

# 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 IV. 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

	31.12..2005	30.09.2005
Ieguldījumu plāna daļas vērtība (LVL)	1.1762871	1.1668446
Ieguldījumu plāna līdzekļu vērtība (LVL)	803 908	747 675

### IEGULDĪJUMU PLĀNA IENESĪGUMS

	3 mēn.	6 mēn.	12 mēn.	Kopš darbības sākuma
Periodā (%)	0.94	2.57	6.30	17.63
Gada procenti*	3.20	4.42	5.58	5.59

\* gada ienesīguma likmes tiek aprēķinātas lietojot ACT/360 metodi

### 10 LIELĀKIE IEGULDĪJUMI

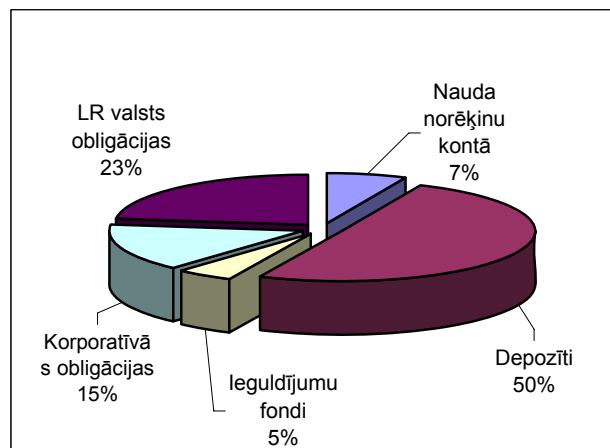
Ieguldījums	Valūta	Dzēšanas datums	Īpatsvars, %
LR 10g obligācijas	LVL	02.04.2014	11.23%
LR 10g obligācijas	LVL	14.02.2013	9.23%
Obligācijas (AK Baltikums)	EUR	29.12.2006	7.16%
LHZB ķīlu zīmes	LVL	15.08.2013	6.51%
Parex Austrumeiropas obligāciju fonds	USD	06.08.2009	4.68%
Depozīts (Parex banka)	LVL	21.03.2010	3.36%
Depozīts (AK Baltikums)	LVL	06.08.2009	3.18%
Depozīts (Latvijas Krājbanka)	LVL	25.11.2007	3.12%
Depozīts (Reģionālā Investīciju Banka)	LVL	09.07.2006	2.70%
Depozīts (Trasta Komerbanka)	LVL	08.05.2007	2.56%

### IEGULDĪJUMU POLITIKA

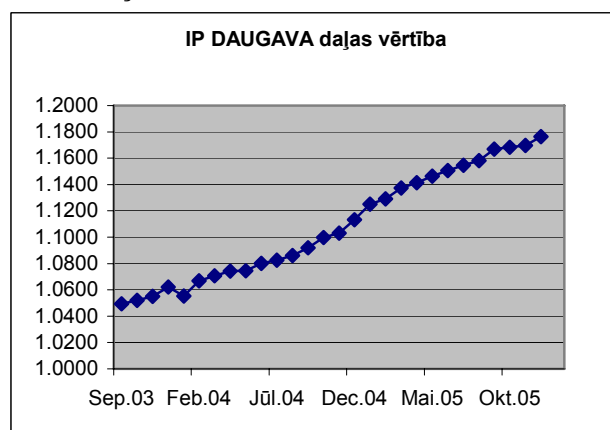
Plāna "DAUGAVA" ieguldījumu politika ir konservatīva, tās mērķis - nodrošināt plāna dalībniekiem stabilus ienākumus pie zemas ieguldījumu riska pakāpes.

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 2 698.66 latus, no kuriem atlīdzība ieguldījumu sabiedrībai – 2 370.72 lati, atlīdzība turētājbankai – 327.94 lati.

# PENSIJU PLĀNS DAUGAVA

## PĀRVALDĪTĀJA ZIŅOJUMS

Pārskata periodā Plāna ieguldījumu apjoms palielinājās par 7.5 procentiem un sasniedza 803 908 latus, jeb 0.98 procentus no kopējiem 2.līmeņa pensiju plānu līdzekļiem. IP "DAUGAVA" ienesīgums pārskata periodā sastādīja 3.20 procenti gadā, bet par 2005.gadu 5.58 procenti gadā (salīdzinošie vidējie rādītāji konservatīvo plānu grupā – attiecīgi 1.52 % un 4.21% ).

