

## Ziņojums par ieguldījumu stratēģijas atbilstību aktīvu pārvaldes līguma nosacījumiem

Aktīvu pārvaldītāja CBL Asset Management IPAS ziņojums par ieguldījumu stratēģijas atbilstību ar AS CBL Atklātais pensiju fonds noslēgtā aktīvu pārvaldes līguma nosacījumiem un informācija par to kā ieguldījumu stratēģija ir veicinājusi AS CBL Atklātais pensiju fonds aktīvu vidēja termiņa un ilgtermiņa darbības rezultātus.

Ziņojums ietver informāciju par AS CBL Atklātais pensiju fonds izveidoto un CBL Asset Management IPAS pārvaldīto pensiju plānu: "CBL Sabalansētais", "CBL Aktīvais" un "CBL Aktīvais USD"

Par periodu no 2020. gada 1. janvāra līdz 31. decembrim

### Atruna un kontaktinformācija

Šis ziņojums sniedz Privāto pensiju fondu likuma 21. panta (14) punktā paredzēto ikgadēju informāciju par aktīvu pārvaldes līguma izpildes kvalitāti, kas iegūta apkopojot CBL Asset Management IPAS rīcībā esošo informāciju. Dati apkopoti par laika periodu no 2020. gada 1. janvāra līdz 31. decembrim.

Šo ziņojumu sagatavoja CBL Asset Management IPAS, kuru pārrauga Latvijas Republikas Finanšu un kapitāla tirgus komisija. Lai iegūtu sīkāku informāciju, lūdzam griezties:

CBL Asset Management IPAS  
Republikas laukums 2A,  
Rīga, Latvija LV-1010  
T. (+371) 6 701 0810  
asset@cbl.lv

### Būtiskākie vidēja termiņa un ilgtermiņa ieguldījumu riski

Procentu likmju risku – iespējamība ciest zaudējumus sakarā ar nelabvēlīgām tirgus svārstībām, kuru rezultātā mainās finanšu tirgus procentu likmes, kas savukārt ietekmē finanšu instrumentu cenas;

Cenu risks – iespējamība ciest papildus izdevumus un/vai zaudējumus sakarā ar Finanšu instrumentu cenas svārstībām;

Finanšu instrumentu emitenta risks – iespējamība ciest papildus izdevumus un/vai zaudējumus, kas rodas tādēļ, ka Finanšu instrumentu vērtība var samazināties vai tie var tikt zaudēti sakarā ar attiecīgā emitenta nespēju pildīt savas saistības, sliktiem finansiāliem rādītājiem, maksātnespēju u.tml.





## Pensiju plāna "CBL Aktīvais USD" Ieguldījumu portfeļa sastāvs

Uz 31.12.2020.

