

TIKSLINĖS PENSIJŲ FONDŲ DALYVIŲ GRUPĖS

INVL PENSIJA 1961-1967 INDEX PLUS PENSIJŲ FONDAS

2024 METŲ SAUSIO - BIRŽELIO ATASKAITA

I. BENDROJI INFORMACIJA

1. Duomenys apie pensijų fondą, valdymo įmonę ir depozitoriumą

| | |
|---|--|
| Pavadinimas | INVL pensija 1961-1967 Index Plus (toliau - Fondas arba Pensijų fondas) |
| Teisinė forma | valstybinio socialinio draudimo įmokos dalies dalyvio lėšomis mokamos pensijų įmokos ir iš valstybės biudžeto lėšų už dalyvį mokamos pensijų įmokos kaupimo pensijų fondas |
| Lietuvos banko valdybos nutarimu patvirtintos taisyklės | 2018 m. rugsėjo 19 d. nutarimu Nr. 03-160 |
| Veiklos pradžia | 2019 m. sausio 2 d. |
| Veiklos laikas | Neterminuota |

Duomenys apie valdymo įmonę

| | |
|---|---|
| Pavadinimas | UAB „SB Asset Management“ |
| Įmonės kodas | 306241274 |
| Buveinė (adresas) | Gynėjų g. 14, LT-01109 Vilnius |
| Registras, kuriame kaupiami ir saugomi duomenys apie įmonę | Valstybės įmonės Registrų centro Vilniaus filialas |
| Telefono numeris | +370 5 268 2800 |
| El. pašto adresas | info@sb.lt |
| Interneto svetainės adresas | www.sb.lt |
| Veiklos licencijos numeris | 22 |
| Pensijų fondo valdytojas, kiti asmenys priimančius investicinius sprendimus | Audrius Matikiūnas – Investicijų komiteto narys; Vygandas Jūras – Investicijų komiteto narys; Vaidotas Rūkas – Investicijų komiteto narys; Regimantas Valentonis - Investicijų valdymo skyriaus vadovas; Dainius Bložė - Akcijų ir KIS komandos vadovas; Kasparas Subačius - Obligacijų komandos vadovas; Arvydas Jacikevičius - Fondų valdytojas; Jonas Akelis - Jaunesnysis Fondų valdytojas. |

Duomenys apie depozitoriumą

| | |
|-------------------|--|
| Pavadinimas | AB SEB bankas |
| Įmonės kodas | 112021238 |
| Buveinė (adresas) | Konstitucijos pr. 24, LT-08105 Vilnius |
| Telefono numeris | (8~5) 268 28 00 |

2. Duomenys apie pensijų fondą laikotarpio pabaigoje

2.1-2.4. Gryniesi aktyvai, investiciniai vienetai ir vertė, dalyvių skaičius

| | Ataskaitinio laikotarpio pradžioje (2024-01-01) | Ataskaitinio laikotarpio pabaigoje (2024-06-30) | Prieš metus (2023-06-30) |
|------------------------------|---|---|--------------------------|
| Grynųjų aktyvų vertė, Eur | 122 833 053 | 131 422 639 | 114 611 502 |
| Apskaitos vieneto vertė, Eur | 1,2937 | 1,3560 | 1,2282 |
| Dalyvių skaičius | 17 538 | 17 378 | 17 836 |

2.5. Dalyviams taikomi mokesčiai

2024 m. sausio – birželio

| Atskaitymai | Standartinėse taisyklėse numatyti maksimalūs dydžiai, proc. | Faktiškai taikomi atskaitymų dydžiai, proc. | Per ataskaitinį laikotarpį priskaičiuota atskaitymų suma, Eur |
|--|---|---|---|
| Nuo turto vertės | 0,50 | 0,50 | 312 941 |
| Už keitimą | - | - | - |
| <i>fondo keitimas toje pačioje bendrovėje dažniau kaip kartą per metus</i> | 0,05 | - | - |
| <i>pensijų kaupimo bendrovės keitimas kartą per metus</i> | 0,05 | - | - |
| <i>pensijų kaupimo bendrovės keitimas dažniau kaip kartą per metus</i> | 0,05 | - | - |
| Iš viso | | | 312 941 |