Salīdzinot ar iepriekšējo ceturksni praktiski nav mainījusies plāna ieguldījumu portfeļa struktūra. Ieguldījumu īpatsvars termiņnoguldījumos kredītiestādēs sastāda 50% no plāna aktīviem (ceturkšņa sākumā 50%) un Latvijas valsts vērtspapīros 23% no plāna aktīviem (ceturkšņa sākumā 25%), korporatīvajos parāda vērtspapīros 15% (ceturkšņa sākumā 17%), bet ieguldījumi ieguldījumu fondos 5% (ceturkšņa sākumā 5%). Naudas atlikums norēķinu kontā uz pārskata perioda beigām sastāda 7% 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 parāda vērtspapīros. Pārvaldītājs prognozē, ka plāna "DAUGAVA" daļas

pieaugums 2006.gada 1.ceturksnī būs robežās no 3.5 līdz 4.0 procentiem gadā.

Pārskata periodā nedaudz pieauga Latvijas ilgtermiņa obligāciju ienesīguma likmes (vidēji 0.05-0.10 procenti gadā) un attiecīgi samazinājās to cenas. Šo likmju izmaiņas negatīvi ietekmēja arī plāna daļu ienesīgumu, kas uz pārskata perioda beigām sasniedza 3.20 procentus gadā.

### Latvijas valsts parādzīmju ienesīgums RFB (% gadā)

Termiņš līdz dzēšanai, mēn.	Pērk, %	Pārdod, %
6m	3.30	2.35
18m	2.98	2.35
51m	3.22	2.85
86m	3.38	3.20
98m	3.42	3.25

Uz pārskata perioda beigām būtiski pieauga īstermiņa latu likmes. RIGIBOR 1 mēneša likme palielinājās līdz 4.37% (pārskata perioda sākumā 2.79%), 3 mēnešu likme līdz 3.95% (2.79%), 6 mēnešu likme līdz 3.59% (2.81%), bet gada likme sasniedza 3.52% (2.92%) gadā. 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 31.decembri

Ieguldījumu plāni pēc kategorijām	Darbības uzsākšanas datums	Daļas vērtība, Ls 31/12/2005	Ienesīgums, %				Neto aktīvu vērtība, Ls 31/12/2005
			3 mēn.	6 mēn.	12 mēn.	kopš darbības sākuma	
<b>Konservatīvie plāni</b>							
Valsts kases ieguldījumu plāns	07.Sep.01	1.2445219	1.24%	2.20%	4.35%	5.12%	14 673 597
Hansa pensiju ieguldījumu plāns "Stabilitāte"	07.Jan.03	1.1081543	1.84%	2.15%	3.42%	3.45%	4 646 178
Parekss Universālais pensiju plāns	07.Jan.03	1.1683996	2.08%	3.35%	4.94%	5.28%	2 138 548
<b>LVAIS "Daugava"</b>	<b>21.Jan.03</b>	<b>1.1762871</b>	<b>3.20%</b>	<b>4.42%</b>	<b>5.58%</b>	<b>5.59%</b>	<b>803 908</b>
Baltikums konservatīvais ieguldījumu plāns	21.Jan.03	1.1281235	1.66%	2.25%	3.78%	4.12%	147 888
Suprema/EVLI ieguldījumu plāns "Jūrmala"	09.Jan.04	1.0148202	0.78%	0.69%	0.63%	0.74%	5 269
Astra Krājfondi pensiju plāns "Klasika"	19.Aug.04	1.0847830	2.01%	2.96%	4.71%	6.05%	1 224 363
"NORD/LB 1" Konservatīvais IP	02.Mar.05	1.0399762	1.03%	2.58%		4.75%	59 727
<b>Kopā Konservatīvie plāni *</b>			<b>1.52%</b>	<b>2.38%</b>	<b>4.21%</b>		<b>23 699 478</b>
<b>Kopā Sabalansētie plāni *</b>			<b>1.45%</b>	<b>5.52%</b>	<b>6.07%</b>		<b>3 588 356</b>
<b>Kopā Aktīvie plāni *</b>			<b>4.39%</b>	<b>9.36%</b>	<b>9.55%</b>		<b>55 094 213</b>
<b>KOPĀ visi plāni *</b>			<b>3.43%</b>	<b>7.17%</b>	<b>7.85%</b>		<b>82 382 047</b>

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