Naudas līdzekļi											
				Valūta			Atlikums konta valūtā	Valūtas kurss	Atlikums portfeļa valūtā	Daļa portfelī %	
CASH				USD			74 853.50	1.000000	74 853.50	6.75%	
CASH				EUR			2 901.33	1.227100	3 560.22	0.32%	
Naudas līdzekļi kopā										78 413.72	7.07%
Parāda vērtspapīri											
Vērtspapīra nosaukums	Kods	Dzēšanas datums	Kupons	Valūta	Nomināls	Cena	Uzkrātā is kupons	Vērtība	Valūtas kurss	Vērtība portfeļa valūtā	Daļa portfelī %
REPUBLIC OF LATVIA	XS0638326263	16. jūn. 21	5.250%	USD	200 000	102.0180%	408.33	204 444.33	1.000000	204 444.33	18.43%
US TREASURY N/B	US912810R861	15. maijs. 43	2.875%	USD	120 000	126.2813%	438.40	151 975.90	1.000000	151 975.90	13.70%
Parāda vērtspapīri kopā:										356 420.23	32.13%
Ieguldījumu fondu daļas											
Vērtspapīra nosaukums	Kods			Valūta	Daudzums	Cena		Vērtība	Valūtas kurss	Vērtība portfeļa valūtā	Daļa portfelī %
FIMCO-US HYL BD-USDINST ACC	IE0002460974			USD	1 477.5010	39.0500		57 696.41	1.000000	57 696.41	5.20%
VANGRD US 500 STK IDX-USDINS	IE0002639775			USD	1 985.0000	43.2286		85 808.77	1.000000	85 808.77	7.74%
ROBEKO BP US PREMIUM EQ-IUSD	LU0226954369			USD	210.0000	344.2500		72 292.50	1.000000	72 292.50	6.52%
VONTORL-US EQUITY-I	LU0278092605			USD	95.0000	369.9000		35 140.50	1.000000	35 140.50	3.17%
VONTORL-EMERG MARKET EQ-I USD	LU0278093082			USD	380.0000	245.4100		93 255.80	1.000000	93 255.80	8.41%
BLUEBAY-EMERG MKT CORP B-R B\$	LU0356217504			USD	200.0000	224.6300		44 926.00	1.000000	44 926.00	4.05%
ROBEKO HIGH YLD BD-IUSD	LU0398248921			USD	176.0000	324.4500		57 103.20	1.000000	57 103.20	5.15%
DEUTSCHE INV GERMA EQ-US LCH	LU0911036720			USD	310.0000	182.3900		56 540.90	1.000000	56 540.90	5.10%
BGF-EUROPEAN FOCUS FD-AZHU USD	LU0969580306			USD	4 360.0000	17.7400		77 346.40	1.000000	77 346.40	6.97%
CBL GLOB EMERG MKTS BF KL R ACC USD	LV0000400968			USD	3 712.9482	11.1800		41 510.76	1.000000	41 510.76	3.74%
CBL EASTERN EUROPEAN BOND FUND	LV0000400125			USD	1 918.1516	27.5600		52 864.26	1.000000	52 864.26	4.77%
Ieguldījumu fondu daļas kopā:										674 485.50	60.80%
Investīciju portfelis kopā										110931945.00%	100.00%

## Pensiju plānu ieguldījumu portfeļa darbības izmaksas un aprožījums, EUR

Pensiju plāna nosaukums	Aprožījums par periodu				Ar darījumiem saistītās izmaksas	
	Izejošie maksājumi	Ienākošie maksājumi	Vērtspapīru pirkšanas darījumi	Vērtspapīru pārdošanas darījumi	Maksas par pārvaldīšanu	Maksas par izpildi
<b>CBL Sabalansētais</b>	4 127 116	4 456 009	7 644 781	7 231 951	343 927	8 781
<b>CBL Aktīvais</b>	1 376 639	1 657 961	3 291 985	3 803 245	151 751	6 161
<b>CBL Aktīvais USD</b>	97 738	77 959	237 258	217 828	12 462	573

### Pensiju plāna "CBL Sabalansētais" aprožījums par periodu:

- Izejošo maksājumu summa: EUR 4 127 116
- Ienākošo maksājumu summa: EUR 4 456 009
- Vērtspapīru pirkšanas darījumi: EUR 7 644 781
- Vērtspapīru pārdošanas darījumi: EUR 7 231 951

Ar ieguldījumu pakalpojumu saistītās izmaksas/izdevumi kopā: EUR 400 221

No tiem:

- Maksas par pārvaldīšanu: EUR 343 927
- Maksas par izpildi: EUR 8 781
- Maksas par turētājbankas pakalpojumiem: EUR 47 513

Pensiju plāna "CBL Aktīvais" apgrozījums par periodu:

- Izejošo maksājumu summa: EUR 1 376 639
- Ienākošo maksājumu summa: EUR 1 657 961
- Vērtspapīru pirkšanas darījumi: EUR 3 291 985
- Vērtspapīru pārdošanas darījumi: EUR 3 803 245

Ar ieguldījumu pakalpojumu saistītās izmaksas/izdevumi kopā: EUR 178 914

No tiem:

