
Alfa rodiklis **	8.28%	3.41%	0.47%	-
Beta rodiklis **	0.0886	0.0021	-0.0001	-

\* Apskaičiuojant apskaitos vieneto vertės pokytį, neatsižvelgiama į atskaitymus nuo įmokų.

Metinė grąža – tai procentinis investicijų vertės pokytis per metus, kuris apima tiek investicijos kapitalo pokytį, tiek pelną ir dividendus bei palūkanas. Metinė pensijų fondų grąža gali svyruoti. Aukštesnės grąžos pensijų fondai taip pat pasižymi didesne investavimo rizika;

Standartinis nuokrypis - statistinis rizikos rodiklis, apibūdinantis investicijų portfelio grąžos kintamumą. Jei investicijų grąžos standartinis nuokrypis yra lygus nuliui, vadinasi, investicijų portfelis turi pastoviai nekintama investicijų grąžą;

Koreliacijos koeficientas - rodiklis, kuris parodo vieneto verčių ir lyginamojo indekso pokyčių statistinę priklausomybę;

Indekso sekimo paklaida - statistinis rizikos rodiklis, parodantis vieneto vertės pokyčių ir lyginamojo indekso pokyčių skirtumų standartinį nuokrypį;

Alfa rodiklis - parodo skirtumą tarp pensijų fondo apskaitos vieneto vertės pokyčio ir lyginamojo indekso pokyčio, esant palyginamam rizikos lygiui;

Beta rodiklis - parodo, kiek pasikeičia pensijų fondo apskaitos vieneto vertė pasikeitus lyginamojo indekso reikšmei.

Apskaitos vieneto vertės ir lyginamojo indekso reikšmės pokyčių diagrama:



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

**Nebuvo.**

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 vidurkis, atitinkamai, metinių grynosios investicijų grąžos, metinių apskaitos vieneto vertės pokyčių ir lyginamojo indekso reikšmės pokyčių vidurkis). Kiekvienam fondo tipui pildoma lentelė:

	Per paskutinius 3 metus	Per paskutinius 5 metus	Per paskutinius 10 metų	Nuo veiklos pradžios
Vidutinis apskaitos vieneto vertės pokytis*	4.75%	-	-	4.75%
Vidutinis pensijų fondo lyginamojo indekso pokytis*	-10.32%	-	-	-10.32%
Vidutinė grynoji investicijų grąža*	3.49%	-	-	3.49%
Vidutinė bendroji investicijų grąža (pildoma papildomo savanoriško pensijų kaupimo fondui)*	-	-	-	-
Vidutinis apskaitos vieneto vertės pokyčio standartinis nuokrypis*	1.39%	-	-	1.39%

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. Pateikti šias pensijų fondo finansines ataskaitas, parengtas vadovaujantis Lietuvos Respublikos įstatymų ir teisės aktų reikalavimais:

23.1. paskutinių 3 finansinių metų balansus, išdėstytus palyginamojoje lentelėje

Eil. Nr.	TURTAS	Pastabų Nr.	2009 metai	2008 metai	2007 metai
I.	PINIGAI IR PINIGŲ EKVIVALENTAI		259 663	155 960	600
II.	TERMINUOTI INDĖLIAI		4 220 052	2 831 564	72 705
III.	INVESTICIJOS	1	17 397 042	69 600	0
1	Skolos vertybiniai popieriai		6 423 761		
1.1.	Vyriausbių ir centrinių bankų arba jų garantuoti skolos vertybiniai popieriai		6 423 761		
1.2.	Kiti skolos vertybiniai popieriai				

2	Nuosavybės vertybiniai popieriai		109 800	69 600	0
3	Kolektyvinio investavimo subjektų investiciniai vienetai ir akcijos		10 863 481		
4	Kitos investicijos				
IV.	GAUTINOS SUMOS		2 672	0	0
1	Investicijų pardavimo sandorių gautinos sumos				
2	Kitos gautinos sumos		2 672		
	TURTAS, IŠ VISO	2	21 879 429	3 057 124	73 305
V.	ĮSIPAREIGOJIMAI		270 060	817	0
1	Investicijų pirkimo sandoriai		259 107		
2	Mokėtinos sumos kaupimo bendrovei ir depozitoriumui		10 407	817	0
3	Kitos mokėtinos sumos ir įsipareigojimai		546		
VI.	GRYNIJI AKTYVAI (I+II+III+IV-V)		21 609 369	3 056 307	73 305
	ĮSIPAREIGOJIMAI IR GRYNIJI AKTYVAI, IŠ VISO		21 879 429	3 057 124	73 305

23.2. paskutinių 3 finansinių metų gryųjų aktyvų pokyčių ataskaitas, išdėstytas palyginamojoje lentelėje

