

IEGULDĪJUMU PLĀNS DAUGAVA



Līdzekļu pārvaldītājs - AS "LVA ieguldījumu pārvaldes sabiedrība"
Juridiskā adrese – Ernesta Birznieka - Upīša iela 21, Rīga, LV-1011
Valsts fondēto pensiju shēmas līdzekļu ieguldījumu plāns "DAUGAVA"

LĪDZEKĻU PĀRVALDĪTĀJA ZIŅOJUMS

par 2006. gada III. ceturkšņa rezultātiem

VISPĀRĒJĀ INFORMĀCIJA

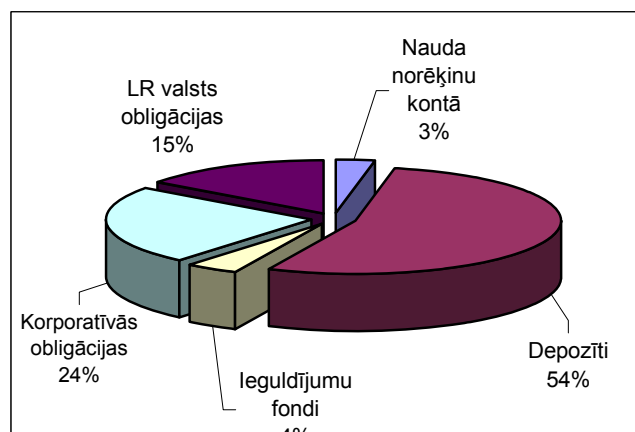
Plāna pārvaldnieks: Ģirts Veģeris
Turētājbanka: AS "Parex Banka"
Plāna darbības sākums: 2003.gada 21.janvāris
Atlīdzība par pārvaldīšanu: maks. 1.375% gadā

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

	30.09.2006	30.06.2006
Ieguldījumu plāna daļas vērtība (LVL)	1.1922649	1.1850715
Ieguldījumu plāna līdzekļu vērtība (LVL)	898 506	852 317

PLĀNA IEGULDĪJUMU STRUKTŪRA

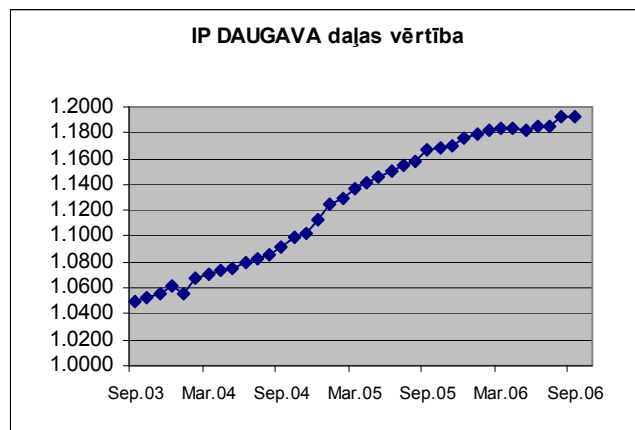


IEGULDĪJUMU PLĀNA DAĻAS PIEAUGUMS, %

	3 mēn.	6 mēn.	12 mēn.*	Kopš darbības sākuma*
IP DAUGAVA	0.60	0.70	2.17	4.87
Nozares vidējais	0.49	0.11	0.36	n/a

* vidējais svērtais (pēc aktīvu vērtības) ienesīgums % gadā

PLĀNA DAĻAS VĒRTĪBA



10 LIELĀKIE IEGULDĪJUMI

Ieguldījums	Valūta	Dzēšanas datums	Īpatsvars, %
LR 10g obligācijas	LVL	02.04.2014	9.11%
Q-VARA obligācijas	EUR	12.01.2009	8.59%
LR 10g obligācijas	LVL	14.02.2013	5.80%
LHZB ķīlu zīmes	LVL	15.08.2013	5.61%
Depozīts LHZB	LVL	07.09.2007	5.57%
Depozīts LATEKO banka	LVL	03.07.2007	4.50%
Parex Austrumeiropas obligāciju fonds	USD		4.04%
AK Baltikums obligācijas	LVL	20.04.2009	4.03%
Parex banka obligācijas	LVL	05.05.2011	3.93%
Depozīts (Reģionālā Investīciju Banka)	LVL	13.06.2008	3.39%

IEGULDĪJUMU POLITIKA

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

LĪDZEKĻU PĀRVALDĪŠANAS IZMAKSAS

Plāna līdzekļu pārvaldīšanas izmaksas pārskata periodā sastādīja 3 065.47 latus, no kuriem atlīdzība pārskata periodā sastādīja 2 696.48 latus, atlīdzība turētājbankai – 368.99 latus.

