

Equity and Options Trading Fund

2024-08-31

Rinkų apžvalga

Per mėnesį S&P 500 kilo 2.28%, Nasdaq 100 vertė augo 1.10%, o Dow Jones Industrial Average didėjo 1.76%. Rugpjūtis akcijoms buvo sąlyginai geras ir pateko tarp 31% geriausių S&P 500 mėnesių istorijoje.

Rugpjūtį fondas sudarė 90 sandorių: 44 pardavimo ir 46 pirkimo. Mėnesio eigoje rizikos alokacija padidinta iki 87%.

Rugpjūtis akcijoms prasidėjo aštriu kritimu. Kai kurie didieji indeksai, kaip pavyzdžiui Nasdaq, net pateko į korekcijos teritoriją po didesnio nei 10% kritimo nuo piko. Tačiau neigiamos nuotaikos neužsilaikė, po staigaus ir reikšmingo kritimo per pirmą savaitę, akcijos atsitiesė ir likusią mėnesio dalį žaliavo.

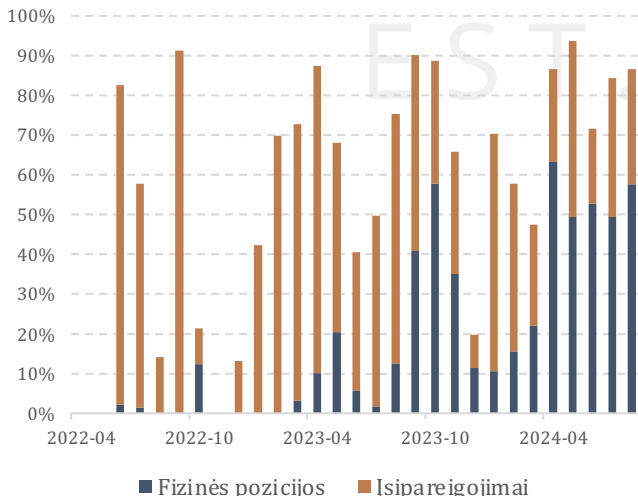
Fondas akcijų kritimo bei išaugusio kintamumo aplinkoje pildė turimas pozicijas. Mėnesio pradžioje rizikos alokacija didėjo iki 100%. Dalis per pirmą mėnesio savaitę atidarytų pozicijų buvo sėkmingai ir pelningai realizuotos mėnesio eigoje.

Aktyvaus darbo dėka, įvertinus valiutos įtaką, fondo grąža praeitą mėnesį lenkė didžiųjų JAV indeksų grąžą. Per rugpjūtį euras prieš dolerį brango net 2.44%, tad pavyzdžiui S&P 500 grąža eurai buvo artima nuliui. Tuo tarpu fondas, su ženkliai mažesniu kintamumu, uždirbo 0.91% mėnesio grąžą.

Rudens pradžioje tikėtina gyvensime padidinto kintamumo aplinkoje: rugsėjį laukia JAV centrinio banko sprendimas dėl palūkanų, taip pat intensyvės JAV prezidento politinės kompanijos batalijos.

Fondas ir toliau ketina išlaikyti sąlyginai aukštą rizikos alokaciją.

Rizikos alokacija



Pagrindinė fondo informacija

Vieneto vertė	1.1821 EUR
Valdomas turtas	2 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	0.91%	3.59%	8.78%	7.39%	1.19%

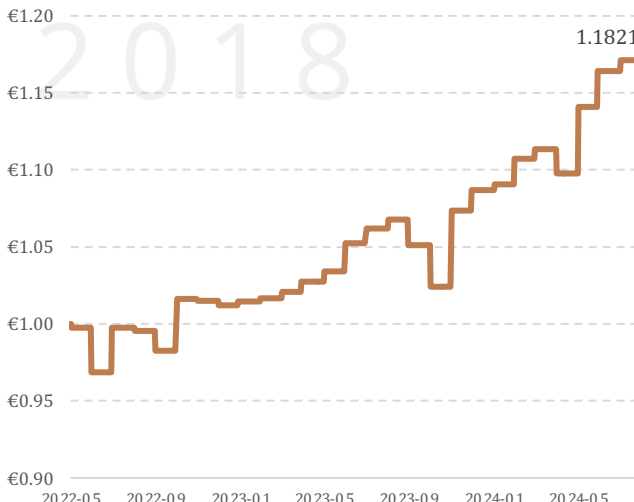
Veiklos rezultatų palyginimas*

	Sharpe rodiklis**	Pelningų mėnesių
EOTF	0.96	67.86%
S&P 500	0.57	66.67%
Nasdaq 100	0.74	66.67%

*nuo fondo veiklos pradžios 2022-05-31

**aukštesnis rodiklis reiškia geresnę grąžos ir rizikos santykį - gaunama didesnę grąžą ir prisiimama mažiau rizikos

Vieneto vertės pokyčiai



Equity and Options Trading Fund

2024-08-31

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%	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%	1.1821 +0.91%					8.78%

Svarbiausi fondo veiklos parametrai nuo fondo veiklos pradžios

	EOTF	S&P 500	Nasdaq 100
Didžiausias kritimas nuo piko	6.51%	16.91%	21.65%
Sharpe	0.96	0.57	0.74
Sortino	1.38	0.82	1.08
Standartinis nuokrypis	0.47%	1.03%	1.38%
Neigiamas nuokrypis	0.33%	0.71%	0.94%
Koreliacija		0.69	0.65
Beta		0.32	0.22
Alpha		0.04%	0.04%
Vidutinė dienos grąža	0.05%	0.05%	0.08%

Fondo turto ir įsipareigojimų struktūra

	2024-08-31	2024-07-31	2024-06-30
Grynieji ir jų ekvivalentai	42%	51%	47%
Akcijos (fizinė pozicija)	58%	49%	53%
Įsipareigojimai pagal pasirinkimo sandorius	29%	35%	19%

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

Pozicija	Svoris mėnesio pabaigoje	Sektorius	Pozicijos forma
SPY	23.87%	Indeksas	Fizinė pozicija
QQQ	20.17%	Indeksas	Fizinė pozicija
LMT	4.70%	Industrinis	Įsipareigojimas
COST	3.70%	Vartojimo prekės	Įsipareigojimas
MSFT	3.53%	IT	Fizinė pozicija
DE	3.13%	Industrinis	Įsipareigojimas
VNA	2.97%	NT	Įsipareigojimas
XOM	2.97%	Energetika	Įsipareigojimas
HD	2.96%	Vartojimo prekės	Įsipareigojimas
AMZN	2.88%	Vartojimo prekės	Įsipareigojimas