Eil. Nr.	Straipsniai	Pastabų Nr.	2009 metai	2008 metai	2007 metai
I.	GRYNIJI AKTYVAI ATASKAITINIO LAIKOTARPIO PRADŽIOJE		3 056 307	73 305	0
II.	PADIDĖJIMAS, IŠ VISO		18 838 789	3 004 475	78 727
1	Dalyvių įmokos		2 293 559	549 496	24 793
2	Iš kitų fondų pervestos sumos		15 072 286	2 417 078	53 653
3	Palūkanos ir dividendai		407 852	37 901	281
4	Investicijų pardavimo pelnas		27 542		
5	Investicijų vertės padidėjimo suma		971 769		
6	Turto vertės padidėjimas dėl užsienio valiutų kursų pasikeitimo		65 781		
7	Kitos pajamos				
III.	SUMAŽĖJIMAS, IŠ VISO		285 854	21 473	5 422
1	Išmokos dalyviams		0	0	0
2	Iš kitų pensijų fondus pervestos sumos		74 200	0	5 360
3	Investicijų pardavimo nuostoliai				
4	Investicijų vertės sumažėjimo suma		6 368	3 400	0
5	Turto vertės sumažėjimas dėl užsienio valiutų kursų pasikeitimo		61 734		
6	Valdymo sąnaudos		143 425	18 073	62
7	Kitos sąnaudos				
IV.	GRYNIJI AKTYVAI ATASKAITINIO LAIKOTARPIO PABAIGOJE		21 609 369	3 056 307	73 305
			2009 metai	2008 metai	2007 metai
V.	APSKAITOS VIENETO VERTĖ		1.1497	1.0379	1.0047
VI.	APSKAITOS VIENETŲ SKAIČIUS		18 796 363.1524	2 944 813.0581	72 962.6610

23.3. aiškinamąjį raštą

**I. Bendroji informacija**

1. Informacija apie pensijų fondą:

<b>Pavadinimas</b>	MP EXTREMO II
<b>Teisinė forma</b>	Pensijų kaupimo fondas, neturintis juridinio asmens statuso
<b>VPK pritarimo sudarymo dokumentams data</b>	2007 m. rugsėjo 20 d.

## 2. Duomenys apie įmonę:

<b>Pavadinimas</b>	UAB „MP Pension Funds Baltic“
<b>Kodas</b>	300668928
<b>Buveinė (adresas)</b>	Rūdininkų g. 18/ Visų Šventųjų g. 2, LT–01135 Vilnius
<b>Telefono numeriai, fakso numeriai, el. pašto adresas, interneto svetainės adresas</b>	+370 37 719 302 +370 37 719 562 info@mppf.lt <a href="http://www.mppf.lt">www.mppf.lt</a> <a href="http://www.mpensija.lt">www.mpensija.lt</a>
<b>Leidimo verstis valdymo įmonės veikla numeris</b>	VJP–004
<b>Įregistravimo Juridinių asmenų registre data, vieta, kodas</b>	Įmonė įregistruota 2007 m. balandžio mėn. 5 d. Vilniaus m. Rejestro tarnyboje Juridinių asmenų registro kodas – 100568

## 3. Informacija apie depozitoriumą:

<b>Pavadinimas</b>	„Swedbank“, AB
<b>Kodas</b>	12029651
<b>Adresas</b>	Savanorių pr. 19, LT–03502 Vilnius
<b>Telefono ir fakso numeriai</b>	1884, +370 5 268 4700

## 4. Informacija apie auditorius:

<b>Auditoriaus pavadinimas</b>	„KPMG Baltics“, UAB
<b>Adresas</b>	Vytauto g. 12, Vilnius
<b>Telefono, fakso numeriai</b>	+370 5 2102600, +370 5 2102659

## II. Apskaitos politika

Pateiktos metinės finansinės ataskaitos yra parengtos remiantis istorine savikaina, išskyrus investicijas, kurios apskaitomos tikrąja verte.

Skaičiai metinėse finansinėse ataskaitose yra pateikti litais.

Metinės finansinės ataskaitos parengtos vadovaujantis šiais teisės aktais:

Lietuvos Respublikos Vyriausybės nutarimas Nr. 30, 2004-01-13, „Dėl Lietuvos Respublikos pensijų kaupimo įstatymo ir Lietuvos Respublikos papildomo savanoriško pensijų kaupimo įstatymo įgyvendinimo“, Lietuvos Respublikos buhalterinės apskaitos įstatymas (Žin., 2001, Nr. 99-1615), Lietuvos Respublikos įmonių finansinės atskaitomybės įstatymas (Žin., 2001, Nr. 99-1616; 2003, Nr. 123-5587), Lietuvos Respublikos kolektyvinio investavimo subjektų įstatymas (Žin., 2003, Nr. 74-1525).

Pensijų kaupimo fondo finansiniai metai yra kalendoriniai metai. Fondo metinės finansinės ataskaitos turi būti sudaromos per keturis mėnesius nuo finansinių metų pabaigos.

## Investavimo politika

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

Pensijų fondas gali investuoti į:

1. vertybinius popierius, pinigų rinkos priemones, kuriomis prekiaujama pripažintose ir visuomenei prieinamose reguliuojamose rinkose, veikiančiose Lietuvos Respublikoje ar Europos Sąjungos valstybėje bei šalyse, kurios priklauso Ekonominio bendradarbiavimo ir plėtros organizacijai;
2. išleidžiamus naujus vertybinius popierius, 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;
3. investicinius vienetus ir akcijas kolektyvinio investavimo subjektų, atitinkančių LR teisės aktų nustatytus reikalavimus;
4. indėlius ne ilgesnio kaip 12 mėnesių termino, kuriuos galima atsiimti pareikalavus ir kurie yra kredito įstaigose, kurių registruota buveinė yra Europos Sąjungos valstybėje arba kitoje valstybėje, kurioje riziką ribojanti priežiūra yra ne mažesnė kaip Europos Sąjungoje;
5. išvestines finansines priemones, skirtas Pensijų fondo rizikai valdyti;
6. kitas finansines priemones, numatytas teisės aktuose.

## Finansinės rizikos valdymo politika

Išskiriamos bendrosios rizikos:

*Biržos prekių kainos rizika* – tikimybė, kad fondas, besiverčiantis prekyba biržos prekių rinkoje, gali patirti nuostolių dėl šių prekių kainų pokyčių.

