



**Atvirojo tipo informuotiesiems investuotojams skirtas
investicinis fondas
„Orion Absolute Return Fund“**

**2020 METŲ I PUSMEČIO
VEIKLOS ATASKAITA**

Bendroji informacija

1. Informacija apie fondą:

Pavadinimas	Atvirojo tipo informuotiesiems investuotojams skirtas investicinis fondas „Orion Absolute Return Fund“.
<i>Teisinė forma</i>	Atvirojo tipo informuotiesiems investuotojams skirtas investicinis fondas, neturintis juridinio asmens statuso
Lietuvos banko pritarimo sudarymo dokumentams data	2012 03 08
Dalyvių skaičius	7
Veiklos trukmė	Neterminuota

2. Duomenys apie valdymo įmonę:

Pavadinimas	Uždaroji akcinė bendrovė „Orion Asset Management“
Kodas	111707985
<i>Buveinė (adresas)</i>	A. Tumėno g. 4, Vilnius
<i>Telefona numeriai, fakso numeriai, el. pašto adresas, interneto svetainės adresas</i>	+370 5 2032699 oam@orion.lt www.am.orion.lt
<i>Leidimo verstis valdymo įmonės veikla numeris</i>	VĮK - 011.
<i>Registravimo Juridinių asmenų registre data, vieta, kodas</i>	2000 m. rugpjūčio 4 d. LR Ūkio ministerijoje; UĮ 2000-205.
<i>Kolektyvinio investavimo subjekto valdytojo vardas, pavardė, pareigos</i>	Portfelijų valdytojas Donatas Frejus.

3. Informacija apie turto saugotoją:

Pavadinimas	AB Swedbank
<i>Kodas</i>	112029651
<i>Adresas</i>	Konstitucijos pr. 20A, 2600 Vilnius
<i>Telefona ir fakso numeriai</i>	8 5 258 22 28; Faksas: 8 5 258 26 83

4. Informacija apie auditorius:

Auditoriaus pavadinimas	UAB „ERNST & YOUNG BALTIC“
<i>Adresas</i>	Aukštaičių g. 7, Vilnius
<i>Telefona, fakso numeriai</i>	+370 5 274 2200

5. Ataskaitinis laikotarpis:

Ataskaitinis laikotarpis	2020 m. sausio 1 d. – 2020 m. birželio 30 d.
---------------------------------	--

Grynųjų aktyvų vertė, vienetų skaičius ir vertė ataskaitinio laikotarpio pabaigoje

	Ataskaitinio laikotarpio pabaigoje 2020 m. I pusmetis
Grynųjų aktyvų vertė, Eur	3 393 387
Vieneto vertė, Eur	142,8371
Vienetų, esančių apyvartoje, skaičius	23 757

Fondo įsiskolinimai ataskaitinio laikotarpio pabaigoje

	Ataskaitinis laikotarpis 2020 m. I pusmetis
Už finansinį ir investicinį turtą mokėtinos sumos	-
Valdymo įmonei ir depozitoriumui mokėtinos sumos	4 247
Kitos mokėtinos sumos	-
Sukauptos sąnaudos	2 553
Finansinės skolos kredito įstaigoms	-
Įsipareigojimai pagal išvestinių finansinių priemonių sutartis	-
Kiti įsipareigojimai	-
Viso	6 800

