

Baltic Corporate Bond Fund

2023 birželis



Obligacijų krepšelio pajamingumas **10.17%**



Svertinė likutinė trukmė **2.87** metai



Viso fondo turto pajamingumas **10.25%**



Fondo vieneto vertė **109.3584**

Mėnesio veiklos apžvalga

Per 2023 metų birželį fondas sudarė 49 pirkimo ir pardavimo sandorius, kurių bendra apyvarta siekė 2.97 mln. eurų, 43 jų buvo atlikti biržoje. Viso Fondas yra investavęs į **40** skirtingas emisijas (**29** emitentai). Listinguotos emisijos sudarė **89.10%** fondo investicinio krepšelio.

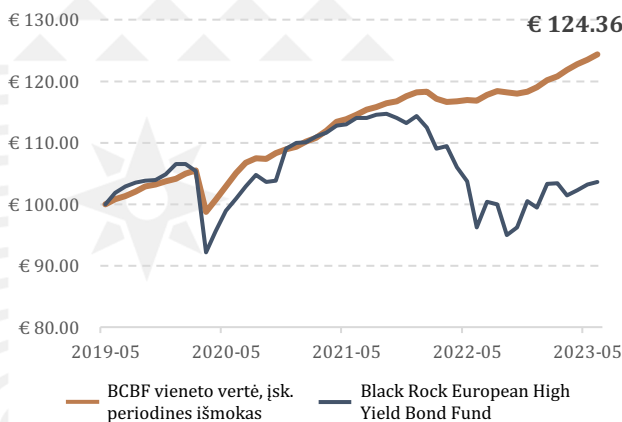
Birželį fondo investicijų krepšelio svertinis pajamingumas, įvertinus turimą 3.66% likvidumą (0.83% grynujų pinigų bei 2.83% LR VVP), siekė **10.17%** per metus. Vidutinė svertinė investicijų trukmė buvo **2.87** metai. Per birželį, iki periodinių išmokų mokėjimo, investicinio vieneto vertė augo **0.84%**. Iš fondo išmokama **0.35%** GAV investuotojams. Po išmokų fondo vieneto vertės pokytis per mėnesį siekė plus **0.49%**.

Birželį fondas investavo į tris naujas emisijas. Už 1.1 mln. eurų įsigyta Šiaulių Banko 10.75% obligacijų, 500 tūkst. eurų investuota į Luminor Bank 7.75% emisiją ir už 250 tūkst. eurų pirktas suomiškos PHM Group 11.05% įmonės obligacijų. Iš fondo birželį, anksčiau termino, išpirkta 500 tūkst. eurų nominalios vertės Luminor Bank 0.792% obligacijų emisija.

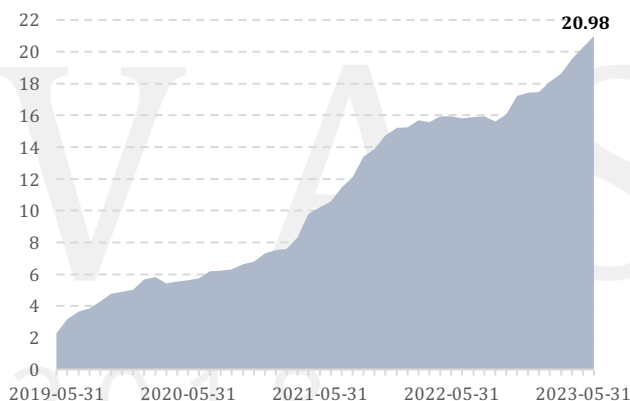
Per mėnesį reikšmingų pokyčių Baltijos šalių įmonių obligacijų rinkose nefiksuota. Fondo pelnas sugeneruotas iš aktyvios prekybos bei gautų kuponų. Artimiausioje ateityje svarbių rizikos įvykių nenusimato, todėl tikimės tolimesnio nuosaikais vieneto vertės augimo.

Fondo likvidumas 2023-06-30 siekė 3.66%, įvertinus grynujų pinigų bei LR VVP pozicijas. Įvertinus naujas investicijas į fondą, 5% tikslinis likvidumo lygis atsistatys liepos pradžioje.

Fondo bendroji grąža



Valdomas turtas (mln. EUR)



Istorinė fondo grąža

	1 mėn.	2023 (6 mėn.)	2022	2021	2020	2019 (6 mėn.)
Vieneto vertės pokytis	0.49%	2.84%	-3.28%	4.04%	1.47%	4.13%
Išmokos	0.35%	2.10%	4.20%	4.20%	3.50%	0%
VISO	0.84%	4.94%	0.92%	8.24%	4.97%	4.13%

Baltic Corporate Bond Fund

2023 birėžlis

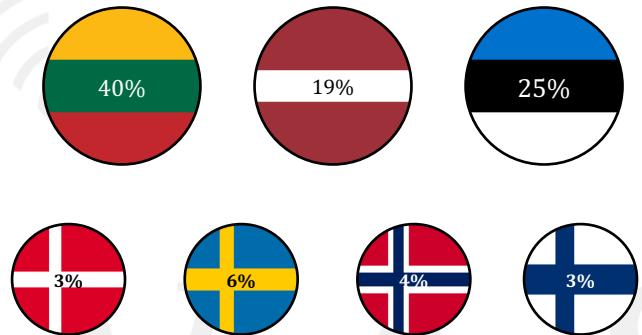
10 didžiausių fondo pozicijų

Pozija	Dalis krepšelio (%)	Pajamingumas	Išpirkimas
Novira 6.5% 2024-05-30	5.49%	6.50%	2024-05-30
AEI Obligacijos 5% 2025-12-14	5.45%	8.68%	2025-12-14
Siauliu Bankas 10.75% 2033.06.22	5.44%	10.64%	2033-06-22
Akropolis Group 06.02.2026	5.42%	8.83%	2026-06-02
airBaltic bonds 30.07.2024	5.25%	15.38%	2024-07-30
Mainor Ūlemiste 8.5% 2027-03-10	5.15%	7.68%	2027-03-10
13% IuteCredit Finance S.à.r.l. (2023)	5.09%	24.70%	2023-08-07
Maxima Group 6.25% 2027-07-12	4.34%	6.65%	2027-07-12
B2Holding ASA 6.9% 2026-09-22	3.82%	11.41%	2026-09-22
Eastnine 5% 08.07.2024	3.45%	8.92%	2024-07-08

Diversifikacija pagal sektorius (%)

Vartojimo finansai	16.75%
Vystymo NT	15.60%
Bankai	13.21%
Srautinis NT	8.88%
Vartojimo prekės	8.73%
Transportas	8.29%
Anticikliniai finansai	8.08%
Atsinaujinanti energetika	5.45%
Likvidumas	3.66%
Kita	11.36%

Diversifikacija pagal valstybę (%)



5 didžiausi mėnesio pokyčiai krepšelyje

Pozija	2023-05-31	2023-06-30	Pokytis (EUR)
Siauliu Bankas 10.75% 2033.06.22	€ -	€ 1,113,584.67	€ 1,113,584.67
LUMINOR BANK 7.75% 08.06.2027	€ -	€ 507,664.25	€ 507,664.25
PHM Group 11.05% 2026-06-19	€ -	€ 253,123.88	€ 253,123.88
Grynieji	€ 617,217.67	€ 170,494.13	€ (446,723.54)
Luminor Bank AS 0,792% 20/24	€ 482,172.05	€ -	€ (482,172.05)



MILVAS