

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 III. 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

PLĀNA DAĻAS UN PLĀNA LĪDZEKĻU VĒRTĪBA

	30.09.2005	30.06.2005
Ieguldījumu plāna daļas vērtība (LVL)	1.1668446	1.1505747
Ieguldījumu plāna līdzekļu vērtība (LVL)	747 675	662 784

IEGULDĪJUMU PLĀNA IENESĪGUMS

	3 mēn.	6 mēn.	12 mēn.	Kopš darbības sākuma
Periodā (%)	1.63	2.95	7.48	16.68
Gada procenti*	5.65	5.17	6.75	5.81

* gada ienesīguma likmes tiek aprēķinātas lietojot ACT/360 metodi

10 LIELĀKIE IEGULDĪJUMI

Ieguldījums	Valūta	Dzēšanas datums	Īpatsvars, %
LR 10g obligācijas	LVL	02.04.2014	11.99%
LR 10g obligācijas	LVL	14.02.2013	9.86%
Obligācijas (Komercbanka Baltikums)	EUR	29.12.2006	7.79%
LHZB ķīlu zīmes	LVL	15.08.2013	6.92%
Parex Austrumeiropas obligāciju fonds	USD	06.08.2009	4.93%
Termiņnoguldījums (Parex banka)	LVL	21.03.2010	3.38%
Termiņnoguldījums (Komercbanka Baltikums)	LVL	06.08.2009	3.37%
Termiņnoguldījums (Reģionālā Investīciju Banka)	LVL	09.06.2006	2.86%
Termiņnoguldījums (Trasta Komercbanka)	LVL	09.07.2006	2.71%
LR 5g obligācijas	LVL	08.05.2007	2.54%

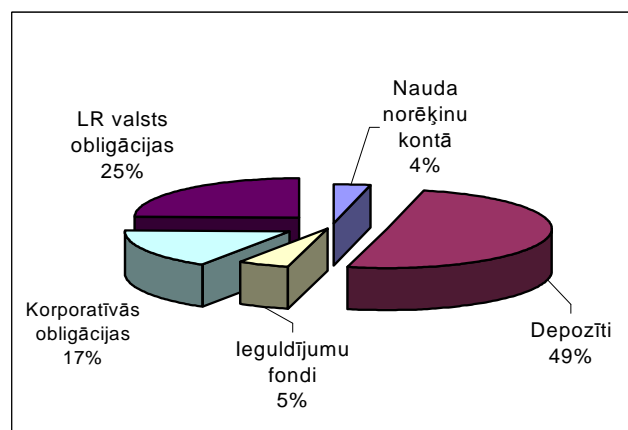
IEGULDĪJUMU POLITIKA

Plāna "DAUGAVA" ieguldījumu politika ir konservatīva, tās mērķis - nodrošināt plāna

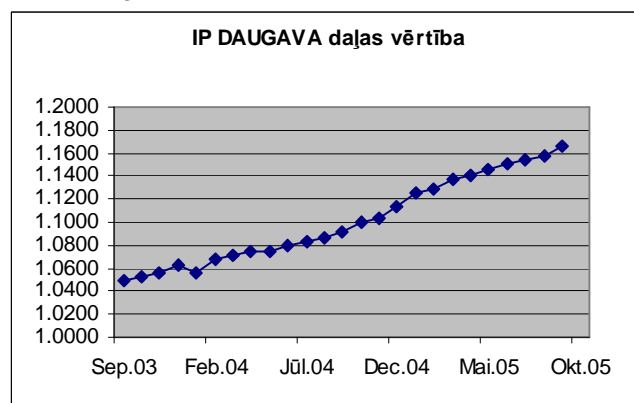
dalībniekiem stabilus ienākumus pie zemas ieguldījumu riska pakāpes.

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 IEGULDĪJUMU STRUKTŪRA



PLĀNA DAĻAS VĒRTĪBA



LĪDZEKĻU PĀRVALDĪŠANAS IZMAKSAS

Plāna līdzekļu pārvaldīšanas izmaksas pārskata periodā sastādīja 2 476.78 latus, no kuriem atlīdzība ieguldījumu sabiedrībai – 2 173.19 lati, atlīdzība turētājbankai – 303.59 lati.

PENSIJU PLĀNS DAUGAVA

PĀRVALDĪTĀJA ZIŅOJUMS

Pārskata periodā Plāna ieguldījumu apjoms palielinājās par 12.8 procentiem un sasniedza 747 675 latus, jeb 1.01 procentus no kopējiem 2.līmeņa pensiju plānu līdzekļiem. IP "DAUGAVA" ienesīgums pārskata periodā sastādīja 5.65, kas ir augstākais rādītājs starp visiem konservatīvajiem 2. līmeņa pensiju plāniem Latvijā, bet no darbības sākuma datuma 5.81 procenti gadā.