*Gautinų sumų sumažėjimo rizika* – tikimybė, kad gautinų sumų vertė sumažės.

*Kredito rizika* – tikimybė, kad sandorio šalis nesugebės atsiskaityti sutartyje nustatyta tvarka.

*Operacinė rizika* – tikimybė patirti nuostolių dėl netinkamų ar nepavykusių fondo vidaus procesų, darbuotojų, sistemų arba išorės įvykių įtakos, taip pat dėl teisinės rizikos.

*Rinkos rizika* – tikimybė, kad rinkos kintamieji elementai – palūkanų norma, valiutos kursas, nuosavybės vertybinių popierių, biržos prekių kainos – pasikeis taip, kad fondas dėl sudaryto sandorio patirs nuostolių.

Su Pensijų fondo investicijomis yra susijusi ši rizika:

*kredito rizika* – rizika patirti nuostolius dėl skolos vertybinių popierių emitento nesugebėjimo įvykdyti savo skolinių įsipareigojimų. Siekiant sumažinti kredito riziką, dalis Pensijų fondo lėšų bus investuojamos į žemos rizikos skolos vertybinius popierius;

*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 turtą sudarančių skolos vertybinių popierių portfelį, gali būti atsižvelgiama į Dalyvių vidutinę sutarties trukmę;

*valiutos kurso rizika* – rizika patirti nuostolius dėl nepalankaus užsienio valiutos kurso pokyčio nacionalinės valiutos atžvilgiu, kuris sąlygoja neigiamą turto, laikomo ta užsienio valiuta, pokytį. Siekiant sumažinti valiutų kurso pokyčių riziką dalis lėšų bus investuojama nacionaline valiuta bei bazine valiuta, kurios kursas nesvyruoja nacionalinės valiutos atžvilgiu;

*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;

*rinkos likvidumo rizika* – rizika patirti nuostolius dėl mažo rinkos likvidumo, kuris neleidžia parduoti finansinių priemonių norimu laiku ir už norimą kainą, arba apskritai atima galimybę parduoti turimą turtą (investiciją). Siekiant sumažinti rinkos likvidumo riziką bus investuojama tikrai į tuos vertybinius popierius, kurie kotiruojami pripažintose pasaulio rinkose arba kurių kainą reguliariai skelbia visuotinės informavimo priemonės;

*sandorio šalies rizika* – rizika patirti nuostolius dėl sandorio šalies nesugebėjimo įvykdyti savo finansinius įsipareigojimus, kurie buvo priimti sudarant sandorį. Siekiant sumažinti sandorio šalies riziką, Bendrovė sudarys sandorius daugiausia su žemos rizikos (investicinio reitingo) kredito įstaigomis ar finansų įstaigomis, o jų nesant, su patikimais partneriais, besispecializuojančiais 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 daugiausia bus naudojami mokėjimų agento paslaugomis, arba prekybinė veikla bus vykdoma organizuotose rinkose, kuriose atsiskaitymams taikomi visuotinai pripažinti principai.

#### **Investicijų portfelio struktūra**

Pensijų fondo investavimo strategija remiasi prielaida, pagrįsta daugelio Dalyvių ilgalaikiu investavimo horizontu, todėl iki 100 procentų Pensijų 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 atsvirti vidutiniškai stabilesnį pelningumą generuojančiomis investicijomis, kaip kad vyriausybės vertybiniais popieriais, kredito įstaigų ir kitų bendrovių skolos vertybiniais popieriais, indėliais ir pan., į kuriuos investuojama likusi Pensijų fondo grynųjų aktyvų dalis. Investuojant specializacija geografinėje zonoje ar pramonės šakoje nebus taikoma.

#### **Turto padidėjimo ir sumažėjimo pripažinimo principai**

Pinigų padidėjimas pripažįstamas pagal pinigų padidėjimą banko sąskaitoje. Atitinkamai pripažįstamas sumažėjimas – sumažėjus pinigams banko sąskaitoje.

Vertybinių popierių padidėjimas fiksuojamas įsigyjant vertybinius popierius. Taip pat padidėjimas pripažįstamas perkainavus vertybinius popierius – vertės padidėjimo suma.

Sumažėjimas fiksuojamas pardavus vertybinius popierius ar emitentui juos išpirkus arba perkainavus – vertės sumažėjimo suma. Vertybinių popierių pripažinimo momentas – transakcijos diena kai yra perduodama vertybinių popierių nuosavybė.

Gautinų sumų straipsnio padidėjimas fiksuojamas sumokant avansus ar registruojant gautiną sumą.

Padidėjimas ar sumažėjimas fiksuojamas, jei atsiskaitoma užsienio valiuta – perkainuota oficialaus lito ir Lietuvos banko skelbiamos valiutos kurso suma.

Sumažėjimas fiksuojamas pardavus turtą ar pripažįstant turto vertės sumažėjimą.