2023 m. sausio – birželio

| Atskaitymai | Standartinėse taisyklėse numatyti maksimalūs dydžiai, proc. | Faktiškai taikomi atskaitymų dydžiai, proc. | Per ataskaitinį laikotarpį priskaičiuota atskaitymų suma, Eur |
|--|---|---|---|
| Nuo turto vertės | 0,50 | 0,50 | 278 630 |
| Už keitimą | - | - | - |
| <i>fondo keitimas toje pačioje bendrovėje dažniau kaip kartą per metus</i> | 0,05 | - | - |
| <i>pensijų kaupimo bendrovės keitimas kartą per metus</i> | 0,05 | - | - |
| <i>pensijų kaupimo bendrovės keitimas dažniau kaip kartą per metus</i> | 0,05 | - | - |
| Iš viso | | | 278 630 |

II. INVESTAVIMO STRATEGIJOS APRAŠYMAS

3.1.-3.2. Investavimo tikslas ir fondo paskirtis

Pensijų fondo investavimo tikslas yra sukaupti dalyviui kuo didesnę pinigų sumą išėjimo į pensiją datai, atsižvelgiant į tipinio vidutinio dalyvio rizikos tolerancijos lygį ir kitus dalyvį apibūdinančius veiksnius, tokius kaip įmokų dydis, sukauptą sumą, likusį kaupimo pensijų fonde trukmė, galima pensijų išmokų rūšis, tikėtina gyvenimo trukmė ir kita.

3.3. Rizikingų ir mažiau rizikingų aktyvų proporcijos pagal investavimo strategiją ir faktinius duomenis

Fondo investavimo strategija kinta pagal dalyvių, kuriems skirtas šis fondas, amžių. Tuo metu, kai šie dalyviai yra jaunesni, fondas daugiau investuoja į rizikingas turto klases, o fondo dalyvių amžiai artėjant link pensinio amžiaus ir siekiant apsaugoti sukauptą sumą, mažiau rizikingų turto klasių dalis didėja.

Daugiau informacijos apie rizikingų ir mažiau rizikingų aktyvų proporcijas pagal investavimo strategiją pateikiama valdymo įmonės tinklalapyje <https://www.sb.lt/lt/privatiems/pensijos/ii-pakopos-pensiju-fondai/dokumentai/investavimo-strategijos>

3.4. Informacija, susijusi su tvarumu

„Pagal Europos Parlamento ir Tarybos reglamento (ES) 2019/2088 dėl su tvarumu susijusios informacijos atskleidimo finansinių paslaugų sektoriuje (toliau – „SFDR“) ir Europos Parlamento ir Tarybos reglamento (ES) 2020/852 dėl sistemos tvariam investavimui palengvinti sukūrimo (toliau – „Taksonomija“) finansinis produktas (pensijų fondas) skatina aplinkos ir/ar socialinius ypatumus, tačiau neturi tvarių investicijų tikslo, todėl atskleidžia informaciją pagal SFDR 8 straipsnį. Priimant investavimo sprendimus, pensijų fondas atsižvelgė į investavimo sprendimų neigiamą poveikį (angl. principal adverse impacts) tvarumo veiksniams, kaip tai apibrėžta SFDR. Pagal SFDR nuostatas, pensijų fondas atskleidžia informaciją, susijusią su tvarumo reikalavimų integravimu, ikisutartinės informacijos dokumente. Informacija apie tai, kaip buvo siekiama skatinti aplinkos ir/ar socialinius ypatumus bei rodiklius, nustatytus su tvarumu susijusios finansinės informacijos atskleidimo reglamento techniniuose reguliavimo standartuose, yra pateikta 2023 metų pensijų fondo ataskaitoje.

