

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 2006. gada I. 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

	31.03.2006	31.12.2005
Ieguldījumu plāna daļas vērtība (LVL)	1.1838578	1.1762871
Ieguldījumu plāna līdzekļu vērtība (LVL)	813202	803 908

IEGULDĪJUMU PLĀNA IENESĪGUMS

	3 mēn.	6 mēn.	12 mēn.	Kopš darbības sākuma
Plāns, % gadā*	2.60	2.90	4.03	5.35
Nozares vidējais, % gadā*	-0.45	0.57	2.31	n/a

* gada ienesīguma likmes tiek aprēķinātas lietojot ACT/360 metodi

10 LIELĀKIE IEGULDĪJUMI

Ieguldījums	Valūta	Dzēšanas datums	Īpatsvars, %
LR 10g obligācijas	LVL	02.04.2014	10.89%
Q-VARA obligācijas	EUR	12.01.2009	9.01%
Obligācijas (AK Baltikums)	EUR	29.12.2006	7.19%
LR 10g obligācijas	LVL	14.02.2013	6.58%
LHZB ķīlu zīmes	LVL	15.08.2013	6.35%
Parex Austrumeiropas obligāciju fonds	USD		4.58%
Depozīts (Parex banka)	LVL	21.03.2010	3.32%
Depozīts (Latvijas Krājbanka)	LVL	25.11.2007	3.12%
Depozīts (AK Baltikums)	LVL	06.08.2009	3.10%
Depozīts (Reģionālā Investīciju Banka)	LVL	09.07.2006	2.70%

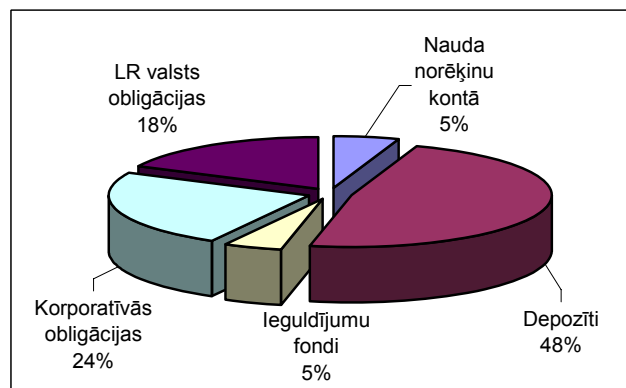
IEGULDĪJUMU POLITIKA

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

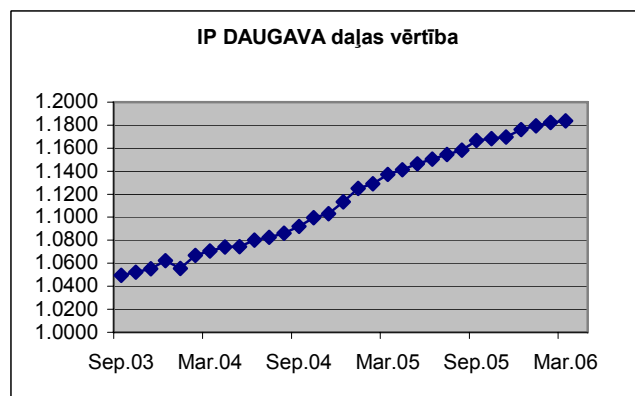
dalībniekiem stabilus ienākumus pie zemas ieguldījumu riska pakāpes.

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 2 820.51 latus, no kuriem atlīdzība ieguldījumu sabiedrībai – 2 479.04 lati, atlīdzība turētājbankai – 341.47 lati.

PENSIJU PLĀNS DAUGAVA

PĀRVALDĪTĀJA ZIŅOJUMS

Pārskata periodā Plāna ieguldījumu apjoms palielinājās par 1.2 procentiem un sasniedza 813 202 latus, jeb 0.88 procentus no kopējiem 2.līmeņa pensiju plānu līdzekļiem. IP "DAUGAVA" ienesīgums pārskata periodā sastādīja 2.6 procenti gadā, bet par pēdējiem 12 mēnešiem 4.03 procenti gadā (salīdzinošie vidējie rādītāji konservatīvo plānu grupā – attiecīgi –0.45 un 2.31 procenti gadā).

