

Equity and Options Trading Fund

2024-07-31

Rinkų apžvalga

Per mėnesį S&P 500 kilo 1.13%, Nasdaq 100 vertė mažėjo 1.63%, o Dow Jones Industrial Average augo 4.41%. Liepa akcijoms buvo visiškai vidutinė ir pateko tarp 46% geriausių S&P 500 mėnesių istorijoje.

Liepą fondas sudarė 73 sandorius: 38 pardavimo ir 35 pirkimo. Mėnesio eigoje rizikos alokacija padidinta iki 85%.

Liepos pabaigoje akcijų rinkoje išaugo kintamumas. Didieji akcijų indeksai priartėjo prie korekcijos teritorijos: S&P 500 kritimas nuo piko siekė 5%, o Nasdaq 100 net 9%. Akcijų kainų mažėjimą sukėlė trumpalaikiai veiksniai, kurių efektas tikėtina greitai išblės.

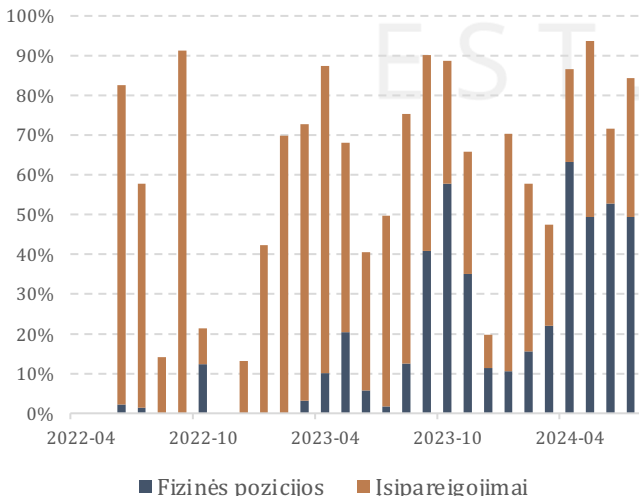
Nepaisant aštraus kainų kritimo akcijų rinkoje, fondo kintamumas išliko žemas. Per mėnesį sugeneruota teigiama grąža, o nuo šių metų pradžios fondas jau uždirbo didesnį pelną, nei per visus 2023 metus (sumetinta 16% grynoji grąža).

Besibaigiantis įmonių ketvirčio rezultatų sezonas didelių netikėtumų nepateikė. Didžioji dalis įmonių skelbia geresnius, nei analitikai prognozavo, finansinius rezultatus. Bendrai per metus S&P 500 įmonių pajamos augo 5.3%, o pelnas didėjo net 11.5%.

Įmonių finansiniai rezultatai rodo JAV ekonomikos stiprumą ir stabilumą. Tai leidžia tikėtis nuosaikaus akcijų kainų augimo vidutiniu laikotarpiu. Ypač įvertinus tai, kad nemažą dalį uždirbamo pelno JAV įmonės skiria savų akcijų supirkimo programoms vykdyti.

Mėnesio pabaigoje išaugusį kintamumą fondas išnaudojo rizikos alokacijos didinimui. Fondas ir toliau ketina išlaikyti sąlyginai aukštą rizikos alokaciją.

Rizikos alokacija



Pagrindinė fondo informacija

Vieneto vertė	1.1714 EUR
Valdomas turtas	2.12 mln. EUR
Veiklos pradžia	2022-07-31
Fondo valiuta	EUR
Depozitoriumas	AB SEB bankas

Istorinė fondo grąža

	1 mėn.	3 mėn.	2024	2023	2022
Vieneto vertės pokytis	0.62%	6.73%	7.79%	7.39%	1.19%

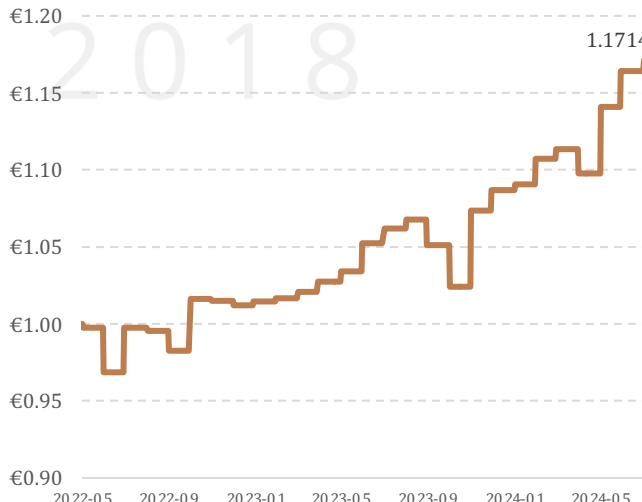
Veiklos rezultatų palyginimas*

	Sharpe rodiklis**	Pelningų mėnesių
EOTF	0.95	66.67%
S&P 500	0.58	65.38%
Nasdaq 100	0.80	65.38%

*nuo fondo veiklos pradžios 2022-05-31

**aukštesnis rodiklis reiškia geresnę grąžos ir rizikos santykį - gaunama didesnė grąža ir prisiimama mažiau rizikos

Vieneto vertės pokyčiai



Equity and Options Trading Fund

2024-07-31

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%	1.0676 +0.54%	1.0510 -1.55%	1.0243 -2.54%	1.0736 +4.81%	1.0867 +1.22%	7.39%
2024	1.0908 +0.38%	1.1074 +1.52%	1.1133 +0.53%	1.0975 -1.42%	1.1411 +3.97%	1.1642 +2.02%	1.1714 +0.62%						7.79%

Svarbiausi fondo veiklos parametrai nuo fondo veiklos pradžios

	EOTF	S&P 500	Nasdaq 100
Didžiausias kritimas nuo piko	5.38%	16.91%	21.65%
Sharpe	0.95	0.58	0.80
Sortino	1.35	0.84	1.18
Standartinis nuokrypis	0.40%	1.02%	1.37%
Neigiamas nuokrypis	0.28%	0.70%	0.93%
Koreliacija		0.75	0.70
Beta		0.29	0.20
Alpha		0.03%	0.03%
Vidutinė dienos grąža	0.04%	0.06%	0.09%

Fondo turto ir įsipareigojimų struktūra

	2024-07-31	2024-06-30	2024-05-31
Grynieji ir jų ekvivalentai	51%	47%	51%
Akcijos (fizinė pozicija)	49%	53%	49%
Įsipareigojimai pagal pasirinkimo sandorius	35%	19%	44%

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

Pozicija	Svoris mėnesio pabaigoje	Sektorius	Pozicijos forma
SPY	25.96%	Indeksas	Fizinė pozicija
QQQ	24.12%	Indeksas	Fizinė pozicija
MSFT	3.67%	IT	Įsipareigojimas
COST	3.50%	Būt. Vartojimas	Įsipareigojimas
AMZN	3.14%	Nebūt. Vartojimas	Įsipareigojimas
DE	3.11%	Industrinis	Įsipareigojimas
HD	3.02%	Nebūt. Vartojimas	Įsipareigojimas
VNA	2.98%	NT	Įsipareigojimas
GOOGL	2.85%	Telekomunikacijos	Įsipareigojimas
BAC	2.65%	Finansai	Įsipareigojimas