3.5. Kita Fondo dalyviams svarbi informacija

2024 m. birželio 30 d. GRYNŲJŲ AKTYVŲ ATASKAITA

| Eil. Nr. | Turtas | Ataskaitinis laikotarpis | Praėję finansiniai metai (2023-12-31) |
|----------|---|--------------------------|--|
| A. | TURTAS | 133 834 044 | 122 931 360 |
| 1. | PINIGAI | 3 081 802 | 3 463 475 |
| 2. | TERMINUOTIEJI INDĖLIAI | - | - |
| 3. | PINIGŲ RINKOS PRIEMONES | - | - |
| 3.1. | Valstybės išdo vekseliai | - | - |
| 3.2. | Kitos pinigų rinkos priemonės | - | - |
| 4. | PERLEIDŽIAMIEJI VERTYBINIAI POPIERIAI | 129 565 593 | 119 376 257 |
| 4.1. | Ne nuosavybės vertybiniai popieriai | 76 033 515 | 67 310 323 |
| 4.1.1. | Vyriausybių ir centrinių bankų arba jų garantuoti ne nuosavybės vertybiniai popieriai | 41 705 943 | 37 221 781 |
| 4.1.2. | Kiti ne nuosavybės vertybiniai popieriai | 34 327 572 | 30 088 542 |
| 4.2. | Nuosavybės vertybiniai popieriai | 2 666 874 | 2 688 044 |
| 4.3. | Kitų kolektyvinio investavimo subjektų investiciniai vienetai ir akcijos | 50 865 204 | 49 377 890 |
| 5. | SUMOKĖTI AVANSAI | - | - |
| 6. | GAUTINOS SUMOS | 1 186 649 | 4 789 |
| 6.1. | Investicijų pardavimo sandorių gautinos sumos | 1 186 580 | - |
| 6.2. | Kitos gautinos sumos | 69 | 4 789 |
| 7. | INVESTICINIS IR KITAS TURTAS | - | 86 839 |
| 7.1. | Investicinis turtas | - | - |
| 7.2. | Išvestinės finansinės priemonės | - | 86 839 |
| 7.3. | Kitas turtas | - | - |
| B. | ĮSIPAREIGOJIMAI | 2 411 405 | 98 307 |
| 1. | Mokėtinos sumos | 2 356 216 | 98 307 |
| 1.1. | Už finansinį ir investicinį turtą mokėtinos sumos | 2 250 310 | - |
| 1.2. | Valdymo įmonei ir depozitoriumui mokėtinos sumos | 49 245 | 45 828 |
| 1.3. | Kitos mokėtinos sumos | 56 661 | 52 479 |
| 2. | Sukauptos sąnaudos | - | - |
| 3. | Finansinės skolos kredito įstaigoms | - | - |
| 4. | Įsipareigojimai pagal išvestinių finansinių priemonių sutartis | 55 189 | - |
| 5. | Kiti įsipareigojimai | - | - |
| C. | GRYNIEJI AKTYVAI | 131 422 639 | 122 833 053 |

