

PENSIJU PLĀNS DAUGAVA



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 2005. gada II. ceturkšņa rezultātiem

VISPĀRĒJĀ INFORMĀCIJA

Plāna pārvaldnieks: Ģirts Veģeris
Turētājbanka: AS "Parex Banka"
Plāna darbības sākums: 2003.gada 21.janvārī
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 finansu instrumentos. Plāna ieguldījumu politika paredz veikt ieguldījumus gan Latvijā, gan ārvalstīs.

PLĀNA DAĻAS UN PLĀNA LĪDZEKĻU VĒRTĪBA

	30.06.2005	31.03.2005
Ieguldījumu plāna daļas vērtība (LVL)	1.1505747	1.1373484
Ieguldījumu plāna līdzekļu vērtība (LVL)	662 784	564 459

IEGULDĪJUMU PLĀNA IENESĪGUMS

	3 mēn.	6 mēn.	12 mēn.	Kopš darbības sākuma
Periodā (%)	1.32	3.72	7.06	15.06
Gada procenti*	4.68	6.77	6.44	5.83

* gada ienesīguma likmes tiek aprēķinātas lietojot ACT/360 metodi

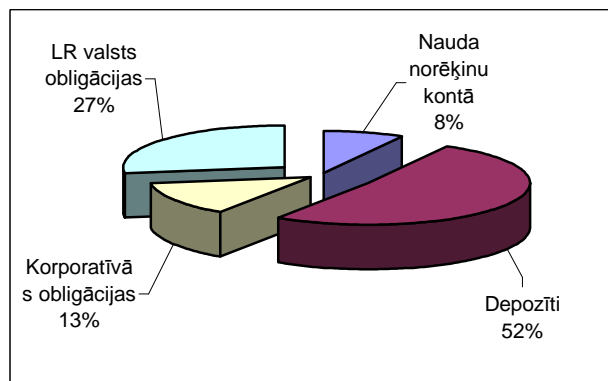
10 LIELĀKIE IEGULDĪJUMI

Ieguldījums	Valūta	Dzēšanas datums	Īpatsvars, %
LR 10g obligācijas	LVL	02.04.2014	13.22%
LR 10g obligācijas	LVL	14.02.2013	10.96%
LHZB ķīlu zīmes	LVL	15.08.2013	7.73%
Termiņnoguldījums (Parex Banka)	LVL	21.03.2010	4.07%
Termiņnoguldījums (Komerbanka Baltikums)	LVL	06.08.2009	3.86%
Obligācijas (Komerbanka Baltikums)	EUR	29.12.2006	3.38%
Termiņnoguldījums (Reģionālā Investīciju Banka)	LVL	09.06.2006	3.18%
Termiņnoguldījums (Trasta Komerbanka)	LVL	09.07.2006	3.10%
LR 5g obligācijas	LVL	08.05.2007	2.85%
Termiņnoguldījums (Krājbanka)	LVL	28.10.2009	2.35%

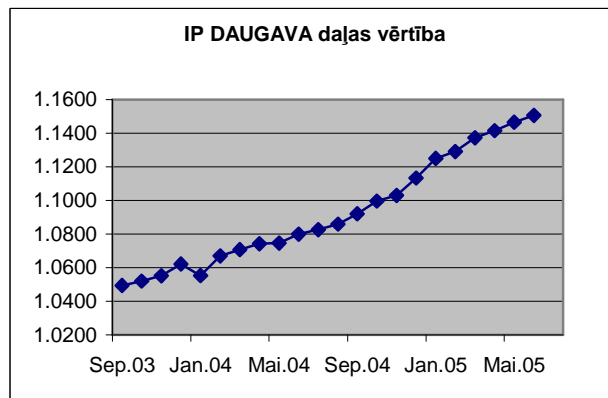
IEGULDĪJUMU POLITIKA

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 2 124.65 latus, no kuriem atlīdzība ieguldījumu sabiedrībai – 1 860.49 lati, atlīdzība turētājbankai – 264.16 lati.

PENSIJU PLĀNS DAUGAVA

PĀRVALDĪTĀJA ZIŅOJUMS

Arī 2005. gada otrajā ceturksnī turpinājās ieguldījumu plāna "Daugava" dalībnieku skaita pieaugums (ceturkšņa beigās 9628, ceturkšņa sākumā 9588). Plāna aktīvu apjoms palielinājās par 17.4 procentiem un sasniedza 662 784 latus, jeb 1.02 procentus no kopējiem 2.līmeņa pensiju plānu līdzekļiem (ceturkšņa sākumā 1.00 procenti). IP Daugava ienesīgums pārskata periodā sastādīja 4.68, bet no darbības sākuma datuma 5.83 procenti gadā, kas ir viens no augstākajiem rādītājiem starp visiem konservatīvajiem 2. līmeņa pensiju plāniem Latvijā.