Kategorija	Dalyvių skaičius
Profesionalieji investuotojai	
<p>Profesionaliųjų investuotojų statuso neturintys fiziniai asmenys, kurie yra valdymo įmonei ar investicinei bendrovei-valdytojai raštu patvirtinę savo kaip informuotųjų investuotojų statusą ir kurie atitinka bent vieną iš šių reikalavimų:</p> <p>a) į kolektyvinio investavimo subjektą investuoja arba įsipareigoja investuoti ne mažiau kaip 125 000 eurų ar ekvivalentišką sumą kita valiuta arba</p> <p>b) juridinis asmuo (arba analogiškas kitos valstybės narės subjektas), turintis teisę teikti investicines paslaugas Lietuvos Respublikoje, surinkęs ir įvertinęs Finansinių priemonių rinkų įstatymo 30 straipsnio 1 dalyje nurodytą informaciją, raštu patvirtino, kad kolektyvinio investavimo subjekto vertybiniai popieriai yra tinkami tam asmeniui atsižvelgiant į jo toleranciją rizikai ir galimybes prisiimti nuostolius;</p>	3
<p>profesionaliųjų investuotojų statuso neturintys fiziniai asmenys, kurie yra kolektyvinio investavimo subjekto, į kurį investuoja arba įsipareigoja investuoti, valdymo įmonės, investicinės bendrovės-valdytojos ar paties kolektyvinio investavimo subjekto vadovai arba valdymo įmonės, investicinės bendrovės-valdytojos ar paties kolektyvinio investavimo subjekto investicinius sprendimus priimančios darbuotojai (fiziniai asmenys) (tuo atveju, kai yra sudarytas kolegialus investicinius sprendimus dėl turto valdymo priimančias organas, – kiekvienas jį sudarantis asmuo) (toliau – investicinius sprendimus priimančias asmuo)</p>	
<p>profesionaliųjų investuotojų statuso neturintys juridiniai asmenys, kurių pagrindinė veikla nėra investavimas į kolektyvinio investavimo subjektus, jeigu jie valdymo įmonei ar investicinei bendrovei-valdytojai yra raštu patvirtinę savo kaip informuotųjų investuotojų statusą ir kurie atitinka bent vieną iš šių reikalavimų:</p> <p>a) į kolektyvinio investavimo subjektą investuoja arba įsipareigoja investuoti ne mažiau kaip 125 000 eurų ar ekvivalentišką sumą kita valiuta arba</p> <p>b) juridinis asmuo (arba analogiškas kitos valstybės narės subjektas), turintis teisę teikti investicines paslaugas Lietuvos Respublikoje, surinkęs ir įvertinęs Finansinių priemonių rinkų įstatymo 30 straipsnio 1 dalyje nurodytą informaciją, raštu patvirtino, kad kolektyvinio investavimo subjekto vertybiniai popieriai yra tinkami tam asmeniui atsižvelgiant į jo toleranciją rizikai ir galimybes prisiimti nuostolius.</p>	3 1

Per ataskaitinį laikotarpį išplatintų (konvertuojant pinigus į vienetus) ir išpirktų (konvertuojant vienetus į pinigus) vienetų skaičius ir vertė. Kai vienetai yra skirtingų klasių, duomenys pateikiami pagal klases.

	Ataskaitinis laikotarpis 2020 m. I pusmetis	
	Apskaitos vienetų skaičius	Vertė, EUR
Išplatintų apskaitos vienetų skaičius (konvertuojant pinigus į vienetus)	-	-
Išpirktų apskaitos vienetų skaičius (konvertuojant vienetus į pinigus)	-	-
Išplatinta vienetų už nepiniginį įnašus	-	-
Išpirkta vienetų atsiskaitant turtu	-	-
Skirtumas tarp išplatintų ir išpirktų vienetų skaičiaus ir vertės	-	-

Investicijų portfelio struktūra

2020 m. I pusmetis

Emitento pavadinimas	Šalis	ISIN kodas	Kiekis, vnt.	Bendra įsigijimo vertė	Bendra rinkos vertė	Balsų dalis emitente, %	Dalis GA, %
Nuosavybės vertybiniai popieriai, kuriais prekiaujama reguliuojamose rinkose							
AB Telia Lietuva	LT	LT0000123911	130 185	101 414	183 561	0,0223	5,41
AB Inter Rao Lietuva	LT	LT0000128621	118 767	432 207	416 152	0,5938	12,26
UAB East West Agro	LT	LT0000132060	6 400	96 000	35 840	0,6400	1,06
AB Šiaulių bankas	LT	LT0000102253	80 000	38 590	32 640	0,0133	0,96
ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	US	US01609W1027	50	9 240	9 558	0,0000	0,28
ISHARES CORE EURO STOXX 50	IE	IE00B53L3W79	200	18 720	21 224	0,0006	0,63
LHV GROUP COMMON SHARE	EE	EE3100073644	1 000	10 750	13 150	0,0035	0,39
SPDR S&P 500 ETF TRUST	US	US78462F1030	80	19 926	21 862	0,0000	0,64
Iš viso:	-	-	336 682	726 847	733 987	-	21,63
Nuosavybės vertybiniai popieriai, kuriais reguliuojamose rinkose neprekiuojama							
-	-	-	-	-	-	-	-
Iš viso:	-	-	-	-	-	-	-
Kiti nuosavybės vertybiniai popieriai							
-	-	-	-	-	-	-	-
Iš viso:	-	-	-	-	-	-	-
Iš viso nuosavybės vertybinių popierių:	-	-	336 682	726 847	733 987	-	21,63

Emitento pavadinimas	Šalis	ISIN kodas	Kiekis, vnt.	Bendra įsigijimo vertė	Bendra rinkos vertė	Palūkanų norma	Išpirkimo/konvertavimo data	Dalis GA, %
Ne nuosavybės vertybiniai popieriai, kuriais prekiaujama reguliuojamose rinkose								
-	-	-	-	-	-	-	-	-
Iš viso:	-	-	-	-	-	-	-	-
Ne nuosavybės vertybiniai popieriai, kuriais reguliuojamose rinkose neprekiuojama								
-	-	-	-	-	-	-	-	-
Iš viso:	-	-	-	-	-	-	-	-
Iš viso ne nuosavybės vertybinių popierių:	-	-	-	-	-	-	-	-