### Atskaitymų valdymo įmonei ir depozitoriumui taisyklės

Galimi atskaitymai iš Pensijų turto:

- **įmokos mokestis** išskaičiuojamas iš kiekvienos VSDF valdybos Bendrovei pervedamos pensijų įmokos, tačiau ne daugiau kaip 3 procentai nuo pervedamos pensijų įmokos. Jeigu 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 įmokos mokestis neskaičiuojamas.
- **metinis turto valdymo mokestis** ne didesnis kaip 1 procentas nuo vidutinės metinės Dalyvio Pensijų sąskaitoje apskaičiuotų lėšų vertės.
- **atskaitymai ir išlaidos, išskaičiuojamos dalyvavimo Pensijų fonde baigties atveju.** Dalyvio perėjimas į kitą Bendrovės valdomą pensijų fondą atliekamas nemokamai, nepriklausomai nuo perėjimo dažnumo. Dalyvio perėjimo į kitos pensijų kaupimo bendrovės valdomą pensijų fondą pirmą kartą per kalendorinius metus atveju ar Dalyvio perėjimo į kitos pensijų kaupimo bendrovės valdomą pensijų fondą ne pirmą kartą per kalendorinius metus atveju, Bendrovė nuo Dalyvio vardu į kitą pensijų fondą pervedamų piniginių lėšų sumos atskaito iki 0,2 procento sumą, kurią sudaro su Dalyvio perėjimu į kitą pensijų fondą susijusios išlaidos.

Visos kitos išlaidos ir galimi mokesčiai susiję su Pensijų fondo turto valdymu, t.y. depozitoriumo mokesčiai, mokesčiai prekybos vertybiniais popieriais tarpininkams, mokesčiai auditoriams, biuro administravimo išlaidos, reklamos išlaidos yra apmokami Bendrovės lėšomis.

### Turto ir įsipareigojimų įvertinimo metodai ir periodiškumas

Fondo turtas ir įsipareigojimas vertinami vadovaujantis Lietuvos Respublikos įstatymų, LR Vertybinių popierių komisijos patvirtintos Grynųjų aktyvų vertės skaičiavimo metodikos ir kitų teisės aktų nustatyta tvarka (įskaitant ir Bendrovės valdybos patvirtintas atitinkamas metodikas bei taisykles).

Turtas (ar jo dalis) yra nurašomas tik tada, kai įgyvendinamos teisės į šį turtą (ar jo dalį) arba, kai baigiasi teisių galiojimo laikas, arba, kai šios teisės perleidžiamos.

Įsipareigojimai skaičiuojami pagal Verslo apskaitos standartų reikalavimus.

Įsipareigojimai (ar jų dalis) turi būti nurašomi tik tada, kai jie išnyksta, t. y., kai sutartyje nustatyti įsipareigojimai įvykdomi, anuliuojami ar nustoja galioti.

Turto ir įsipareigojimų skaičiavimas yra grindžiamas jų tikrąja verte, kuri atspindi grynųjų aktyvų vertę, už kurią labiausiai tikėtina šiuos aktyvus parduoti.

Skaičiuojant grynųjų aktyvų vertę, užsienio valiuta denominuotų turto ir įsipareigojimų vertė nustatoma pagal Lietuvos banko nustatytą oficialią tos valiutos ir lito kursą, galiojantį vertinimo dieną.

Priemonių, kuriomis prekiaujama reguliuojamose rinkose, tikroji vertė nustatoma pagal viešai paskelbtą tos priemonės uždarymo kainą, išskyrus atvejus, nustatytus Lietuvos Respublikos teisės aktuose, kai priemonė yra kotiruojama keliose reguliuojamose rinkose ar per paskutiniąją prekybos sesiją priemonė nebuvo kotiruojama, arba priemonė nebuvo kotiruojama daugiau kaip 30 dienų iki vertinimo dienos, arba priemonė buvo kotiruojama rečiau nei nustatyta skaičiavimo procedūrose. Tokiais atvejais priemonių tikroji vertė nustatoma vadovaujantis Lietuvos Respublikos įstatymų, LR Vertybinių popierių komisijos patvirtintos Grynųjų aktyvų vertės skaičiavimo metodikos ir kitų teisės aktų nustatyta tvarka (įskaitant ir Bendrovės valdybos patvirtintas atitinkamas metodikas bei taisykles).

Priemonių, kuriomis neprekiujama reguliuojamose rinkose, tikroji vertė nustatoma tokiu būdu:

- Nuosavybės vertybiniai popieriai vertinami vadovaujantis LR Vertybinių popierių komisijos patvirtintos Grynųjų aktyvų vertės skaičiavimo metodikos V skyriaus 35.1.1 ir 35.1.2 papunkčiuose nurodytais metodais.
- Skolos vertybiniai popieriai ir pinigų rinkos priemonės vertinami pagal „Reuters DataScope“ ir „Bloomberg“ informaciniuose šaltiniuose skelbiamą uždarymo kainą. Skolos vertybiniai popieriai ir pinigų rinkos priemonės, kurių minėtuose šaltiniuose nėra, vertinami pagal LR Vertybinių popierių komisijos patvirtintos Grynųjų aktyvų vertės skaičiavimo metodikos V skyriaus 35.2.1 ir 35.2.2 papunkčiuose numatytus metodus.
- Jei vertinant 3.3.1 ir 3.3.2 punktuose nurodytais būdais, gauta vertė neatspindi tikrosios priemonės vertės (tikėtinos pardavimo kainos), tai vertinama pagal vertinimo modelį nurodytą Bendrovės valdybos patvirtintose atitinkamose metodikose bei taisyklėse.

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

Terminuoti indėliai bankuose vertinami pagal amortizuotas savikainos vertę.  
Grynieji pinigai ir lėšos kredito įstaigose vertinami nominaliąja verte.

### Investicinio vieneto vertės nustatymo taisyklės

Kiekviena Pensijų sąskaita turi individualų sąskaitos numerį, kurį suteikia Bendrovė. Į Pensijų fondo sąskaitą pervestos Dalyviui priklausančio pinigines lėšas (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 Pensijų sąskaitoje įrašytų apskaitos vienetų skaičių.