2024 M. SAUSIO – BIRŽELIO GRYNŲJŲ AKTYVŲ POKYČIŲ ATASKAITA

| Eil. Nr. | Straipsniai | Ataskaitinis laikotarpis | Praėjęs ataskaitinis laikotarpis |
|----------|--|--------------------------|----------------------------------|
| 1. | GRYNŲJŲ AKTYVŲ VERTĖ ATASKAITINIO LAIKOTARPIO PRADŽIOJE | 122 833 053 | 105 654 871 |
| 2. | GRYNŲJŲ AKTYVŲ VERTĖS PADIDĖJIMAS | | |
| 2.1. | Dalyvių įmokos į fondą | 5 235 024 | 4 887 294 |
| 2.2. | Iš kitų fondų gautos sumos | 3 288 408 | 2 928 960 |
| 2.3. | Garantinės įmokos | - | - |
| 2.4. | Investicinės pajamos | 207 630 | 137 305 |
| 2.4.1. | Palūkanų pajamos | 33 997 | 8 333 |
| 2.4.2. | Dividendai | 173 633 | 128 972 |
| 2.4.3. | Nuomos pajamos | - | - |
| 2.5. | Pelnas dėl investicijų vertės pasikeitimo ir pardavimo | 6 963 545 | 5 523 621 |
| 2.6. | Pelnas dėl užsienio valiutos kursų pokyčio | 3 632 | 836 |
| 2.7. | Išvestinių finansinių priemonių sandorių pelnas | - | 43 659 |
| 2.8. | Kitas grynųjų aktyvų vertės padidėjimas | 88 764 | 97 722 |
| | GRYNŲJŲ AKTYVŲ VERTĖ PADIDĖJO IŠ VISO: | 15 787 003 | 13 619 397 |
| 3. | GRYNŲJŲ AKTYVŲ VERTĖS SUMAŽĖJIMAS | - | - |
| 3.1. | Išmokos fondo dalyviams | 135 482 | 106 281 |
| 3.2. | Išmokos kitiems fondams | 5 780 107 | 3 782 879 |
| 3.3. | Nuostoliai dėl investicijų vertės pasikeitimo ir pardavimo | 753 892 | 486 318 |
| 3.4. | Nuostoliai dėl užsienio valiutos kursų pokyčio | 2 172 | 8 658 |
| 3.5. | Išvestinių finansinių priemonių sandorių nuostoliai | 179 884 | - |
| 3.6. | Valdymo sąnaudos: | 345 880 | 278 630 |
| 3.6.1. | Atlyginimas valdymo įmonei | 312 941 | 278 630 |
| 3.6.2. | Atlyginimas depozitoriumui | - | - |
| 3.6.3. | Atlyginimas tarpininkams | - | - |
| 3.6.4. | Audito sąnaudos | - | - |
| 3.6.5. | Palūkanų sąnaudos | - | - |
| 3.6.6. | Kitos sąnaudos | 32 939 | - |
| 3.7. | Kitas grynųjų aktyvų vertės sumažėjimas | - | - |
| 3.8. | Sąnaudų kompensavimas (-) | - | - |
| | GRYNŲJŲ AKTYVŲ VERTĖ SUMAŽĖJO IŠ VISO: | 7 197 417 | 4 662 766 |
| 4. | Grynųjų aktyvų vertės pokytis | 8 589 586 | 8 956 631 |
| 5. | Pelno paskirstymas | - | - |
| 6. | GRYNŲJŲ AKTYVŲ VERTĖ ATASKAITINIO LAIKOTARPIO PABAIGOJE | 131 422 639 | 114 611 502 |

III. INVESTICIJŲ GRĄŽA, LYGINAMASIS INDEKSAS IR RIZIKOS RODIKLIAI
4. Lyginamasis indeksas ir trumpas jo apibūdinimas

Nuo 2019 m. sausio 2 d. Fondas naudojo lyginamąjį indeksą, kurį sudarė: 51,44% MSCI ACWI IMI Net Total Return USD Index (MIMUAWON Index) (perskaičiuotas į EUR) + 4,62% MSCI Emerging Markets Net Total Return USD Index (M1EF Index) (perskaičiuotas į EUR) + 3,00% EONIA Total Return Index (DBDCONIA Index) + 8,19% Bloomberg Barclays SeriesE Euro Govt 3-5 Yr Bond Index (BERPG2 Index) + 8,19% Bloomberg Barclays EuroAgg Corporate 3-5 Year TR Index Value (LEC3TREU Index) + 8,19% J.P. Morgan Euro Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified Europe (JPEFEUR Index) + 8,19% J.P. Morgan Corporate Emerging Markets Bond Index (CEMBI) Broad Europe Index (JCBBEURO Index) apdraudžiant Bloomberg USDEUR 6 Month Hedging Cost Index (FXHCUE6M Index) + 8,19% J.P. Morgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Hedged Euro Index (JPEIGHEU Index).

