

UAB „INVALDA TURTO VALDYMAS“ LYGINAMŪJŲ INDEKSŲ INDIVIDUALIEMS FINANSINIŲ PRIEMONIŲ PORTFELIAMS PARINKIMO IR KEITIMO TAISYKLIŲ Priedas Nr. 1	Įsigaliojimo data	Dokumento statusas	Slaptumo žyma
	2008-09-10	Patvirtinta 2008-09-10 valdybos sprendimu Nr. 02-28/26	Viešam naudojimui

INDIVIDUALIŲ FINANSINIŲ PRIEMONIŲ PORTFELIŲ SUDĖTINIŲ LYGINAMŪJŲ INDEKSŲ SUDĖTIS

1. Tais atvejais, kai individualių finansinių priemonių portfelių finansiniams rezultatams įvertinti naudojamas sudėtinis lyginamasis indeksas, sudėtinės lyginamojo indekso dalys parenkamos atsižvelgiant į finansinių priemonių portfelio investavimo strategiją.
2. Akcijų dalį atspindinti lyginamojo indekso dalis formuojama iš keturių sudėtinių regioninių indeksų (Baltijos šalys, Vidurio ir Rytų Europa, NVS šalys, Pietryčių Europa). Šių indeksų sudėtis ir santykinės dalys:

Baltijos šalys		Vidurio ir Rytų Europa		Pietryčių Europa		NVS šalys	
Estija	40 %	Austrija	12,5 %	Bulgarija	11 %	Kazachstanas	25 %
Latvija	20 %	Čekija	25 %	Kroatija	11 %	Rusija	50 %
Lietuva	40 %	Lenkija	25 %	Rumunija	22 %	Ukraina	25 %
		Slovakija	12,5 %	Serbija	11 %		
		Vengrija	25 %	Slovėnija	22 %		
				Turkija	22 %		
25 %		25 %		25 %		25 %	

3. Toliau pateikiami pavienių šalių akcijų rinkas atspindinčių indeksų, kurie naudojami formuojant regioninius indeksus, pavadinimai:

Šalis	Indeksas	Šalis	Indeksas
Austrija	ATX	Bulgarija	SOFIX
Čekija	PX	Estija	TALSE
Kazachstanas	KZKAVOL	Kroatija	CROBEX
Latvija	RIGSE	Lenkija	WIG20
Lietuva	VILSE	Rumunija	BBETINDEX
Rusija	RTS	Serbija	BELEX15
Slovakija	SKSM	Slovėnija	SVSX
Ukraina	PFTS	Turkija	XU100
Vengrija	BUX		

4. Esant investavimo į regioną apribojimams, regioninių indeksų santykinės dalys koreguojamos pagal investavimo strategiją.
5. Jei finansinių priemonių portfelio investavimo strategija numato platesnį finansinių priemonių geografinį pasiskirstymą, nei apima anksčiau išvardyti akcijų regioniniai indeksai, įtraukiami papildomi regioniniai indeksai ir atitinkamai koreguojamos esamų regioninių indeksų santykinės dalys.
6. Finansinių priemonių portfelio obligacijų dalies rezultatams palyginti naudojamas „Ethical Euro Corporate Bond“ indeksas.
7. Investicinio portfelio investicinių fondų dalies finansiniams rezultatams palyginti naudojami šių investicinių fondų lyginamieji indeksai. Jei investiciniam fondui lyginamasis indeksas nepriskirtas, naudojamas regiono, į kurį pagal strategiją investuoja investicinis fondas, indeksas.