

PENSIJU PLĀNS DAUGAVA



IEGULDĪJUMU PĀRVALDES SABIEDRĪBA

Līdzekļu pārvaldītājs - AS "LVA ieguldījumu pārvaldes sabiedrība"

Juridiskā adrese – Blaumaņa iela 11/13-9, Rīga, LV-1011

Valsts fondēto pensiju shēmas līdzekļu ieguldījumu plāns "DAUGAVA"

LĪDZEKĻU PĀRVALDĪTĀJA ZIŅOJUMS

par 2006. gada II. ceturkšņa rezultātiem

VISPĀRĒJĀ INFORMĀCIJA

Plāna pārvaldnieks: Ģirts Veģeris
Turētājbanka: AS "Parex Banka"
Plāna darbības sākums: 2003.gada 21.janvāris
Atlīdzība par pārvaldīšanu: maks. 1.375% gadā

Līdzekļi tiek ieguldīti valstu, pašvaldību, starptautisko finanšu institūciju emitētajos vai garantētajos parāda vērtspapīros, komercsabiedrību parāda vērtspapīros un termiņnoguldījumos kredītiestādēs. Plāna līdzekļi var tikt ieguldīti arī ieguldījumu fondos, kuri drīkst veikt ieguldījumus tikai augstāk minētajos finanšu instrumentos. Plāna ieguldījumu politika paredz veikt ieguldījumus gan Latvijā, gan ārvalstīs.

PLĀNA DAĻAS UN PLĀNA LĪDZEKĻU VĒRTĪBA

	30.06.2006	31.03.2006
Ieguldījumu plāna daļas vērtība (LVL)	1.1850715	1.1838578
Ieguldījumu plāna līdzekļu vērtība (LVL)	852 317	813 202

IEGULDĪJUMU PLĀNA DAĻAS PIEAUGUMS

	3 mēn.	6 mēn.	12 mēn*	Kopš darbības sākuma*
IP DAUGAVA	0.10	0.75	3.00	5.06
Nozares vidējais	-0.35	-0.47	0.76	n/a

* vidējais svērtais (pēc aktīvu vērtības) ienesīgums % gadā

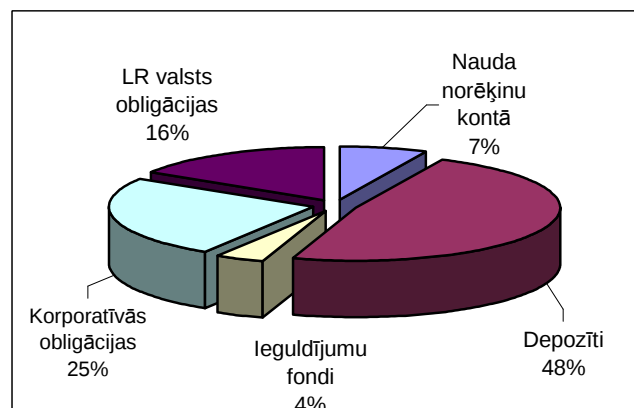
10 LIELĀKIE IEGULDĪJUMI

Ieguldījums	Valūta	Dzēšanas datums	Īpatsvars, %
LR 10g obligācijas	LVL	02.04.2014	9.71%
Q-VARA obligācijas	EUR	12.01.2009	8.83%
LR 10g obligācijas	LVL	14.02.2013	6.22%
LHVB ķīlu zīmes	LVL	15.08.2013	6.03%
Parex Austrumeiropas obligāciju fonds	USD		4.21%
AK Baltikums obligācijas	LVL	20.04.2009	4.18%
Parex banka obligācijas	LVL	05.05.2011	4.06%
Depozīts (Reģionālā Investīciju Banka)	LVL	13.06.2008	3.52%
Depozīts (Parex banka)	LVL	21.03.2010	3.17%
Depozīts (Latvijas Krājbanka)	LVL	25.11.2007	3.00%

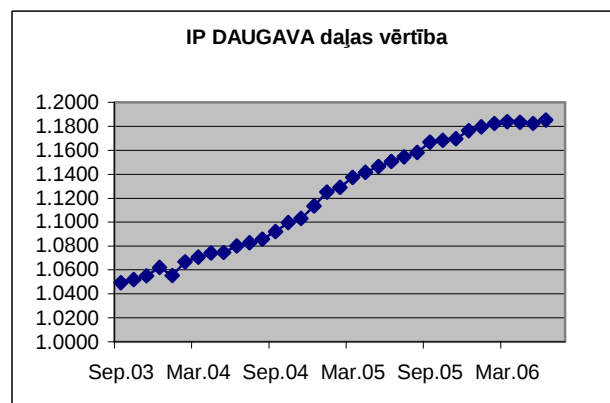
IEGULDĪJUMU POLITIKA

Plāna "DAUGAVA" ieguldījumu politika ir konservatīva, tās mērķis - nodrošināt plāna dalībniekiem stabilus ienākumus pie zemas ieguldījumu riska pakāpes.

PLĀNA IEGULDĪJUMU STRUKTŪRA



PLĀNA DAĻAS VĒRTĪBA



LĪDZEKĻU PĀRVALDĪŠANAS IZMAKSAS

Plāna līdzekļu pārvaldīšanas izmaksas pārskata periodā sastādīja 2 870.47 latus, no kuriem atlīdzība pārskata periodā ieguldījumu sabiedrībai – 2 523.44 lati, atlīdzība turētājbankai – 347.03 lati.