Nuo 2021 m. kovo 1 d. Fondas naudojo lyginamąjį indeksą, kurį sudarė: 41,32% MSCI ACWI IMI Net Total Return USD Index (MIMUAWON Index) (perskaičiuotas į EUR) + 3,71% MSCI Emerging Markets Net Total Return USD Index (M1EF Index) (perskaičiuotas į EUR) + 3,00% European Central Bank ESTR OIS Index (OISESTR Index) + 10,66% Bloomberg Barclays SeriesE Euro Govt 3-5 Yr Bond Index (BERPG2 Index) + 10,66% Bloomberg Barclays EuroAgg Corporate 3-5 Year TR Index Value (LEC3TREU Index) + 10,65% J.P. Morgan Euro Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified Europe (JPEFEUR Index) + 10,00% J.P. Morgan Corporate Emerging Markets Bond Index (CEMBI) Broad Europe Index (JCBBEURO Index) apdraudžiant Bloomberg USDEUR 6 Month Hedging Cost Index (FXHCUE6M Index) + 10,00% J.P. Morgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Hedged Euro Index (JPEIGHEU Index).

Nuo 2022 m. kovo 22 d. Fondas naudojo lyginamąjį indeksą, kurį sudarė: 36,34% MSCI ACWI IMI Net Total Return USD Index (MIMUAWON Index) (perskaičiuotas į EUR) + 3,27% MSCI Emerging Markets Net Total Return USD Index (M1EF Index) (perskaičiuotas į EUR) + 3,00% European Central Bank ESTR OIS Index (OISESTR Index) + 12,47% Bloomberg Barclays SeriesE Euro Govt 3-5 Yr Bond Index (BERPG2 Index) + 12,46% Bloomberg Barclays EuroAgg Corporate 3-5 Year TR Index Value (LEC3TREU Index) + 12,46% J.P. Morgan Euro Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified Europe (JPEFEUR Index) + 10,00% Bloomberg Pan-European High Yield (Euro) TR (I02501EU Index) + 10,00% J.P. Morgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Hedged Euro Index (JPEIGHEU Index).

Nuo 2023 m. lapkričio 30 d. Fondas naudojo lyginamąjį indeksą, kurį sudarė: 27,06% MSCI World IMI Net Total Return USD Index (perskaičiuotas į EUR) (M1WOIM Index) + 3,82% MSCI Emerging Markets ex China Net Total Return USD Index (perskaičiuotas į EUR) (M1CXBRV Index) + 3% European Central Bank ESTR OIS Index (OISESTR Index) + 15,37% Bloomberg Barclays Series-E Euro Govt 3-5 Yr Bond Index (BERPG2 Index) + 15,37% Bloomberg Barclays EuroAgg Corporate 3-5 Yr Total Return Index (LEC3TREU Index) + 15,37% Bloomberg Pan Euro EM: Europe Total Return Index Unhedged EUR (I04339EU Index) + 10% Bloomberg Pan-European High Yield (Euro) TR Index (I02501EU Index) + 10% Bloomberg EM USD Aggregate: Sovereign Total Return Index Hedged EUR(H12875EU Index).

5. Fondo ir lyginamojo indekso vidutinė metinė grąža skirtingais laikotarpiais (%)

| | Per 6 mėn. | Per 1 metus | Per 3 metus | Per 5 metus | Per 10 metų | Nuo įsteigimo dienos |
|--|------------|-------------|-------------|-------------|-------------|----------------------|
| Vidutinė pensijų fondo grąža ¹ , proc. | 5,00 | 10,41 | 2,00 | 6,28 | - | 5,72 |
| Vidutinė lyginamojo indekso grąža ² , proc. | 4,98 | 11,09 | (0,46) | 5,37 | - | 4,89 |
| Apskaitos vieneto vertės pokyčio standartinis nuokrypis ³ , proc. | 3,66 | 3,66 | 4,93 | 7,25 | - | 7,24 |