Salīdzinot ar iepriekšējo ceturksni ir mainījusies plāna ieguldījumu portfeļa struktūra. Ir samazināts ieguldījumu īpatsvars termiņnoguldījumos kredītiestādēs, kas sastāda 52% no plāna aktīviem (ceturkšņa sākumā 60 procenti) un Latvijas valsts vērtspapīros, kas sastāda 27% no plāna aktīviem (ceturkšņa sākumā 32%). IP Daugava ieguldījumu korporatīvajos parāda vērtspapīros īpatsvars ir palielināts līdz 13%(ceturkšņa sākumā 6%), līdzekļi tika izvietoti ar ienesību 4.25 – 5.25 procenti gadā. Naudas atlikums norēķinu kontā uz pārskata perioda beigām sastāda 8% no plāna aktīviem.

Nākamajā ceturksnī pārvaldītājs plāno saglabāt termiņnoguldījumu daļu portfeli 50-55% robežās, Latvijas valsts vērtspapīru daļu 25-30% robežās, bet līdz 15-20% no

plāna līdzekļiem ieguldīt korporatīvajos vērtspapīros. Pārvaldītājs prognozē, ka plāna "Daugava" daļas pieaugums 2005.gada 2.ceturksnī būs robežās no 4.0 līdz 4.5 procentiem gadā.

Pārskata periodā nedaudz turpināja samazināties Latvijas ilgtermiņa obligāciju ienesīguma likmes un attiecīgi palielinājās to cenas. Šo likmju izmaiņas pozitīvi ietekmēja arī plāna daļu ienesīgumu, kas pārskata periodā sasniedza 4.68 procentus gadā.

Latvijas valsts parādzīmju ienesīgums RFB (% gadā)

Termiņš līdz dzēšanai, mēn.	Pērk, %	Pārdod, %
12m	2.45	2.00
22m	2.70	2.50
60m	3.30	3.00
99m	3.50	3.25
106m	3.65	3.35

Pārskata periodā ir arī nedaudz samazinājušās latu īstermiņa likmes. RIGIBOR 1 mēneša likme no 2.78% līdz 2.63%, 3 mēnešu likme – no 2.99% līdz 2.80%, savukārt 6 mēnešu likme samazinājās no 3.19% līdz 2.86%, bet gada likme no 3.30% līdz 3.02%. Īstermiņa likmju izmaiņas plāna rezultātus praktiski neietekmēja, jo plāna aktīvi tiek izvietoti garāka termiņa finansu instrumentos.

Pārskats par valsts fondēto pensiju shēmas ieguldījumu plāniem uz 2005.gada 30.jūniju

Ieguldījumu plāni pēc kategorijām	Darbības uzsākšanas datums	Daļas vērtība, Ls 30/06/2005	ienesīgums, % gadā					Neto aktīvu vērtība, Ls 30/06/2005
			1mēn.	3 mēn.	6 mēn.	12 mēn.	kopš darbības sākuma	

Konservatīvie plāni

Valsts kases ieguldījumu plāns	07.Sep.01	1.2307385	3.44%	4.87%	6.58%	5.97%	5.52%	15 605 056
Hansa pensiju ieguldījumu plāns "Stabilitāte"	07.Jan.03	1.0961510	5.15%	4.31%	4.72%	4.25%	3.72%	3 611 000
Parekss Universālais pensiju plāns	07.Jan.03	1.1488947	7.72%	6.20%	6.59%	6.69%	5.68%	1 637 990
LVA IPS "Daugava"	21.Jan.03	1.1505747	4.50%	4.68%	6.77%	6.44%	5.83%	662 784
Baltikums konservatīvais ieguldījumu plāns	21.Jan.03	1.1153700	2.60%	3.76%	5.37%	4.51%	4.51%	116 311
Suprema/EVLI ieguldījumu plāns "Jūrmala"	09.Jan.04	1.0112385	0.39%	0.48%	0.56%	0.38%	0.75%	2 777
Astra Krājfondi pensiju plāns "Klasika"	19.Aug.04	1.0687198	5.97%	4.70%	6.51%		7.89%	692 882
"NORD/LB 1"	02.Mar.05	1.0265125	4.64%	8.64%			8.17%	13 327
Kopā Konservatīvie plāni *			4.14%	4.86%	6.28%	5.56%		22 342 127
Kopā Sabalansētie plāni *			8.47%	6.18%	7.59%	6.34%		2 800 333
Kopā Aktīvie plāni *			15.74%	9.36%	9.90%	8.63%		39 855 310
KOPĀ visi plāni *			11.44%	7.68%	8.55%	7.48%		64 997 770

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

PENSIJU PLĀNS DAUGAVA