IEGULDĪJUMU PLĀNS DAUGAVA

PĀRVALDĪTĀJA ZIŅOJUMS

Pārskata periodā Plāna ieguldījumu apjoms palielinājās par 5.4 procentiem un sasniedza 889 506 latus, jeb 0.79 procentus no kopējiem 2.līmeņa pensiju plānu līdzekļiem. IP "DAUGAVA" ienesīgums pārskata periodā sastādīja 2.4 procenti gadā, bet par pēdējiem 12 mēnešiem 2.17 procenti gadā (salīdzinošie vidējie rādītāji konservatīvo plānu grupā – attiecīgi 0.49 un 0.36 procenti gadā) .

Salīdzinot ar iepriekšējo ceturksni ir palielinājies ieguldījumu īpatsvars termiņnoguldījumos kredītiestādēs, kas sastāda 54% no plāna aktīviem (ceturkšņa sākumā 48%). Latvijas valsts vērtspapīru īpatsvars portfelī ir samazinājies līdz 15% no plāna aktīviem (ceturkšņa sākumā 16%), bet korporatīvajos parāda vērtspapīru līdz 24% (ceturkšņa sākumā 25%). Ieguldījumu īpatsvars ieguldījumu fondos un naudas atlikums norēķinu kontā uz pārskata perioda beigām sastāda attiecīgi 4% un 3% 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 2.40 procentus gadā. Pārvaldītājs prognozē, ka 2006.gada 4.ceturksnī samazināsies ilgtermiņa % likmju kāpums un apsver iespēju palielināt Latvijas valsts vērtspapīru īpatsvaru portfelī. Pārvaldnieks prognozē, ka plāna "DAUGAVA" daļas pieaugums varētu būt robežās no 3.0 līdz 4.0 procentiem gadā.

Latvijas valsts parādzīmju ienesīgums 29.09.2006 RFB (% gadā)

Termiņš līdz dzēšanai, mēn.	Pērk, %	Pārdod, %
8m	4.30	-
41m	4.30	-
77m	4.66	-
91m	4.74	-
110m	4.83	-

Uz pārskata perioda beigām salīdzinot ar pārskata perioda sākumu ir palielinājušās RIGIBOR 1, 3, 6 un 12 mēnešu likmes (attiecīgi 1 mēneša likme no 3.46% līdz 5.12%, 3 mēnešu likme no 4.03% līdz 5.07%, 6 mēnešu likme no 4.31% līdz 5.08%, bet 12 mēnešu likme no 4.40% līdz 5.29%) . 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 2009.gada 29.septembri

Ieguldījumu plāni pēc kategorijām	Darbības uzsākšanas datums	Daļas vērtība, Ls 29/09/2006	Ienesība pēdējos				Neto aktīvu vērtība, Ls 29/09/2006
			3 mēn.	6 mēn.	12 mēn*	kopš darbības sākuma*	
Konservatīvie plāni							
Valsts kases ieguldījumu plāns	07.Sep.01	1.2426766	0.01%	-0.12%	0.17%	4.38%	12 393 915
Astra Krājfondi pensiju plāns "Klasika"	19.Aug.04	1.1010406	1.51%	1.20%	2.02%	4.66%	1 837 879
Baltikums konservatīvais ieguldījumu plāns	21.Jan.03	1.1335655	0.47%	0.36%	0.91%	3.45%	194 644
BTB Konservatīvais plāns	08.Mar.06	1.0084741	0.85%	0.00%	0.00%	1.51%	12 489
Hansa pensiju ieguldījumu plāns "Stabilitāte"	07.Jan.03	1.0998924	0.73%	-0.18%	-0.28%	2.58%	6 531 471
LVAIPS "Daugava"	21.Jan.03	1.1921339	0.60%	0.70%	2.17%	4.87%	898 407
"NORD/LB 1" Konservatīvais IP	02.Mar.05	1.0457929	0.35%	0.41%	0.82%	2.87%	125 325
Parex Universālais pensiju plāns	07.Jan.03	1.1736703	1.26%	0.65%	0.98%	4.38%	3 061 921
SEB Latvijas plāns (sākot ar 2006)	07.Jan.03	1.1358874	0.54%	0.98%		3.47%	470 170
Suprema/EVLI ieguldījumu plāns "Jūrmala"	09.Jan.04	1.0106509	0.18%	-0.42%	-0.21%	0.39%	8 665
Kopā Konservatīvie plāni *			0.49%	0.11%	0.36%		25 534 886

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