Salīdzinot ar iepriekšējo ceturksni ir mainījusies plāna ieguldījumu portfeļa struktūra. Ir nedaudz samazināts ieguldījumu īpatsvars termiņnoguldījumos kredītiestādēs, kas sastāda 50% no plāna aktīviem (ceturkšņa sākumā 52 procenti) un Latvijas valsts vērtspapīros, kas sastāda 25% no plāna aktīviem (ceturkšņa sākumā 27%). IP "DAUGAVA" ieguldījumu korporatīvajos parāda vērtspapīros īpatsvars ir palielinājies līdz 17% (ceturkšņa sākumā 13%), līdzekļi tika izvietoti ar ienesību 4.8 procenti gadā. Pārskata periodā tika veikti ieguldījumi ieguldījumu fondos un šādu ieguldījumu īpatsvars sastāda 5% no Plāna aktīviem. Naudas atlikums norēķinu kontā uz pārskata perioda beigām sastāda 4% no plāna aktīviem.

Nākamajā ceturksnī pārvaldītājs plāno saglabāt termiņnoguldījumu daļu portfeli 50% robežās, Latvijas valsts vērtspapīru daļu 20-25% robežās, bet līdz 20% no plāna līdzekļiem ieguldīt korporatīvajos vērtspapīros. Pārvaldītājs

prognozē, ka plāna "DAUGAVA" daļas pieaugums 2005.gada 4.ceturksnī būs robežās no 4.0 līdz 4.5 procentiem gadā.

Pārskata periodā turpināja samazināties Latvijas ilgtermiņa obligāciju ienesīguma likmes (vidēji 0.05-0.15 procenti gadā) un attiecīgi palielinājās to cenas. Šo likmju izmaiņas pozitīvi ietekmēja arī plāna daļu ienesīgumu, kas pārskata periodā sasniedza 5.65 procentus gadā.

Latvijas valsts parādzīmju ienesīgums RFB (% gadā)

Termiņš līdz dzēšanai, mēn.	Pērk, %	Pārdod, %
12m	2.40	2.25
22m	2.70	2.30
60m	3.25	2.85
99m	3.35	3.15
106m	3.40	3.20

Pārskata periodā īstermiņa latu likmes praktiski nav mainījušās. Uz pārskata perioda beigām RIGIBOR 1 mēneša likme bija 2,79%, 3 mēnešu likme – 2.79%, 6 mēnešu likme – 2.81, savukārt gada likme 2.92%. Īstermiņa likmju izmaiņas plāna rezultātus praktiski neietekmē, jo plāna aktīvi tiek izvietoti garāka termiņa finanšu instrumentos.

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

Ieguldījumu plāni pēc kategorijām	Darbības uzsākšanas datums	Daļas vērtība, Ls 30/09/2005	Ienesīgums, % gadā					Neto aktīvu vērtība, Ls 30/09/2005
			1mēn.	3 mēn.	6 mēn.	12 mēn	kopš darbības sākuma	
Konservatīvie plāni								
Valsts kases ieguldījumu plāns	07.Sep.01	1.2408276	4.42%	3.25%	4.05%	5.47%	5.37%	15 397 157
Hansa pensiju ieguldījumu plāns "Stabilitāte"	07.Jan.03	1.1029920	3.84%	2.46%	3.38%	3.83%	3.60%	4 080 082
Pareksis Universālais pensiju plāns	07.Jan.03	1.1622696	5.50%	4.63%	5.41%	6.27%	5.58%	1 900 587
LVA IPS "DAUGAVA"	21.Jan.03	1.1668446	9.31%	5.65%	5.17%	6.75%	5.81%	747 675
Baltikums konservatīvais ieguldījumu plāns	21.Jan.03	1.1233856	3.85%	2.84%	3.30%	4.58%	4.35%	131 290
Suprema/EVLI ieguldījumu plāns "Jūrmala"	09.Jan.04	1.0128162	0.62%	0.61%	0.55%	0.50%	0.73%	3 695
Astra Krājfondi pensiju plāns "Klasika"	19.Aug.04	1.0792913	4.67%	3.93%	4.31%	6.58%	6.98%	951 514
"NORD/LB 1" Konservatīvais IP	02.Mar.05	1.0372669	6.41%	4.16%	6.37%		6.41%	28 337
Kopā Konservatīvie plāni *			4.57%	3.33%	4.09%	5.32%		23 240 336

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