Pensijų fondo Grynųjų aktyvų vertė (toliau - GAV) apskaičiuojama iš fondo turto atėmus įsipareigojimus. Fondo apskaitos vieneto vertė nustatoma fondo GAV padalijus iš visų apyvartoje esančių fondo apskaitos vienetų skaičiaus. Bendra fondo vienetų vertė yra lygi fondo GAV.

Apskaitos vieneto (jo dalių) vertė nustatoma keturių skaičių po kablelio tikslumu ir apvalinama pagal matematinę apvalinimo taisyklę.

Apskaitos vieneto (jo dalies) vertė išreiškiama Lietuvos Respublikos valiuta. Jeigu Lietuvos Respublika įsiveda kitą oficialią valiutą, fondo apskaitos vienetai konvertuojami į naują valiutą be papildomų atskaitymų pagal oficialų (Lietuvos banko) keitimo kursą.

Pradinė Pensijų fondo apskaitos vieneto vertė yra 1 litas.

Einamosios darbo dienos apskaičiuota apskaitos vieneto vertė iki kitos darbo dienos 12 val. paskelbiama tinklalapyje [www.mppfl.lt](http://www.mppfl.lt).

### Pinigų ekvivalentai

Pinigų ekvivalentais laikomos trumpalaikės (iki trijų mėnesių) likvidžios investicijos, kurios gali būti greitai keičiamos į pinigus ir kurių vertės pasikeitimo rizika yra nereikšminga. Nuosavybės vertybiniai popieriai pinigų ekvivalentams nėra priskiriami.

### III. Pastabos

#### 1. Investicijų vertės pokytis

Balanso straipsniai	Pokytis					
	Praėjusio ataskaitinio laikotarpio pabaigoje	Įsigyta	Parduota (išpirkta)	Vertės padidėjimas	Vertės sumažėjimas	Ataskaitinio laikotarpio pabaigoje
Vyriausybės ir centrinių bankų arba jų garantuoti skolos vertybiniai popieriai	0	9 513 152	3 261 584	178 561	6 368	6 423 761
Kiti skolos vertybiniai popieriai						
Nuosavybės vertybiniai popieriai	69 600	0	0	40 200		109 800
Kolektyvinio investavimo subjektų investiciniai vienetai ir akcijos	0	10 110 473	0	753 008	0	10 863 481
Kitos investicijos						
<b>Iš viso:</b>	<b>69 600</b>	<b>19 623 625</b>	<b>3 261 584</b>	<b>971 769</b>	<b>6 368</b>	<b>17 397 042</b>

#### 2. Turto struktūra ataskaitinio laikotarpio pabaigoje

TURTO ARBA EMITENTO PAVADINIMAS	Valstybės, į kurios vertybinius popierius investuota pavadinimas	Valiuta	Kiekis	Nominali vertė (jeigu ji yra)	Tikroji vertė	Palūkanų norma, %	Išpirkimo/konvertavimo data / terminas	Turto, investicijos lyginamoji dalis %
LR Vyriausybės obligacijos EUR, 9,375 proc.	Lietuva	EUR	1 189	4 105 379	4 829 835	9.38		22.07%
Lyxor ETF DJ Euro STOXX 50	Prancūzija	EUR	15 061		1 544 478			7.06%
ISHARES DAX (DE)	Vokietija	EUR	7 558		1 456 171			6.66%
LYXOR ETF MSCI INDIA	Prancūzija	EUR	39 469		1 450 004			6.63%
iShares FTSE BRIC 50	Vokietija	EUR	20 201		1 445 220			6.61%
ISHARES MSCI AC FAR EAST XJP	Arija	EUR	13 497		1 275 509			5.83%
XACT OBX	Norvegija	NOK	89 700		1 263 532			5.77%
SPDR Trust Series 1	Jungtinės Amerikos Valstijos	USD	4 545		1 218 221			5.57%
XACT OMXS30	Švedija	SEK	38 556		1 210 346			5.53%
LITHUANIA 6,75% 15/01/2015	Lietuva	USD	382	918 786	954 205	6.75		4.36%
LR Vyriausybės obligacijos Lithuania 16	Lietuva	EUR	206	711 277	639 721	6.25		2.92%
TEO LT PVA	Lietuva	LTL	60 000	60 000	109 800			0.50%
Danske Bank A/S Lietuvos filialas	Lietuva	LTL			1 574 679	2.80	2010.01.04	7.20%
AB SEB bankas	Lietuva	LTL			1 501 193	1.45		6.86%
„Swedbank“, AB	Lietuva	LTL			642 370	0.10	2010.01.01	2.94%
AB SEB bankas	Lietuva	LTL			501 810	4.80	2010.02.26	2.29%

„Swedbank“, AB	Lietuva	EUR		259 656		1.19%
„Swedbank“, AB	Lietuva	USD		7		0.00%
Kitos gautinos sumos				2 672		0.01%
<b>Iš viso:</b>				<b>21 879 429</b>		<b>100%</b>

## VII. INFORMACIJA APIE PENSIJŲ FONDO DALYVIUS

24. Bendri duomenys apie pensijų fondo dalyvius (dalyviais laikomi ir asmenys, pasinaudoję teise nukelti pensijų išmokos mokėjimą, taip pat asmenys, gaunantys periodines pensijų išmokas):

