

Equity and Options Trading Fund

2023-07-31

Rinkų apžvalga

Per mėnesį S&P 500 indeksas augo 3.15%, Nasdaq 100 vertė didėjo 3.81%, o Dow Jones Industrial Average kilo 3.35%. S&P 500 mėnesio pokytis buvo didelis, geresnių mėnesių istoriškai fiksuota tik 20.77%.

Liepą fondas sudarė 76 sandorius, 89% realizuotų sandorių buvo pelningi. Mėnesio eigoje rizikos alokacija svyravo tarp 50% ir 90%.

Per liepą rizikingų aktyvų kainos vėl didėjo. Dauguma profesionalių analitikų sutaria, kad šiemet stebimas akcijų kainų augimas fundamentaliai yra sudėtingai paaiškinimas ir tam tikra korekcija būtų sveika. Tačiau investuotojai į analitikų vertinimus nereaguoja.

Liepos trečią savaitę vyko ECB ir FED valdybų susitikimai, per abu iš jų bazinės palūkanos buvo padidintos 0.25%. Būtent to ir tikėjosi rinkos dalyviai.

Mėnesio eigoje didžiausios pasaulio įmonės skelbė pirmo pusmečio veiklos rezultatus. Bendrai situacija nėra džiuginanti. Vartojimo infliacijai mažėjant, o atlyginimams augant toliau traukiasi vidutinė S&P 500 įmonės pelno marža. Teigiamai nustebinusių rezultatų mažiau, nei istoriškai įprasta. O S&P 500 indekso pelno ir vertės santykis vėl šturmuoja aukštumas.

Kintamumo indeksas VIX istorinėse žemumos, tad pasirinkimo sandorių premijos išlieka labai mažos.

Pagrindinė fondo informacija

Vieneto vertė	1.0619 EUR
Valdomas turtas	2.38 mln. EUR
Veiklos pradžia	2022-05-31
Fondo valiuta	EUR
Depozitoriumas	AB SEB bankas

Istorinė fondo grąža

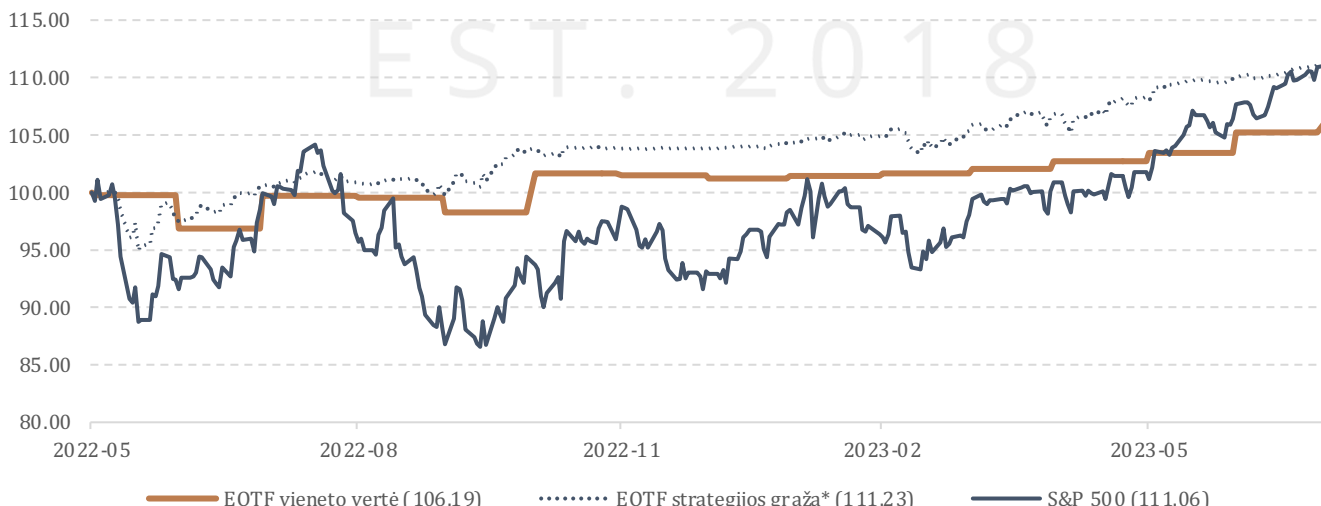
	1 mėn.	3 mėn.	2023	2022
Vieneto vertės pokytis	0.89%	3.36%	4.94%	1.19%

Veiklos rezultatų palyginimas

Instrumentas	% kainos pokytis	
	Mėnesio	Nuo EOTF veiklos pradžios*
EOTF	0.89%	6.19%
S&P 500	+3.15%	+11.09%

*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

2023-07-31

Fondo rezultatų detali istorija

	Sausis	Vasaris	Kovas	Balandis	Gegužė	Birželis	Liepa	Rugpjūtis	Rugsėjis	Spalis	Lapkritis	Gruodis	VISO
2022				1.0000 0%	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%	1.0525 1.76%	1.0619 0.89%						4.94%

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	0.80	0.24	0.62
Sortino	1.13	0.35	0.92
Standartinis nuokrypis	0.39%	1.21%	1.60%
Neigiamas nuokrypis	0.28%	0.83%	1.08%
Koreliacija		0.74	0.67
Beta		0.24	0.17
Alpha		0.04%	0.02%
Vidutinė dienos grąža	0.05%	0.03%	0.08%

Fondo turto ir išsipareigojimų struktūra

	2023-05-31	2023-06-30	2023-07-31
Grynieji ir jų ekvivalentai	80%	94%	98%
Akcijos	20%	6%	2%
Išsipareigojimai pagal pasirinkimo sandorius	48%	35%	48%

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

Pozicija	Svoris mėnesio pabaigoje	Sektorius	Pozicijos forma
SPY	9.97%	Indeksas	Išsipareigojimas
IWM	8.55%	Indeksas	Išsipareigojimas
QQQ	8.29%	Indeksas	Išsipareigojimas
UNH	3.77%	Sveikatingumas	Išsipareigojimas
LMT	3.44%	Industrinis	Išsipareigojimas/fizinė pozicija
JPM	2.84%	Finansai	Išsipareigojimas
BAC	2.43%	Finansai	Išsipareigojimas
URW	1.80%	NT	Išsipareigojimas
CVX	1.71%	Energetika	Išsipareigojimas
KKR	1.67%	Finansai	Išsipareigojimas