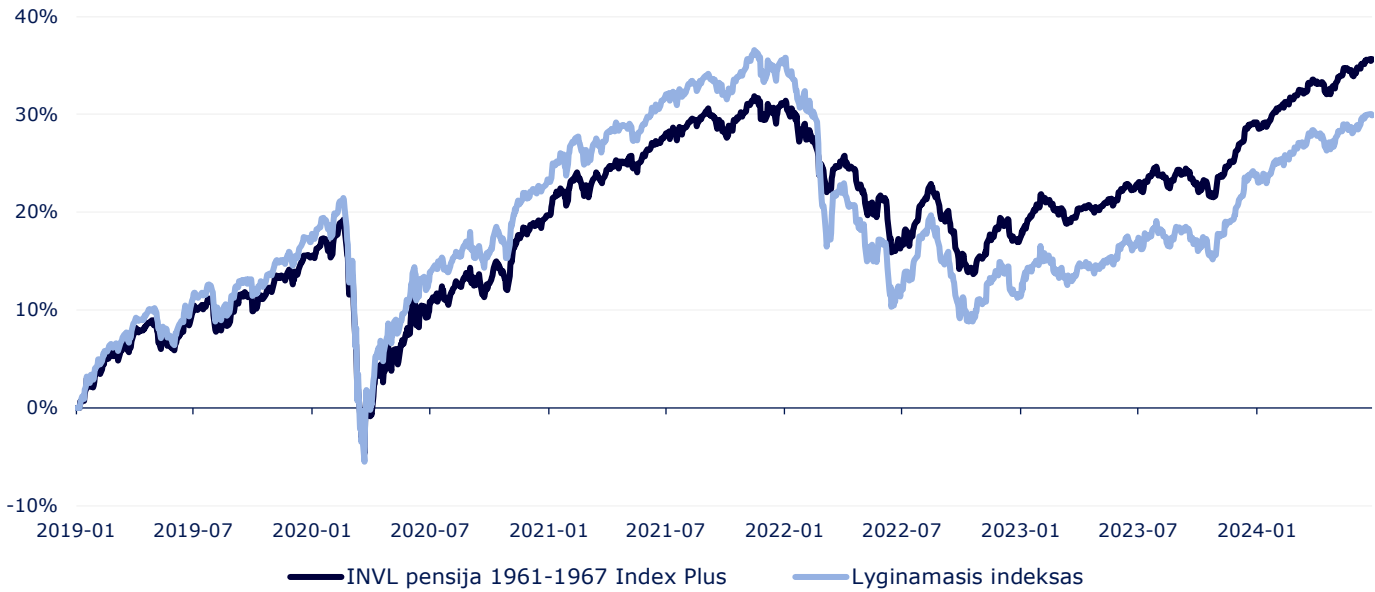
¹ Vidutinė pensijų fondo grąža – tai geometrinis metinių apskaitos vieneto vertės pokyčių vidurkis.

² Vidutinė lyginamojo indekso grąža – tai geometrinis metinių apskaitos vieneto vertės pokyčių vidurkis.

³ Apskaitos vieneto vertės pokyčio standartinis nuokrypis – tai metinis apskaitos vieneto vertės pokyčio standartinis nuokrypis už nurodytą laikotarpį.