Dalyvių skaičius ataskaitinio laikotarpio pradžioje 2009.01.01		3026
Dalyvių skaičius ataskaitinio laikotarpio pabaigoje 2009.12.31	dalyviai, pasinaudoję teise nukelti pensijų išmokos mokėjimą	
	dalyviai, gaunantys periodines pensijų išmokas	
	kiti dalyviai	12247
	Iš viso	12247
Dalyvių skaičiaus pokytis		9221

25. Per ataskaitinį laikotarpį 2009.01.01-2009.12.31 prisijungusių dalyvių skaičius:

Bendras prisijungusių dalyvių skaičius		9237
Dalyviai, pensijų kaupimo sutartis sudarę pirmą kartą		4783
Iš kitų pensijų fondų atėję dalyviai	iš tos pačios pensijų kaupimo bendrovės	1
	iš kitos pensijų kaupimo bendrovės	4453

26. Per ataskaitinį laikotarpį 2009.01.01-2009.12.31 pasitraukusių dalyvių skaičius:

Bendras pasitraukusių dalyvių skaičius		16
Į kitus pensijų fondus išėjusių dalyvių skaičius	valdomus tos pačios pensijų kaupimo bendrovės	5
	valdomus kitos pensijų kaupimo bendrovės	11
Baigusių dalyvavimą dalyvių skaičius	išstojusių (pildoma tik papildomo savanoriško pensijų kaupimo pensijų fondo atveju)	0
	sulaukusių nustatyto pensijos amžiaus ir pasinaudojusių teise į pensijų išmoką (vienkartinę išmoką, anuitetą ir jų derinį)	0
	dalyvių, pasinaudojusių Pensijų kaupimo įstatymo suteikta galimybe vienašališkai nutraukti pirmą kartą sudarytą sutartį	0
	mirusių dalyvių	0

27. Pensijų fondo dalyvių struktūra pagal amžių ir lytį ataskaitinio laikotarpio pabaigoje 2009.12.31:

		Dalyviai pagal amžių				
		iki 30	nuo 30 iki 45	nuo 45 iki 60	nuo 60	iš viso
Dalyvių skaičius	iš viso	7152	4781	314	0	12247
	vyrų	2768	1864	126	0	4758
	moterys	4384	2917	188	0	7489
Dalyvių dalis, %	iš viso	58%	39%	3%	0%	100%
	vyrų	23%	15%	1%	0%	39%
	moterys	36%	24%	2%	0%	61%

## VIII. IŠORINIAI PINIGŲ SRAUTAI

28. Per ataskaitinį laikotarpį 2009.01.01-2009.12.31 faktiškai gautos lėšos:

Bendra gautų lėšų suma		17 365 845
Periodinės įmokos į pensijų fondą	iš Valstybinio socialinio draudimo fondo	2 293 559

	pačio 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 delspinigiai		0
Iš garantijų rezervo sumokėtos lėšos		-
Iš kitų pensijų fondų pervestos lėšos	iš tos pačios pensijų kaupimo bendrovės	881
	iš kitos pensijų kaupimo bendrovės	15 071 405
Kitos gautos lėšos (nurodyti šaltinį ir gautų lėšų sumą), iš viso		-
		-
		-

#### 29. Išmokėtos lėšos:

Bendra išmokėtų lėšų suma		74 200
Pensijų išmokos	vienartinės išmokos dalyviams	0
	periodinės išmokos dalyviams	0
	išmokos anuiteto įsigijimui	0
Į kitus pensijų fondus pervestos lėšos	valdomus tos pačios pensijų kaupimo bendrovės	20 733
	valdomus kitos pensijų kaupimo bendrovės	53 467
Ištojusiems dalyviams išmokėtos lėšos (pildoma tik papildomo savanoriško kaupimo pensijų fondų atveju)		0
Paveldėtojams išmokėtos lėšos		0
Kitais pagrindais išmokėtos lėšos (nurodyti šaltinį ir išmokėtų lėšų sumą), iš viso		0

### IX. INFORMACIJA APIE GARANTIJŲ REZERVĄ

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

**Nėra nustatyta.**

### X. INFORMACIJA APIE PENSIJŲ FONDO REIKMĖMS PASISKOLINTAS LĖŠAS

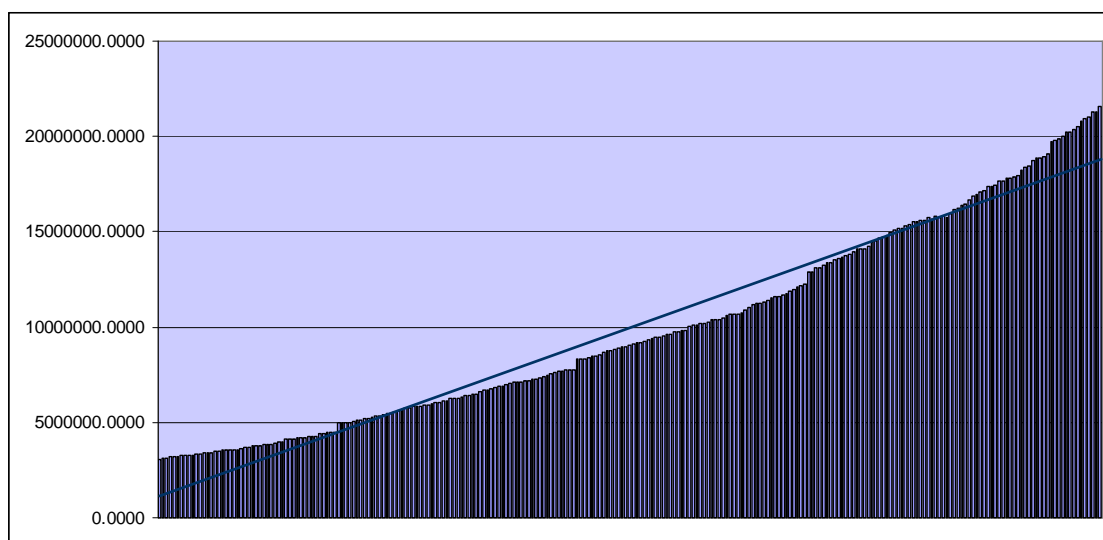
31. Pensijų fondo reikmėms pasiskolintos lėšos ataskaitinio laikotarpio pabaigoje 2008.12.31:

Eil. Nr.	Paskolos suma	Paskolos valiuta	Paskolos paėmimo data	Paskolos grąžinimo terminas	Palūkanų dydis	Skolinimosi tikslas	Kreditarius	Skolintų lėšų dalis, lyginant su fondo GA (%)
Iš viso	-	-	-	-	-	-	-	-

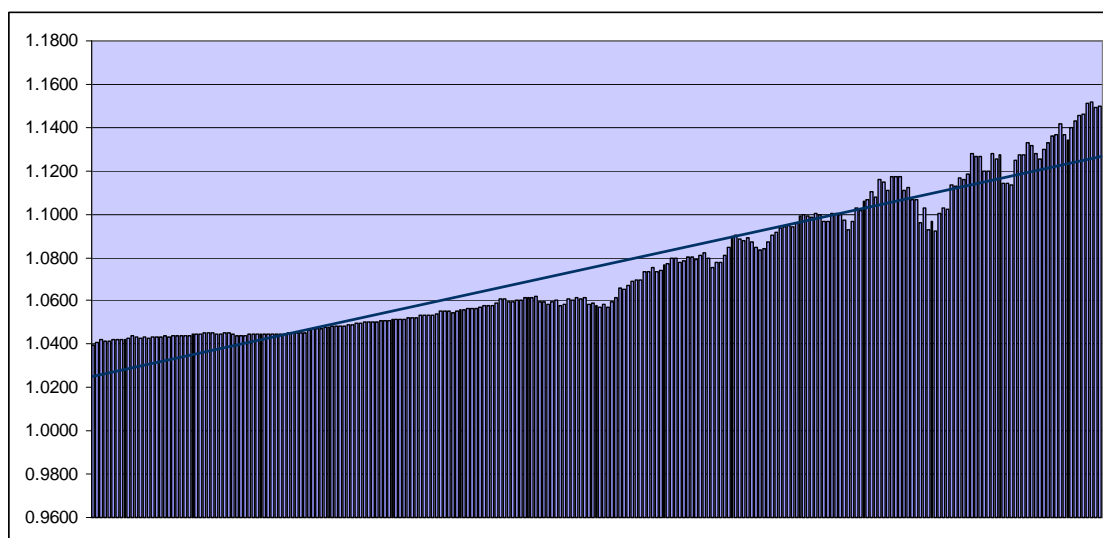
## XI. KITA INFORMACIJA

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

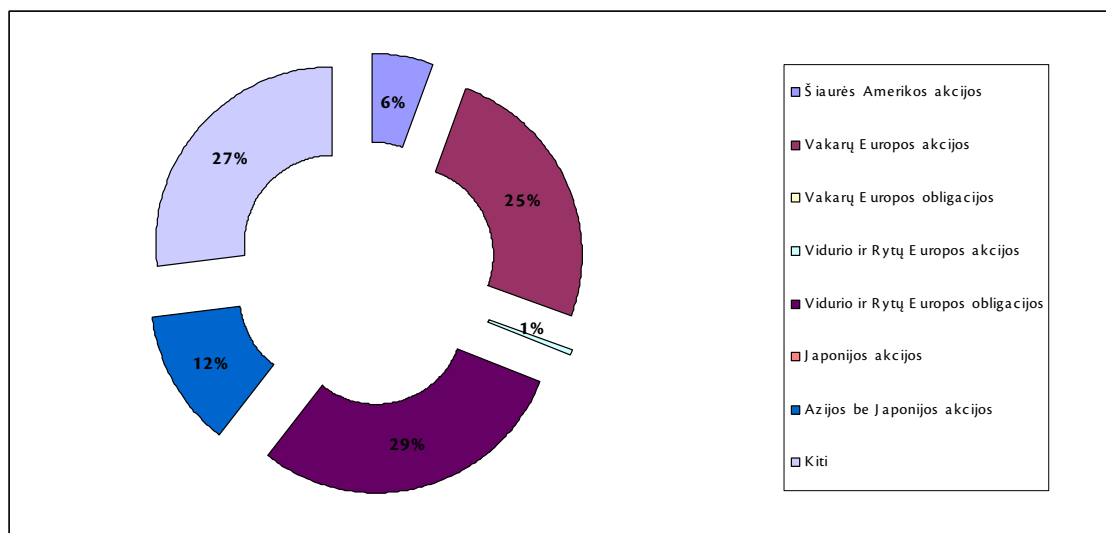
Pateikiamas grynyjų aktyvų vertės kitimo grafikas per 2009 metus bei jų tendencijos



Pateikiamas pensijų fondo vertės kitimo grafikas per 2009 metus bei jų tendencijos



Pateikiami pensijų fondo investicijų portfelio struktūra pagal regionus  
2009 metų pabaigai



## XII. ATSAKINGI ASMENYS

33. Konsultantų, kurių paslaugomis buvo naudotasi rengiant ataskaitą (finansų maklerio įmonės, auditoriai, kt.), vardai, pavardės (juridinių asmenų pavadinimai), adresai, leidimo verstis atitinkama veikla pavadinimas ir numeris.