- Maksas par pārvaldīšanu: EUR 151 751
- Maksas par izpildi: EUR 6 161
- Maksas par turētājbankas pakalpojumiem: EUR 21 002

Pensiju plāna "CBL Aktīvais USD" apgrozījums par periodu:

- Izejošo maksājumu summa: EUR 97 738
- Ienākošo maksājumu summa: EUR 77 959
- Vērtspapīru pirkšanas darījumi: EUR 237 258
- Vērtspapīru pārdošanas darījumi: EUR 217 828

Ar ieguldījumu pakalpojumu saistītās izmaksas/izdevumi kopā: EUR 14 323

No tiem:

- Maksas par pārvaldīšanu: EUR 12 462
- Maksas par izpildi: EUR 573
- Maksas par turētājbankas pakalpojumiem: EUR 1 288

### **Pilnvaroto padomdevēju pakalpojumu izmantošana**

Netiek izmantoti.

### **Vērtspapīru aizņemšanās politika un šīs politikas īstenošana tās akciju sabiedrības akcionāru sapulcē, kuras akcijās veikts ieguldījums, un citu akcionāru iesaistīšanas pasākumu īstenošanā.**

Ieguldījumu politika neparedz vērtspapīru aizņemšanos.

### **Informācija par akciju sabiedrības vidēja termiņa un ilgtermiņa darbības rezultātu izvērtējuma ietekmi uz ieguldījumu lēmumu pieņemšanu.**

Ieguldījumu lēmumus pārvaldītājs pieņem neatkarīgi (discretionary), saskaņā ar noslēgto aktīvu pārvaldes līgumu un atbilstoši katra pensiju plāna ieguldījumu politikai un tās kvalitatīvajiem un kvalitatīvajiem ierobežojumiem.

## **Informācija par interešu konfliktiem**

CBL Asset Management IPAS un akciju sabiedrība AS CBL Atklātais pensiju fonds ir vienas konsolidācijas grupas uzņēmumi, kas iekļaujas kopējā AS Citadele banka grupas risku pārvaldības sistēmā, un īsteno grupas mēroga politikas un procedūras, t.sk. interešu konfliktu pārvaldības jomā.

Aktīvu pārvaldītājs apzinās, ka dažādu struktūrvienību iesaistīšana aktīvu pārvaldes pakalpojumu sniegšanas procesā ietilpstošajās darbībās, var radīt interešu konfliktu starp AS CBL Atklātais pensiju fonds, CBL Asset Management IPAS, AS Citadele banku un klientiem. CBL Asset Management IPAS ir reglamentējusi detalizētu un neatkarīgu interešu konfliktu pārvaldības procesu un noteikusi darbinieku un amatpersonu atbildību un pienākumus interešu konfliktu pārvaldībā. Interešu konfliktu situāciju novēršanai aktīvu pārvaldītājs raugās, lai AS CBL Atklātais pensiju fonds aktīvu pārvaldīšana tiktu veikta saskaņā ar CBL Asset Management IPAS Darījumu izpildes politiku ar pienācīgu rūpību un, nodrošinot labāko rezultātu un darījumu izpildi.

Aktīvu pārvaldītājs atbilstoši tiesību aktu prasībām ir izstrādājis iekšējās procedūras, lai pienācīgi identificētu, pārvaldītu un pārraudzītu iespējamus interešu konfliktus, kā arī ir funkcionāli un hierarhiski nošķīris no aktīvu pārvaldes pienākumiem citus pienākumus, kas rada iespējamus interešu konfliktus. Aktīvu pārvaldītāja vadības struktūra ir izveidota tādā veidā, lai ļautu aktīvu pārvaldītājam un AS CBL Atklātais pensiju fonds darboties neatkarīgi un pildītu savus pienākumus pensiju plānu dalībnieku interesēs.

Papildus informācija par CBL Asset Management IPAS realizēto interešu konfliktu pārvaldību pieejama aktīvu pārvaldītāja mājaslapā internetā: <https://www.cblam.lv>.