OMX BALTIC BENCHMARK FUND

Mėnesinė fondo ataskaita | Spalis 2017

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
Registruotas platinimui	Lietuva, Švedija, Norvergija
Depozitoriumas	AB SEB bankas
Atsiskaitymo data	T + 2
Dividendai	Nėra (reinvestuojami)
Investavimo periodas	2-5 metai
Rinkos formuotojas	Orion Securities

Mokesčiai

Valdymo mokestis	1,00%
Platinimo mokestis**	2,00%
Išpirkimo mokestis**	1,00%

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

Pagrindiniai rodikliai

Rodiklis	Indeksas	Fondas
Pozicijų skaičius	28	29
Standartinis nuokrypis (1m)	5,69%	5,67%
Alpha (12 mėn.)		-2,01%
Beta (12 mėn.)		0,98
Sharpe (12 mėn.)	4,27	3,73

Koreliacijos koeficientas	0,999
Metinė sekimo paklaida (12 mėn.)	0,82%
Portfelio apyvartumo rodiklis (2016)	26,49%
Bendrasis išlaidų koeficientas (2016)	2,10%
Vidutinė metinė grąža	8,63%

Kontaktai

Adresas	A.Tumėno g. 4, 11 aukštas, LT-01109 Vilnius, Lietuva
El. paštas	oam@orion.lt
Interneto svetainė	am.orion.lt

10 didžiausių pozicijų, %

AS Tallink Group	EE	14,98
AB Šiaulių bankas	LT	10,45
LHV Group	EE	10,32
Tallinna Kaubamaja	EE	8,36
Olympic Entertainment Group	EE	6,94
AS Tallina Vesi	EE	5,00
AB Telia Lietuva	LT	4,48
Silvano Fashion Group	EE	3,67
Harju Elekter	EE	3,43
AS Merko Ehitus	EE	3,18

Fondo informacija

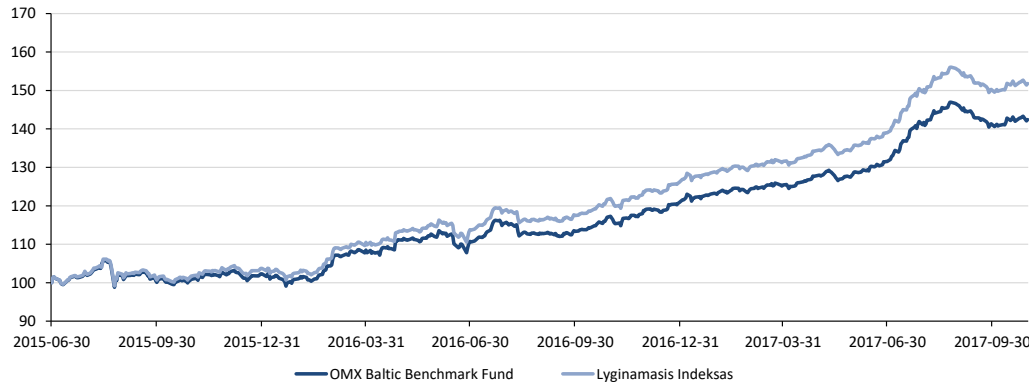
Grynoji aktyvų vertė	2,63 mln.
Fondo vieneto vertė	10,9148
Fondo valiuta	EUR

Naujausi rezultatai, %

Periodas	YTD[1]	1 mėn	3 mėn	6 mėn	1y	3y	5y	ITD[2]
Fondas	17,89	0,77	0,96	11,51	21,43	53,34	64,80	294,34
Indeksas	20,41	1,01	1,48	13,07	24,51	65,88	85,58	658,92

1 -pokytis nuo metų pradžios, 2 - pokytis nuo įsteigimo

Fondo vienetų vertės pokyčiai

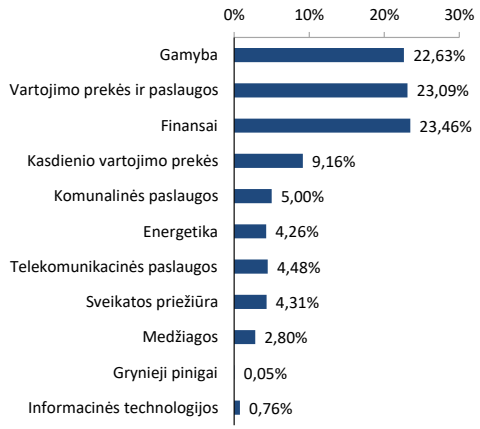


Istoriniai rezultatai, %

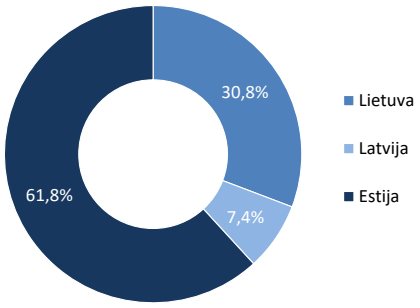
	2001*	2002	2003	2004	2005	2006	2007	2008	2009	2010	2011	2012	2013	2014	2015	2016
Fondas	-6,42	0,54	83,82	49,19	34,23	4,98	8,69	-67,69	38,82	54,65	-24,58	23,45	9,44	-8,87	11,64	18,10
Indeksas	-12,69	12,20	105,80	68,18	52,93	9,78	4,38	-65,14	46,04	56,49	-19,11	26,63	12,16	-7,65	14,43	21,57

* - rezultatas nuo 2001-04-09

Turto alokacija pagal sektorius (GICS)



Turto alokacija pagal valstybę



Svarbi informacija

OMX Baltic Benchmark Fund gali neatitikti visų investuotojų poreikų. 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.