**Nebuvo.**

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 valdymo įmonės veiklos rezultatų vertinimui.**

**Generalinis direktorius** \_\_\_\_\_ **Ramūnas Stankevičius**  
**Vyr. buhalterė** \_\_\_\_\_ **Dovilė Bajalienė**

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);

**Ramūnas Stankevičius, Generalinis direktorius, (8 37) 719302, 719562, [r.stankevicius@mppf.lt](mailto:r.stankevicius@mppf.lt)**

**Dovilė Bajalienė, Vyr. buhalterė, (8 37) 719302, 719562, [d.bajaliene@mppf.lt](mailto:d.bajaliene@mppf.lt)**

36.2. jeigu ataskaitą rengia konsultantai arba ji rengiama padedant konsultantams, nurodyti konsultantų vardus, pavardes, telefonų ir faksų numerius, el. pašto adresus (jeigu konsultantas yra juridinis asmuo, nurodyti jo pavadinimą, telefonų ir faksų numerius, el. pašto adresą bei konsultanto atstovo(-ų) vardą, pavardę); pažymėti, kokias konkrečias dalis rengė konsultantai arba kokios dalys parengtos jiems padedant, ir nurodyti konsultantų atsakomybės ribas.

**IV. PRANEŠIMAS APIE PENSIJŲ FONDŲ PASISKIRSTYMĄ PAGAL INVESTICINES PRIEMONES**  
Investicijų pasiskirstymas pagal investicijas į Lietuvos ir kitų šalių investicines priemones

Eil. Nr.	Investicinės priemonės	Vertė, Lt
1.	Nuosavybės vertybiniai popieriai	109 800
1.1.	Rezidentai	
1.1.1.	Nefinansinės korporacijos (S.11)	109 800
1.1.2.	Finansinės korporacijos (S.12)	
1.1.2.1.	Centrinis bankas (S.121), kitos pinigų finansinės institucijos (S.122)	
1.1.2.2.	Draudimo korporacijos ir pensijų fondai (S.125)	
1.1.2.3.	Kiti finansiniai tarpininkai, išskyrus draudimo korporacijas ir pensijų fondus (S.123), finansinės pagalbinės įmonės (S.124)	
1.2.	Ne rezidentai	
2.	Ne nuosavybės vertybiniai popieriai	6 423 761
2.1.	Rezidentai	
2.1.1.	Valdžios sektorius (S.13)	6 423 761
2.1.2.	Nefinansinės korporacijos (S.11)	
2.1.3.	Finansinės korporacijos (S.12)	
2.2.	Ne rezidentai	
3.	Kolektyvinio investavimo subjektų investiciniai vienetai (akcijos)	10 863 481
3.1.	Rezidentai	
3.2.	Ne rezidentai	10 863 481
4.	P pinigų rinkos priemonės	0
4.1.	Rezidentai	
4.1.1.	Valdžios sektorius (S.13)	
4.1.2.	Nefinansinės korporacijos (S.11)	
4.1.3.	Finansinės korporacijos (S.12)	
4.2.	Ne rezidentai	
5.	Indėliai kredito įstaigose	4 220 052
5.1.	Rezidentai	4 220 052
5.2.	Ne rezidentai	
6.	Išvestinės finansinės priemonės	0
6.1.	Rezidentai	
6.1.1.	Valdžios sektorius (S.13)	
6.1.2.	Nefinansinės korporacijos (S.11)	
6.1.3.	Finansinės korporacijos (S.12)	
6.2.	Ne rezidentai	
7.	Pinigai	259 663
7.1.	Rezidentai	259 663
7.2.	Ne rezidentai	
8.	Nekilnojamasis turtas	0
8.1.	Lietuvoje	
8.2.	Užsienyje	
9.	Kitos investicijos	0
9.1.	Rezidentai	
9.1.1.	Valdžios sektorius (S.13)	
9.1.2.	Nefinansinės korporacijos (S.11)	
9.1.3.	Finansinės korporacijos (S.12)	

## V. PRANEŠIMAS APIE PENSIJŲ FONDŲ INVESTICIJŲ PASISKIRSTYMĄ PAGAL VALIUTAS IR GEOGRAFINĘ ZONĄ

Investicijų pasiskirstymas pagal valiutas ir geografinę zoną

Investicijų pasiskirstymas	Rinkos vertė	Dalis aktyvuose (%)	Rinkos vertė ataskaitinio laikotarpio pradžioje	Dalis aktyvuose ataskaitinio laikotarpio pradžioje (%)
<b>Pagal valiutas:</b>				
litas	4329852	19.79%	1673649	54.76%
eurais	12900594	58.97%	1383475	45.27%
kita valiuta	4646311	21.24%		
Iš viso	21876757	100%	3057124	100%
<b>Pagal geografinę zoną:</b>				
Lietuva	11013276	50.34%	3057124	100%
kitos Europos Sąjungos valstybės	8381728	38.31%		
kitos Europos ekonominės erdvės valstybės (Islandija, Norvegija, Lichtenšteinas)	1263532	5.78%		
Jungtinės Amerikos Valstijos ir Kanada	1218221	5.57%		
Japonija				
kitos šalys				
Iš viso	21876757	100.00%	3057124	100%