

Equity and Options Trading Fund

2023-08-31

Rinkų apžvalga

Per mėnesį S&P 500 indeksas krito **1.73%**, Nasdaq 100 vertė mažėjo **1.62%**, o Dow Jones Industrial Average prarado **2.36%** vertės. S&P 500 mėnesio pokytis buvo didelis, blogesnių mėnesių istoriškai fiksuota tik 22.99%.

Liepą fondas sudarė 95 sandorius, visi realizuoti sandoriai buvo pelningi. Nuo metų pradžios fondas neturėjo nuostolingų mėnesių. Mėnesio eigoje rizikos alokacija svyravo tarp 45% ir 80%.

Rugpjūtį stebėjome akcijų rinkų korekciją. Per pirmas dvi mėnesio savaites didieji indeksai krito 3-5%, antroje mėnesio pusėje situacija stabilizavosi. Agresyvaus centrinių bankų tono ir vidutiniško pirmo pusmečio rezultatų sezono kontekste, rinkose optimizmo lieka vis mažiau.

Atsižvelgiant į tai, kad nuo metų pradžios stebėjome reikšmingą 10 didžiausių JAV įmonių akcijų kainų augimą, kurių santykiniai vertės rodikliai jau istorinėse aukštumose, didesnė dalis fondo turto alokuojama į mažesnes įmones. Taip siekiama sumažinti kintamumą ir užtikrinti pastovų srautą iš pasirinkimo sandorių pardavimo.

Rugsėjį vyks JAV ir Europos centrinių bankų valdybų susitikimai. Rinkos dalyviai tikisi, kad JAV palūkanos nesikeis, o Europoje bus didinamas 0.25%.

Nepaisant techninės korekcijos, kintamumo indeksas VIX išlieka žemumose. Investuotojai materialių rizikos šaltinių trumpuoju laikotarpiu nemato.

Pagrindinė fondo informacija

Vieneto vertė	1.0676 EUR
Valdomas turtas	2.25 mln. EUR
Veiklos pradžia	2022-05-31
Fondo valiuta	EUR
Depozitoriumas	AB SEB bankas

Istorinė fondo grąža

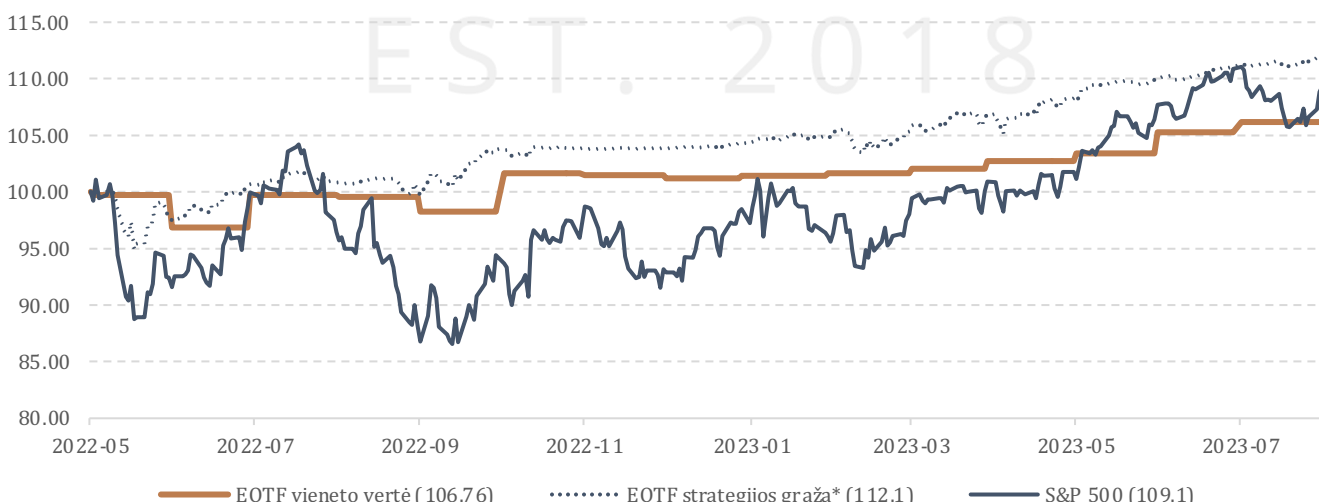
	1 mėn.	3 mėn.	2023	2022
Vieneto vertės pokytis	0.54%	3.22%	5.50%	1.19%

Veiklos rezultatų palyginimas

Instrumentas	% kainos pokytis	
	Mėnesio	Nuo EOTF veiklos pradžios*
EOTF	0.54%	6.76%
S&P 500	-1.73%	+9.10%

*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

2023-08-31

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%	1.0676 0.54%					5.50%

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	0.77	0.19	0.59
Sortino	1.10	0.28	0.87
Standartinis nuokrypis	0.38%	1.18%	1.57%
Neigiamas nuokrypis	0.27%	0.81%	1.06%
Koreliacija		0.74	0.67
Beta		0.24	0.16
Alpha		0.04%	0.02%
Vidutinė dienos grąža	0.03%	0.03%	0.07%

Fondo turto ir išsipareigojimų struktūra

	2023-06-30	2023-07-31	2023-08-31
Grynieji ir jų ekvivalentai	94%	98%	87%
Akcijos	6%	2%	13%
Išsipareigojimai pagal pasirinkimo sandorius	35%	48%	63%

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

Pozicija	Svoris mėnesio pabaigoje	Sektorius	Pozicijos forma
IWM	15.09%	Indeksas	Išsipareigojimas
QQQ	13.45%	Indeksas	Išsipareigojimas
SPY	10.77%	Indeksas	Išsipareigojimas
TMO	4.32%	Farmacija	Išsipareigojimas
UNH	4.08%	Sveikatingumas	Išsipareigojimas
LMT	3.66%	Industrinis	Fizinė pozicija
JPM	2.98%	Finansai	Fizinė pozicija
GOOGL	2.89%	Telekomunikacijos	Išsipareigojimas
MSFT	2.55%	IT	Išsipareigojimas
BAC	2.34%	Finansai	Fizinė pozicija