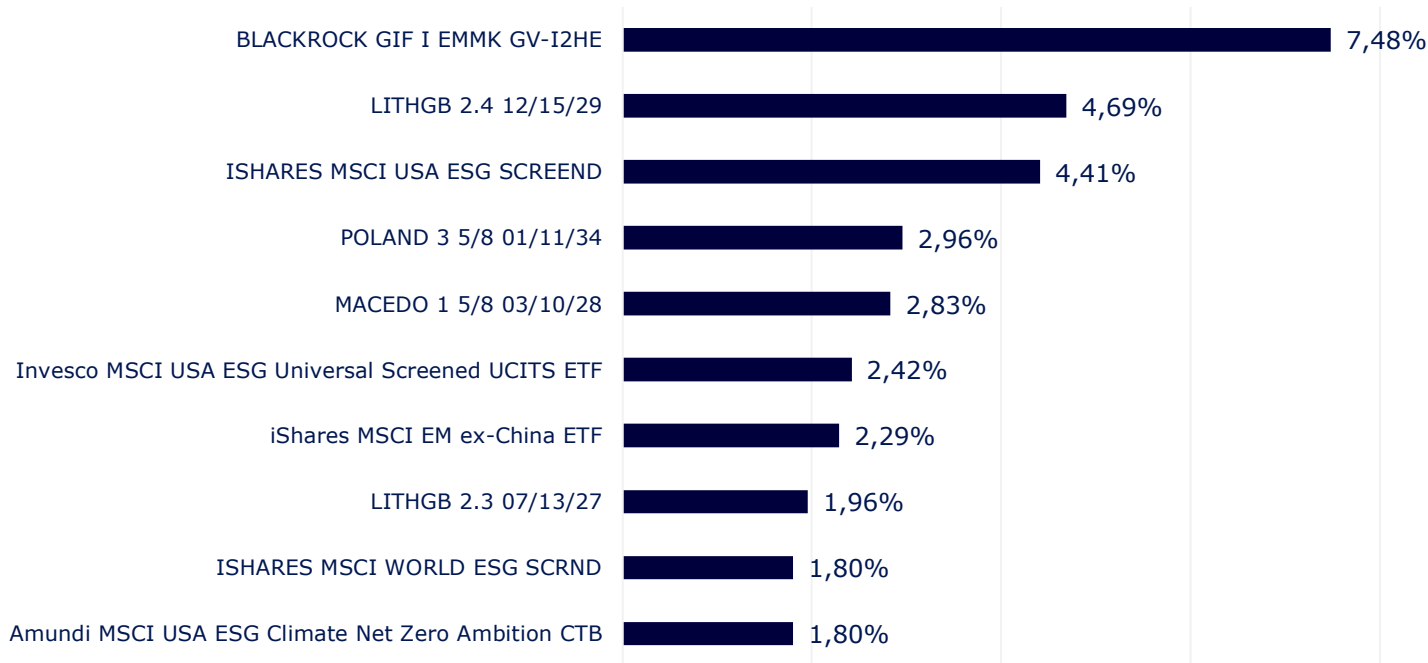
Pastaba: Fondo praeities rezultatai negarantuoja tokių pačių rezultatų ir pelningumo ateityje.

6. Apskaitos vieneto verčių ir lyginamojo indekso reikšmių dinamika nuo Fondo įsteigimo dienos



IV. INFORMACIJA APIE INVESTICINIŲ PRIEMONIŲ PORTFELIO SUDĖTĮ

7. Investicinių priemonių portfelio sudėtis ataskaitinio laikotarpio pabaigoje

TOP 10 investicijų (proc. dalis aktyvuose)


Daugiau informacijos apie investicinių priemonių portfelio pasiskirstymą pateikiama ketvirtinėse apžvalgose: <https://www.sb.lt/lt/privatiems/pensijos/ii-pakopos-pensiju-fondai/dokumentai/apzvalgos>

8. Valdytojo komentaras, kas lėmė Fondo investicinių priemonių portfelių gražos pokyčius per ataskaitinį laikotarpį
 Fondo investicinių priemonių portfelio gražai didžiausią įtaką turėjo finansinių priemonių rinkos kainos.

V. INFORMACIJA APIE GARANTIJŲ REZERVĄ

9. Jeigu pensijų fondo taisyklėse yra įsipareigojimas garantuoti tam tikrą pajamingumą, nurodomas garantuojamo pajamingumo dydis
 Fondo taisyklėse nėra įsipareigojimo garantuoti tam tikrą pajamingumą

VI. KITA INFORMACIJA

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

Informacija apie Fondo rezultatus, Fondo taisyklės, ataskaitos, apžvalgos ir kita svarbi informacija pateikta valdymo įmonės tinklalapyje www.sb.lt.

VII. ATSAKINGIEJI ASMENYS

11. Ataskaitą parengusių asmenų vardai, pavardės, pareigos, darbovietė (jeigu ataskaitą rengę asmenys nėra bendrovės darbuotojai)
 Ataskaitas parengė valdymo įmonės darbuotojai.

12. Fondo valdytojo vadovo parašas

UAB „SB Asset Management“ direktorius Vaidotas Rūkas