

# OMX BALTIC BENCHMARK FUND

Mėnesinė fondo ataskaita I Lapkritis 2018

am-orion.lt

## Apie fonda

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 bendrovės

## Fondo informacija

### Kodai

ISIN kodas LT0000990012  
Bloomberg tikeris OAMOBBF1L LH  
Indeksas Bloomberg tikeris OMXXBGI

### Fondo tipas

UCITS III suderinamumas	Taip
Teisinė forma	UCITS, IKKB
Portfelio sudėtis	Akcijos ir grynijų pinigai
Jsteigimo data	2001 04 09
Valdymo įmonė	Orion Asset Management
Prižiūrinti institucija	Lietuvos Bankas
Platinimas	Lietuva, Švedija, Norvegija
Depozitoriumas	AB SEB bankas
Atsiskaitymo data	T + 2
Dividendai	Nėra (reinvestuojami)
Investavimo periodas	2-5 metai
Rinkos formuotojas	Orion Securities

### Mokesčiai

Valdymo mokesčis	1,0%
Platinimo mokesčis**	2,0%
Išpirkimo mokesčis**	1,0%

\*\* - Šių mokesčių nėra, jei fondo vienetais prekiavama biržoje

## Pagrindiniai rodikliai

Rodiklis	Indeksas	Fondas
Pozicijų skaičius	27	28
Standartinis nuokrypis	8,54%	8,44%
Alpha	-3,13%	
Beta	1,00	
Sharpe rodiklis	-0,38	-0,75
Koreliacijos koeficientas	0,993	
Metinė sekimo paklaida	1,00%	
Portfelio apyvartumo rodiklis	7,49%	
Bendrasis išlaidų koeficientas	2,21%	
Vidutinė metinė grąža	7,72%	

## 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	19,81
Tallinna Sadam	11,89
AB Šiaulių bankas	11,34
LHV Group	10,78
Tallinna Kaubamaja	7,61
AB Telia Lietuva	5,08
AS Tallina Vesi	3,88
Harju Elekter	3,13
AS Merko Ehitus	3,01
Silvano Fashion Group	2,94

## Fondo informacija

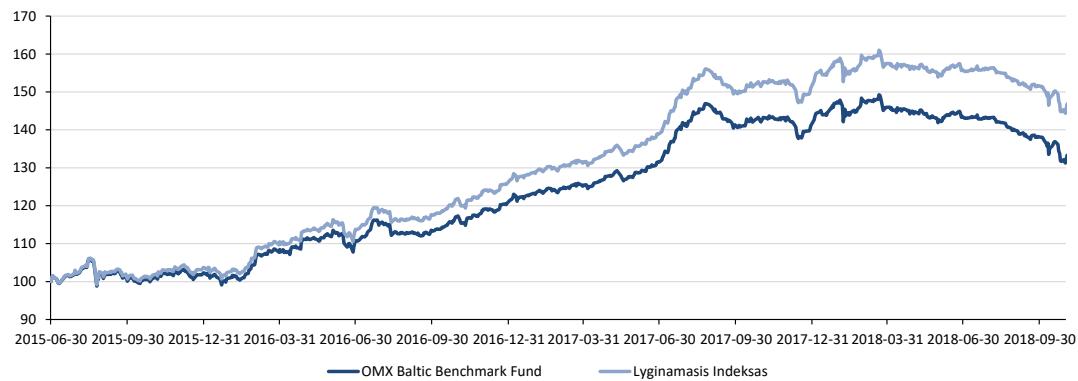
Grynoji aktyvų vertė	2,46 mln.
Fondo vieneto vertė, EUR	10,2867
Fondo valiuta	EUR

## Naujausi rezultatai, %

Periodas	NMP <sup>1</sup>	1 mėn	3 mėn	6 mėn	1m	3m	5m	Nuo jsteigimo
Fondas	-4,88	2,28	-4,03	-5,40	-6,31	31,52	29,77	271,65
Indeksas	-2,01	2,48	-3,33	-3,86	-3,28	43,42	46,94	642,34

1 - pokytis nuo metų pradžios

## Fondo vienetu vertės pokyčiai

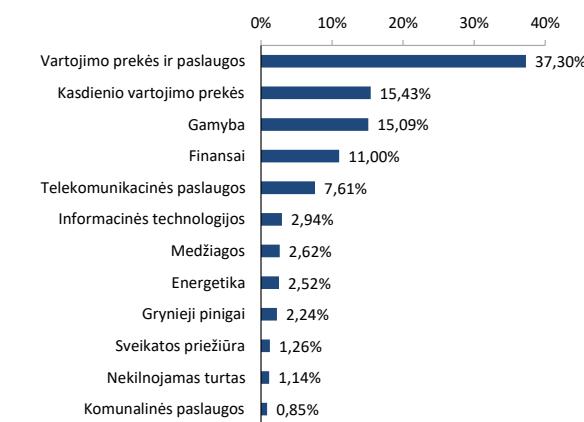


## Istoriniai rezultatai, %

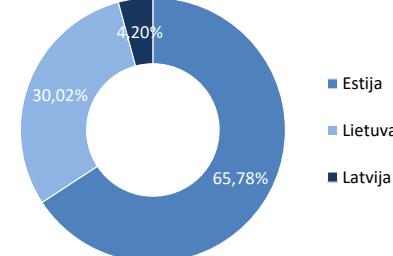
	2001*	2002	2003	2004	2005	2006	2007	2008	2009	2010	2011	2012	2013	2014	2015	2016	2017
Fondas	-6,75	0,54	83,82	49,19	34,23	4,98	8,69	-67,69	38,82	54,65	-24,58	23,45	9,44	-8,87	11,64	18,10	16,80
Indeksas	-12,69	12,20	105,80	68,18	52,93	9,78	4,38	-65,14	46,04	56,49	-19,11	26,63	12,16	-7,65	14,43	21,57	19,78

\* - 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, priklausantius nuo rinkos. Fondo praeities rezultatai negarantuoja ar jokiui kitu būdu neveikia ateities rezultatų. Taip pat valdymo įmonė ir (arba) susijusios bendrovės ir (arba) jų darbuotojai tam tikru metu gali turėti fondo vienetu arba bet kuriu šiame dokumente paminėtu bendrovės akcijų bei gali išgalioti kitus asmenis ar jiems gali būti patikėta pirkti ar parduoti šias akcijas.

OMX Baltic Benchmark Fund yra investinė kintamojo kapitalo bendrovė, kurios veiklą sankcionuoja ir reguliuoja Lietuvos Respublikos Centrinis Bankas. Šis dokumentas leidžiamas tik informaciniais tikslais ir néra suformuluotas kaip pasiūlymas, rekomendacija ar kvietimas pirkti (parduoti) Fondo akcijas. Rekomenduojama peržvelgti Fondo prospektą ir įstatus prieš priimant investicinį sprendimą investuoti į Fondą.