Emitento pavadinimas	Šalis	ISIN kodas	Kiekis, vnt.	Bendra įsigijimo vertė	Bendra rinkos vertė	KIS tipas*	Dalis GA, %
Kolektyvinio investavimo subjektų įstatymo 79 str. 1 d. reikalavimus atitinkančių kolektyvinio investavimo subjektų (KIS) vienetai							
Diversified RE Fund A class	LT	-	3 050	305 000	300 729	KIS 5	8,86
London Property Fund	LT	LTIF00000658	6 661	950 000	785 547	KIS 5	23,15
Lords LB Special Fund V	LT	LTIF00000682	500 000	500 000	796 750	KIS 5	23,48
Orion RE Income Fund B class	LT	-	464	50 000	62 873	KIS 5	1,85
Iš viso:	-	-	510 175	1 805 000	1 945 899		57,34
Kitų kolektyvinio investavimo subjektų vienetai							
-	-	-	-	-	-	-	-
Iš viso:	-	-	-	-	-	-	-
Iš viso KIS vienetų:	-	-	510 175	1 805 000	1 945 899		57,34

* Nurodyti KIS tipą:

KIS 1 – KIS, kurių investavimo strategijoje numatyta iki 100 proc. grynujų aktyvų investuoti į ne nuosavybės vertybinių popierius;

KIS 2 – KIS, kurių investavimo strategijoje numatytas mišrus (subalansuotas) investavimas;

KIS 3 – KIS, kurių investavimo strategijoje numatyta iki 100 proc. grynujų aktyvų investuoti į nuosavybės vertybinius popierius;

KIS 4 – KIS, kurių investavimo strategijoje numatyta iki 100 proc. grynujų aktyvų investuoti į pinigų rinkos priemones;

KIS 5 – visų kitų rūšių KIS (alternatyvaus investavimo, privataus kapitalo, nekilnojamojo turto, žaliavų ir kt.).

Pastaba. Investuojant į fondų fondus, juos priskirti tam tikrai KIS grupei pagal fondų investavimo strategiją

Banko pavadinimas	Šalis	Valiuta	Bendra rinkos vertė, EUR	Dalis GA, %
Pinigai:				
„Swedbank“, AB	LT	EUR	709 922	20,92
„Swedbank“, AB	LT	USD	10 379	0,31
Iš viso pinigų:			720 301	21,23

ATSAKINGI ASMENYS

Ataskaitą parengusių asmenų vardai, pavardės, pareigos, darbovietė (jeigu ataskaitą rengė asmenys nėra bendrovės darbuotojai).

UAB "Orion Asset Management" generalinis direktorius Mantas Skipitis.

UAB "Orion Asset Management" vyr.finansininkas Dainius Minelga.

Valdymo įmonės administracijos vadovo, vyriausiojo finansininko, ataskaitą rengusių asmenų ir konsultantų parašai ir patvirtinimas, kad joje pateikta informacija teisinga ir nėra nutylėtų faktų, galinčių daryti esminę įtaką pateikiamų rodiklių vertėms.

UAB "Orion Asset Management"

Generalinis direktorius Mantas Skipitis _____

UAB "Orion Asset Management"

Vyr.finansininkas Dainius Minelga _____

Asmenys, atsakingi už ataskaitoje pateiktą informaciją.

už ataskaitą atsakingi įmonės valdymo organų nariai, darbuotojai ir administracijos vadovas (nurodomi vardai pavardės, telefonų ir faksų numeriai, el. pašto adresai).

UAB "Orion Asset Management" generalinis direktorius Mantas Skipitis. Tel. +37052032699. El. pašto adresas msk@orion.lt.

UAB "Orion Asset Management" vyr.finansininkas Dainius Minelga. Tel. +37052032699. El. pašto adresas dm@orion.lt.

jeigu ataskaitą rengia konsultantai arba ji rengiama padedant konsultantams, nurodyti konsultantų vardus, pavardes, telefonų ir faksų numerius, el. pašto adresus (jeigu konsultantas yra juridinis asmuo, nurodyti jo pavadinimą, telefonų ir faksų numerius, el. pašto adresą bei konsultanto atstovo (-ų) vardą, pavardę); pažymėti, kokias konkrečias dalis rengė konsultantai arba kokios ataskaitos dalys parengtos jiems padedant, bei nurodyti konsultantų atsakomybės ribas.

Konsultantų paslaugomis ruošiant ataskaitas nebuvo naudotasi.