

Baltic Corporate Bond Fund

2023 rugpjūtis



Obligacijų krepšelio pajamingumas **9.19%**



Svertinė likutinė trukmė **2.58** metai



Viso fondo turto pajamingumas **8.39%**



Fondo vieneto vertė **110.5967**

Mėnesio veiklos apžvalga

Per 2023 metų rugpjūtį fondas sudarė 67 pirkimo ir pardavimo sandorius, kurių bendra apyvarta siekė 1.77 mln. eurų, 61 jų buvo atlikti biržoje. Viso Fondas yra investavęs į **40** skirtingų emisijų (**30** emitentų). Listinguotos emisijos sudarė **86.24%** fondo investicinio krepšelio.

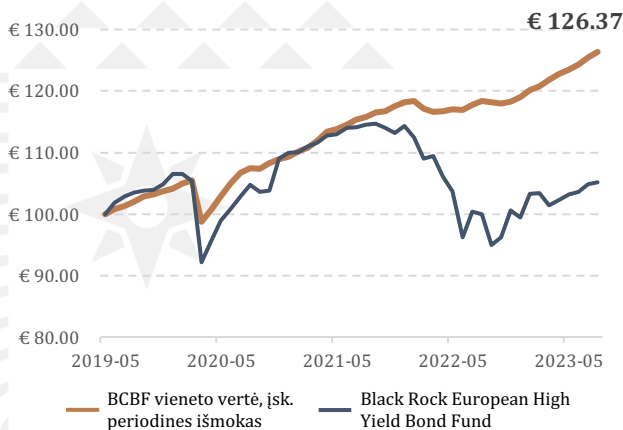
Rugpjūtį fondo investicijų krepšelio svertinis pajamingumas, įvertinus turimą 11.28% likvidumą (8.66% grynujų pinigų bei 2.63% LR VVP), siekė **8.39%** per metus. Vidutinė svertinė investicijų trukmė buvo **2.58** metai. Per rugpjūtį, iki periodinių išmokų mokėjimo, investicinio vieneto vertė augo **0.81%**. Iš fondo išmokama **0.35%** GAV investuotojams. Po išmokų fondo vieneto vertės pokytis per mėnesį siekė plus **0.46%**.

Rugpjūtį fondas už 0.5 mln. eurų įsigijo 9% + 3 mėn. EURIBOR Delfin Group naujai leistų obligacijų. Taip pat 0.4 mln. eurų padidinta Eastnine pozicija. Suėjus terminui, iš fondo išpirkta luteCredit obligacijų už 1 mln. eurų. Ši pozicija buvo viena pirmųjų fondo investicijų, atlikta dar 2019 metų vasarą.

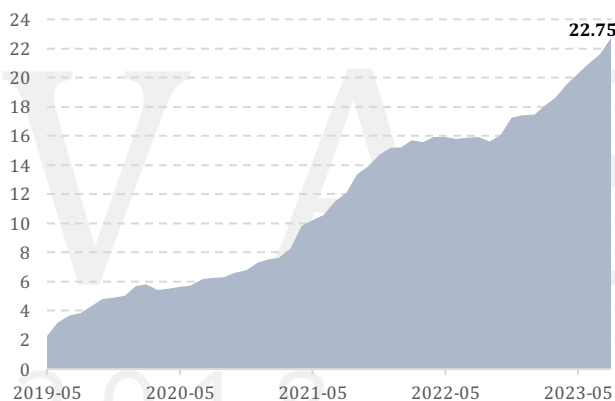
Reikšmingų kainų pokyčių vietinių obligacijų rinkoje rugpjūtį nebuvo. Fondas per vasarą didino likvidumą – istoriškai rudenį pirminė rinka tampa žymiai aktyvesnė, todėl tikimės jau rugsėjį pradėti alokuoti grynuosius į naujas emisijas. Šiuo metu turime bent tris potencialias tikslias įmones, kurių platinimas vyks pirmąjį rudens mėnesį.

Fondo likvidumas 2023-08-31 siekė 11.28%, įvertinus grynujų pinigų bei LR VVP pozicijas.

Fondo bendroji grąža



Valdomas turtas (mln. EUR)



Istorinė fondo grąža

	1 mėn.	2023 (8 mėn.)	2022	2021	2020	2019 (6 mėn.)
Vieneto vertės pokytis	0.46%	4.01%	-3.28%	4.04%	1.47%	4.13%
Išmokos	0.35%	2.80%	4.20%	4.20%	3.50%	0%
VISO	0.81%	6.81%	0.92%	8.24%	4.97%	4.13%

Baltic Corporate Bond Fund

2023 rugpjūtis

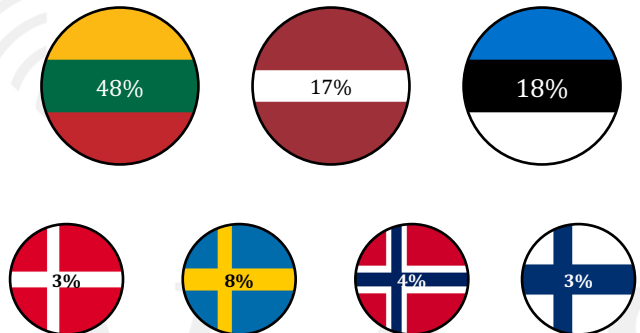
10 didžiausių fondo pozicijų

Pozija	Dalis krepšelio (%)	Pajamingumas	Išpirkimas
Grynieji	8.66%		
AEI Obligacijos 5% 2025-12-14	5.24%	8.26%	2025-12-14
Akropolis Group 06.02.2026	5.21%	8.54%	2026-06-02
Eastnine 5% 08.07.2024	5.18%	6.83%	2024-07-08
Siaulių Bankas 10.75% 2033.06.22	4.80%	10.48%	2033-06-22
Mainor Ūlemiste 8.5% 2027-03-10	4.64%	8.47%	2027-03-10
airBaltic bonds 30.07.2024	4.49%	10.00%	2024-07-30
Novira 6.5% 2024-05-30	4.14%	8.59%	2024-05-30
Maxima Group 6.25% 2027-07-12	3.89%	6.55%	2027-07-12
B2Holding ASA 6.9% 2026-09-22	3.72%	10.70%	2026-09-22

Diversifikacija pagal sektorius (%)

Vartojimo finansai	12.89%
Srautinis NT	16.18%
Bankai	12.28%
Vystymo NT	10.01%
Vartojimo prekės	7.22%
Transportas	7.41%
Anticikliniai finansai	7.72%
Atsinaujinanti energetika	5.24%
Likvidumas	11.28%
Kita	9.78%

Diversifikacija pagal valstybę (%)



5 didžiausi mėnesio pokyčiai krepšelyje

Pozija	2023-07-31	2023-08-31	Pokytis (EUR)
Grynieji	€ 544,400.39	€ 1,887,111.70	€ 1,342,711.31
Delfin Group notes 12.725 2026-02-25	€ -	€ 501,368.30	€ 501,368.30
Eastnine 5% 08.07.2024	€ 699,000.47	€ 1,130,258.80	€ 431,258.33
Novira 6.5% 2024-05-30	€ 1,114,337.46	€ 902,260.00	€ (212,077.46)
13% IuteCredit Finance S.à.r.l. (išpirkimas)	€ 1,057,419.02	€ -	€ (1,057,419.02)



MILVAS