Salīdzinot ar iepriekšējo ceturksni praktiski nav mainījies ieguldījumu īpatsvars termiņnoguldījumos kredītiestādēs, kas sastāda 48% no plāna aktīviem (ceturkšņa sākumā 50%). Latvijas valsts vērtspapīru īpatsvars portfelī ir samazināts līdz 18% no plāna aktīviem (ceturkšņa sākumā 23%), bet korporatīvajos parāda vērtspapīru īpatsvars portfelī ir palielināts līdz 24% (ceturkšņa sākumā 15%). Ieguldījumu īpatsvars ieguldījumu fondos un naudas atlikums norēķinu kontā uz pārskata perioda beigām sastāda 5% 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.

Pārvaldītājs prognozē, ka 2006.gada 2.ceturksnī samazināsies ilgtermiņa % likmju kāpums un plāna

"DAUGAVA" daļas pieaugums varētu būt robežās no 3.0 līdz 3.5 procentiem gadā.

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 2.60 procentus gadā.

Latvijas valsts parādzīmju ienesīgums 31.03.2006 RFB (% gadā)

Termiņš līdz dzēšanai, mēn.	Pērk, %	Pārdod, %
14m	3.17	-
47m	3.57	-
83m	3.80	-
97m	3.85	-
116m	3.87	-

Uz pārskata perioda beigām salīdzinot ar pārskata perioda sākumu ir samazinājušās RIGIBOR 1 mēneša un 3 mēnešu likmes (attiecīgi 1mēneša likme no 3.95% līdz 2.84%, bet 3mēnešu no 3.95% līdz 3.84%), bet pieaugušas RIGIBOR 6 mēnešu un 12 mēnešu likmes (attiecīgi 6 mēnešu likme no 3.59% līdz 4.06%, bet 12 mēnešu no 3.52% līdz 4.14%). 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 31.martu

Konservatīvie ieguldījumu plāni	Darbības uzsākšanas datums	Daļas vērtība, Ls 31/03/2006	Ienesīgums, %				Neto aktīvu vērtība, Ls 31/03/2006
			3 mēn.	6 mēn.	12 mēn.	kopš darbības sākuma	
Valsts kases ieguldījumu plāns	07.Sep.01	1.2441167	-0.13%	0.56%	2.28%	4.83%	13 103 735
Astra Krājfondi pensiju plāns "Klasika"	19.Aug.04	1.0880222	1.20%	1.61%	2.95%	5.29%	1 440 303
Baltikums konservatīvais ieguldījumu plāns	21.Jan.03	1.1294513	0.47%	1.07%	2.18%	3.83%	153 244
Hansa pensiju ieguldījumu plāns "Stabilitāte"	07.Jan.03	1.1018869	-2.24%	-0.20%	1.58%	3.01%	5 231 634
LVAIS "Daugava"	21.Jan.03	1.1838578	2.60%	2.90%	4.03%	5.35%	813 202
"NORD/LB 1" Konservatīvais IP	02.Mar.05	1.0415507	0.61%	0.82%	3.56%	3.79%	88 860
Parex Universālais pensiju plāns	07.Jan.03	1.1660718	-0.79%	0.65%	3.01%	4.80%	2 370 748
SEB Latvijas plāns	07.Jan.03	1.1249023	1.45%	1.52%	2.67%	3.66%	420 379
Suprema/EVLI ieguldījumu plāns "Jūrmala"	09.Jan.04	1.0148988	0.03%	0.41%	0.48%	0.66%	6 882
Kopā Konservatīvie plāni *			-0.45%	0.57%	2.31%		23 628 987

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