PENSIJU PLĀNS DAUGAVA

PĀRVALDĪTĀJA ZIŅOJUMS

Pārskata periodā Plāna ieguldījumu apjoms palielinājās par 4.8 procentiem un sasniedza 852 317 latus, jeb 0.85 procentus no kopējiem 2.līmeņa pensiju plānu līdzekļiem. IP "DAUGAVA" ienesīgums pārskata periodā sastādīja 0.4 procenti gadā, bet par pēdējiem 12 mēnešiem 3.00 procenti gadā (salīdzinošie vidējie rādītāji konservatīvo plānu grupā – attiecīgi -1.40 un 0.76 procenti gadā) .

Salīdzinot ar iepriekšējo ceturksni nav mainījies ieguldījumu īpatsvars termiņnoguldījumos kredītiestādēs, kas sastāda 48% no plāna aktīviem. Latvijas valsts vērtspapīru īpatsvars portfelī ir samazināts līdz 16% no plāna aktīviem (ceturkšņa sākumā 18%), bet korporatīvajos parāda vērtspapīru īpatsvars portfelī ir palielināts līdz 25% (ceturkšņa sākumā 24%). Ieguldījumu īpatsvars ieguldījumu fondos un naudas atlikums norēķinu kontā uz pārskata perioda beigām sastāda attiecīgi 4% un 8% no plāna aktīviem.

Nākamajā ceturksnī pārvaldītājs plāno saglabāt termiņnoguldījumu daļu portfelī 50% robežās, Latvijas valsts vērtspapīru daļu 15-20% robežās, bet korporatīvajos parāda vērtspapīru daļu 20-25% robežās.

Pārskata periodā būtiski palielinājās Latvijas ilgtermiņa obligāciju ienesīguma likmes (vidēji 0.3-0.5 procenti gadā) un attiecīgi samazinājās to cenas. Šo likmju pieaugums negatīvi ietekmēja plāna daļu ienesīgumu, kas pārskata

periodā sasniedza 0.40 procentus gadā. Pārvaldītājs prognozē, ka 2006.gada 3.ceturksnī turpināsies ilgtermiņa % likmju kāpums un apsver iespēju realizēt daļu no ilgtermiņa vērtspapīru portfeļa. Pārvaldnieks prognozē, ka plāna "DAUGAVA" daļas pieaugums varētu būt robežās no 2.0 līdz 3.0 procentiem gadā.

Latvijas valsts parādzīmju ienesīgums 30.06.2006 RFB (% gadā)

Termiņš līdz dzēšanai, mēn.	Pērk, %	Pārdod, %
11m	-	-
44m	-	-
80m	4.12	-
94m	4.35	-
113m	-	-

Uz pārskata perioda beigām salīdzinot ar pārskata perioda sākumu ir palielinājušās RIGIBOR 1, 3, 6 un 12 mēnešu likmes (attiecīgi 1mēneša likme no 2.84% līdz 3.46%, 3 mēnešu likme no 3.84% līdz 4.03%, 6 mēnešu likme no 4.06% līdz 4.31%, bet 12 mēnešu likme no 4.14% līdz 4.40%) . Īstermiņa likmju izmaiņas plāna rezultātus būtiski neietekmē, jo plāna aktīvi tiek izvietoti garāka termiņa finanšu instrumentos.

Pārskats par valsts fondēto pensiju shēmas ieguldījumu plāniem uz 2006.gada 30 jūniju

Ieguldījumu plāni pēc kategorijām	Darbības uzsākšanas datums	Daļas vērtība, Ls 30/06/2006	Ienesība pēdējos				Neto aktīvu vērtība, Ls 30/06/2006
			3 mēn.	6 mēn.	12 mēn*	kopš darbības sākuma*	
Konservatīvie plāni							
Valsts kases ieguldījumu plāns	07.Sep.01	1.2425504	-0.13%	-0.16%	0.96%	4.61%	12 661 026
Astra Krājfondi pensiju plāns "Klasika"	19.Aug.04	1.0846475	-0.31%	-0.01%	1.49%	4.46%	1 686 584
Baltikums konservatīvais ieguldījumu plāns	21.Jan.03	1.1282235	-0.11%	0.01%	1.15%	3.57%	175 651
BTB Konservatīvais plāns	08.Mar.06	0.9999403	0.00%	0.00%	0.00%	-0.02%	265
Hansa pensiju ieguldījumu plāns “Stabilitāte”	07.Jan.03	1.0919032	-0.91%	-1.47%	-0.39%	2.56%	5 862 102
LVAIS “Daugava”	21.Jan.03	1.1850715	0.10%	0.75%	3.00%	5.06%	852 317
"NORD/LB 1" Konservatīvais IP	02.Mar.05	1.0421608	0.06%	0.21%	1.52%	3.16%	107 361
Parex Universālais pensiju plāns	07.Jan.03	1.1590818	-0.60%	-0.80%	0.89%	4.33%	1 679 333
SEB Latvijas plāns (sākot ar 2006)	07.Jan.03	1.1298092	0.44%	0.80%	2.12%	3.57%	440 897
Suprema/EVLI ieguldījumu plāns "Jūrmala"	09.Jan.04	1.0088184	-0.60%	-0.59%	-0.24%	0.36%	7 405
Kopā Konservatīvie plāni			-0.35%	-0.47%	0.76%		23 472 942

* - vidējais svērtais (pēc aktīvu vērtības) ienesīgums, % gadā