

# Equity and Options Trading Fund

2023-05-31

## Rinkų apžvalga

Per mėnesį S&P 500 indeksas augo 0.25%, Nasdaq 100 vertė didėjo net 7.51%, o Dow Jones Industrial Average krito 3.40%. S&P 500 mėnesio pokytis buvo vidutinis, geresnių mėnesių istoriškai fiksuota 54.35%.

Nuo veiklos pradžios fondo vieneto vertės pokyčiai S&P 500 indeksą lenkia 1.59%. Gegužę fondas sudarė 96 sandorius, 84% realizuotų sandorių buvo pelningi. Mėnesio eigoje rizikos alokacija svyravo tarp 70% ir 95%.

Pagrindine mėnesio tema buvo JAV skolos lubų didinimas. Nors dažniausiai tai tėra techninis procesas – lubos per istoriją didintos daugiau nei 100 kartų – šiemet politinės batalijos JAV beveik privedė prie nemokumo. Situacija išspręsta ir skolos limitas padidintas likus vos kelioms dienoms iki JAV išdui būtų pritrūkę pinigų įsipareigojimams vykdyti.

Toliau stebime neįprastą atsigavimą akcijų rinkoje. Nuo metų pradžios 10 didžiausių S&P 500 indeksą sudarančių įmonių akcijos brango 30-50%. Tačiau likusių 490 kainos per tą patį laikotarpį išliko nepakitusios. S&P 500 sudarančių įmonių akcijų grąžos mediana nuo metų pradžios siekė vos 0.2%. Tad džiaugtis nauja bulių rinka dar ankstoka, didžioji dalis įmonių vis dar gyvena meškų rinkoje.

**Balandį priimtas sprendimas nuo 2023-06-01 dalį investuotojų sąnaudų perkelti valdymo įmonei.**

## Pagrindinė fondo informacija

Vieneto vertė	1.0343 EUR
Valdomas turtas	2.32 mln. EUR
Veiklos pradžia	2022-05-31
Fondo valiuta	EUR
Depozitoriumas	AB SEB bankas

## Istorinė fondo grąža

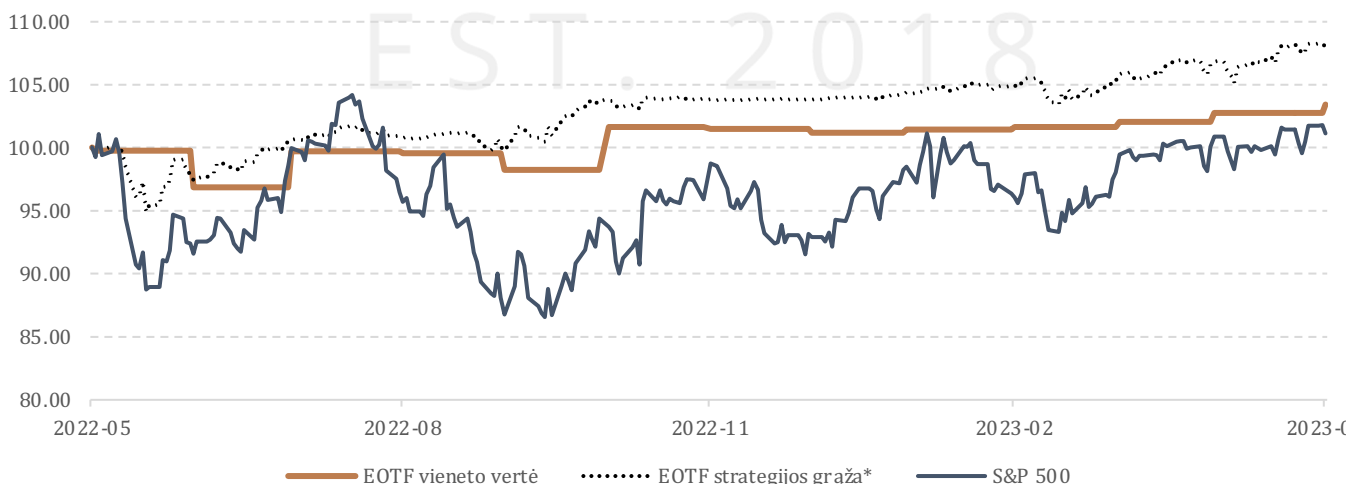
	1 mėn.	3 mėn.	2023	2022
Vieneto vertės pokytis	0.67%	1.75%	2.21%	1.19%

## Veiklos rezultatų palyginimas

Instrumentas	% kainos pokytis	
	Mėnesio	Nuo EOTF veiklos pradžios*
<b>EOTF</b>	<b>0.67%</b>	<b>3.43%</b>
S&P 500	+0.25%	+1.15%

\*veiklos pradžia 2022-05-31

## Fondo investicijų vertės pokyčiai nuo veiklos pradžios



\*Fondo investicinės strategijos grąža iki valdymo, depozitoriumo, audito ir apskaitos mokesčių.

# Equity and Options Trading Fund

2023-05-31

## Fondo rezultatų detali istorija

	Sausis	Vasaris	Kovas	Balandis	Gegužė	Birželis	Liepa	Rugpjūtis	Rugsėjis	Spalis	Lapkritis	Gruodis	VISO
2022					0.9976 -0.24%	0.9686 -2.91%	0.9974 +2.97%	0.9956 -0.18%	0.9824 -1.33%	1.0164 +3.46%	1.0150 -0.14%	1.0119 -0.31%	1.19%
2023	1.0144 +0.25%	1.0165 +0.21%	1.0207 +0.41%	1.0274 +0.66%	1.0343 +0.67%								2.21%

## Svarbiausi fondo veiklos parametrai nuo fondo veiklos pradžios

	EOTF	S&P 500	Nasdaq 100
Didžiausias kritimas nuo piko	5.19%	16.91%	21.65%
Sharpe	0.56	-0.04	0.46
Sortino	0.79	-0.05	0.68
Standartinis nuokrypis	0.42%	1.29%	1.69%
Neigiamas nuokrypis	0.30%	0.89%	1.14%
Koreliacija		0.75	0.69
Beta		0.24	0.17
Alpha		0.04%	0.02%
Vidutinė dienos grąža	0.03%	0.01%	0.06%

## Fondo turto ir išsipareigojimų struktūra

	2023-03-31	2023-04-30	2023-05-31
Grynieji ir jų ekvivalentai	97%	90%	80%
Akcijos	3%	10%	20%
Išsipareigojimai pagal pasirinkimo sandorius	70%	77%	48%

## Didžiausios 10 fondo pozicijų (pagal aktyvus, su kuriais susietos fondo pasirinkimo sandorių pozicijos ir fizinės pozicijos)

Pozicija	Svoris mėnesio pabaigoje	Sektorius	Pozicijos forma
SPY	19.38%	Indeksas	Išsipareigojimas
IWM	17.30%	Indeksas	Išsipareigojimas/fizinė pozicija
QQQ	7.82%	Indeksas	Išsipareigojimas
BRK	5.08%	Diversifikuotas	Išsipareigojimas
TMO	4.20%	Farmacija	Išsipareigojimas/fizinė pozicija
JPM	2.78%	Finansai	Išsipareigojimas
BAC	2.43%	Finansai	Fizinė pozicija
COST	1.95%	Vartojimas	Išsipareigojimas
LMT	1.89%	Industrinis	Išsipareigojimas
CAT	1.67%	Industrinis	Išsipareigojimas