OMX BALTIC BENCHMARK FUND

Mėnesinė fondo ataskaita | Lapkritis 2021

am-orion-lt

Apie fondą

Pirmasis atviro tipo investicinis fondas platintamas Lietuvoje, kuris pradėjo savo veiklą 2001 m. balandžio 9 d. Fondas investuoja Baltijos regione į NASDAQ OMX Baltic biržose listinguojamas bendroves

Fondo informacija

Kodai	
ISIN kodas	LT0000990012
Bloomberg tikeris	OAMOBBF1L LH
Indekso Bloomberg tikeris	OMXBBGI
Fondo tipas	
UCITS III suderinamumas	Taip
Teisinė forma	UCITS, IKKB
Portfelio sudėtis	Akcijos ir grynieji pinigai
Įsteigimo data	2001 04 09
Valdymo įmonė	Orion Asset Management
Prižiūrinti institucija	Lietuvos Bankas
Depozitoriumas	AB SEB bankas
Atsiskaitymo data	T + 2
Dividendai	Nėra (reinvestuojami)
Investavimo periodas	2-5 metai
Rinkos formuotojas	Orion Securities

Mokesčiai

Valdymo mokestis	1.0%
Platinimo mokestis**	2.0%
Išpirkimo mokestis**	1.0%

** - Šių mokesčių nėra, jei fondo vienetais prekiaujama biržoje

Pagrindiniai rodikliai

Rodiklis	Indeksas	Fondas
Pozicijų skaičius	24	24
Standartinis nuokrypis	14.81%	13.89%
Alpha		-1.78%
Beta		0.94
Sharpe rodiklis	3.29	3.10

Koreliacijos koeficientas	0.987
Metinė sekimo paklaida	1.77%
Portfelio apyvartumo rodiklis	17.15%
Bendrasis išlaidų koeficientas	3.11%
Vidutinė metinė grąža	8.71%

Kontaktai

Adresas	A. Tumėno g. 4, Vakarų įėjimas, 12 aukštas, LT-01109 Vilnius, Lietuva
El. paštas	info@orionam.lt
Interneto svetainė	www.orionam.lt

10 didžiausių pozicijų, %

LHV Group	27%
AB Ignitis grupė	14%
AB Šiaulių bankas	13%
Tallinna Sadam	5%
Tallinna Kaubamaja	5%
Tallink Grupp	5%
AB Telia Lietuva	5%
Coop Pank share	4%
Tallina Vesi	3%
Harju Elekter	3%

Fondo informacija

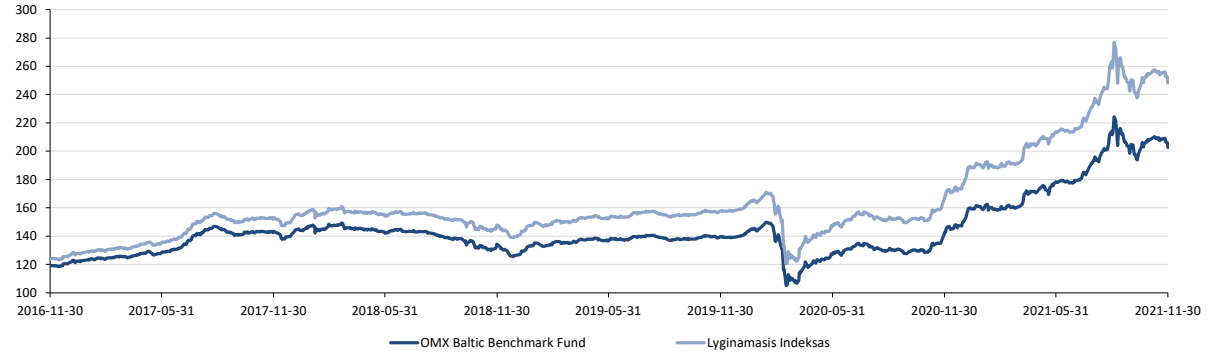
Grynoji aktyvų vertė	2.45 mln.
Fondo vieneto vertė, EUR	15.5284
Fondo valiuta	EUR

Naujausi rezultatai, %

Periodas	NMP[1]	1 mėn	3 mėn	6 mėn	1m	3m	5m	Nuo įsteigimo
Fondas	35.24	-2.32	-4.25	13.66	42.99	50.96	70.73	461.03
Indeksas	40.46	-2.31	-4.07	16.04	48.78	67.73	100.80	294.51

1 -pokytis nuo metų pradžios

Fondo vienetų vertės pokyčiai

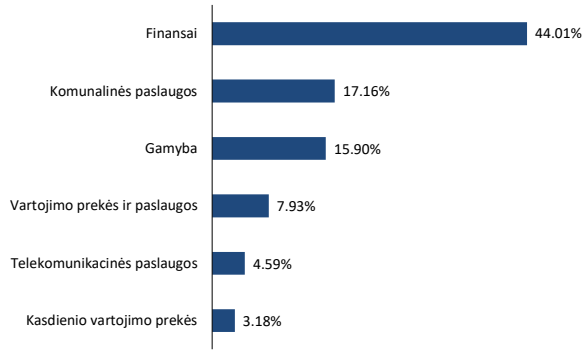


Istoriniai rezultatai, %

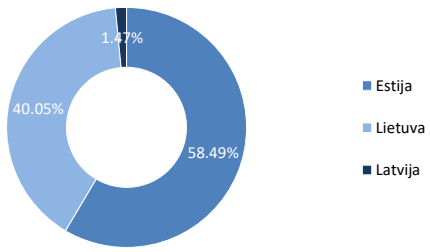
	2001*	2002	2003	2004	2005	2006	2007	2008	2009	2010	2011	2012	2013	2014	2015	2016	2017	2018	2019	2020
Fondas	-6.75	0.54	83.82	49.19	34.23	4.98	8.69	-67.69	38.82	54.65	-24.58	23.45	9.44	-8.87	11.64	18.10	16.80	-10.51	10.40	7.08
Indeksas	-12.69	12.20	105.80	68.18	52.93	9.78	4.38	-65.14	46.04	56.49	-19.11	26.63	12.16	-7.65	14.43	21.57	19.78	-7.44	12.84	11.27

* - rezultatas nuo 2001-04-09

Turto alokacija pagal sektorius (GICS)



Turto alokacija pagal valstybę



Svarbi informacija

OMX Baltic Benchmark Fund gali neatitikti visų investuotojų poreikių. Valdymo įmonė neatsako už Fondo kainos pokyčius, priklausančius nuo rinkos. Fondo praeities rezultatai negarantuoja ar jokiu kitu būdu neveikia ateities rezultatų. Taip pat valdymo įmonė ir (arba) susijusios bendrovės ir (arba) jų darbuotojai tam tikru metu gali turėti fondo vienetų arba bet kurių šiame dokumente paminėtų bendrovių akcijų bei gali įgalioti kitus asmenis ar jiems gali būti patikėta pirkti ar parduoti šias akcijas.
OMX Baltic Benchmark Fund yra investicinė kintamojo kapitalo bendrovė, kurios veiklą sankcionuoja ir reguliuoja Lietuvos Respublikos Centrinis Bankas. Šis dokumentas leidžiamas tik informaciniais tikslais ir nėra suformuluotas kaip pasiūlymas, rekomendacija ar kvietimas pirkti (parduoti) Fondo akcijas. Rekomenduojama peržvelgti Fondo prospektą ir įstatus prieš priimant investicinį sprendimą investuoti į Fondą.