

Equity and Options Trading Fund

2024-10-31

Rinkų apžvalga

Per mėnesį S&P 500 krito 0.99%, Nasdaq 100 vertė mažėjo 0.85%, o Dow Jones Industrial Average nukrito 1.34%. Spalis akcijoms buvo sąlyginai blogas ir pateko tarp 30% blogiausių S&P 500 mėnesių istorijoje.

Mėnesio eigoje fondas sudarė 66 sandorius: 35 pardavimo ir 31 pirkimo. Rizikos alokacija svyravo tarp 80-90%.

Beveik visą spalio mėnesį pasaulio akcijos žaliavo. Tačiau paskutinę mėnesio dieną didieji indeksai fiksavo reikšmingus nuostolius, dėl kurių bendras mėnesio rezultatas akcijų rinkoms buvo neigiamas. Spalis užbaigė penkių iš eilės pelningų mėnesių JAV akcijoms periodą.

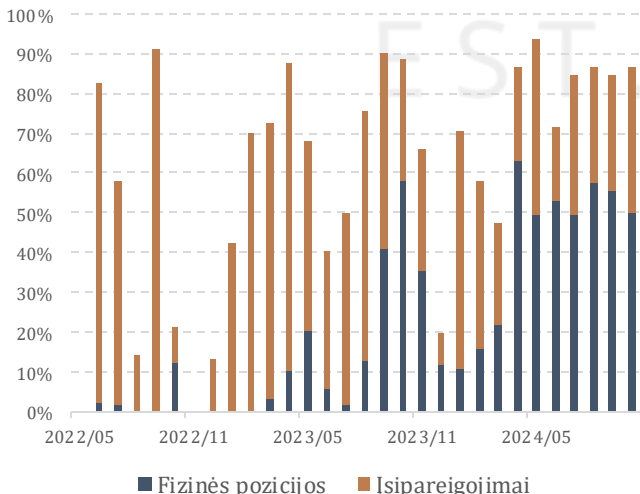
Nors centriniai bankai mažina palūkanų normas, JAV valstybinių obligacijų pajamingumai auga. Rinka vertina su rinkimais susijusias rizikas – tarifai, mažesni mokesčiai ir vietinio JAV verslo skatinimas gali lemti sugrįžtančią infliaciją. Todėl, nepaisant FED nusistatymo ir toliau mažinti palūkanas, ilgalaikiai infliacijos lūkesčiai didėja.

Bendrai rinkos spalio antroje pusėje buvo susikoncentravusios į JAV rinkimus. Tai buvo pagrindinė visų diskusijų tema. Artėjantys rinkimai tikėtina buvo viena esminių mėnesio gale matyto išsipardavimo priežasčių: investuotojai mažino rizikos alokaciją iki paaiškės JAV rinkimų rezultatai.

Nepaisant to, kad akcijų indeksų vertė krito, fondas per spalį (jau šeštą mėnesį iš eilės) investuotojams generavo teigiamą grąžą.

Fondo rizikos alokacija trumpuoju periodu išliks aukšta.

Rizikos alokacija



Pagrindinė fondo informacija

Vieneto vertė	1.1948 EUR
Valdomas turtas	2.01 mln. EUR
Veiklos pradžia	2022-05-31
Fondo valiuta	EUR
Depozitoriumas	AB SEB bankas

Istorinė fondo grąža

	1 mėn.	3 mėn.	2024	2023	2022
Vieneto vertės pokytis	0.18%	2.00%	9.95%	7.39%	1.19%

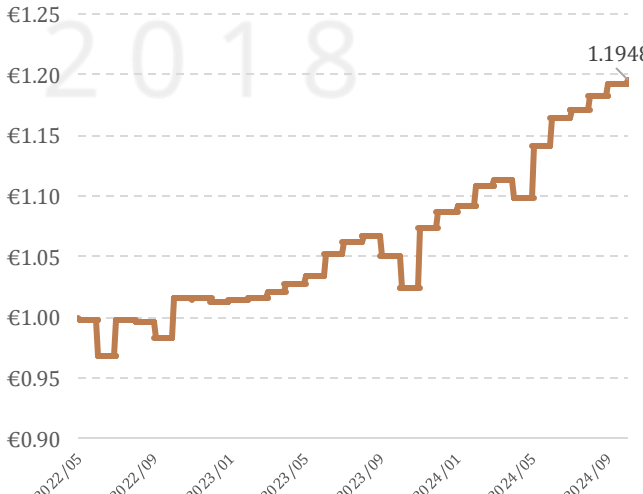
Veiklos rezultatų palyginimas*

	Sharpe rodiklis**	Max kritimas
EOTF	1.10	6.51%
S&P 500	0.73	16.91%
Nasdaq 100	0.89	21.65%

*nuo fon do veiklos pradžios 2022-05-31

**aukštesnis rodiklis reiškia geresnį grąžos ir rizikos santykį – gautama didesnė grąža ir prisiima mažiau rizikos

Vieneto vertės pokyčiai



Equity and Options Trading Fund

2024-10-31

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%	1.1926 +0.89%	1.1948 +0.18%			9.95%

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	1.10	0.73	0.89
Sortino	1.57	1.07	1.31
Standartinis nuokrypis	0.45%	1.01%	1.36%
Neigiamas nuokrypis	0.32%	0.69%	0.93%
Koreliacija		0.76	0.72
Beta		0.34	0.24
Alpha		0.04%	0.03%
Viutinė dienos grąža	0.05%	0.06%	0.09%

Fondo turto ir įsipareigojimų struktūra

	2024-10-31	2024-09-30	2024-08-31
Grynieji ir jų ekvivalentai	50%	45%	42%
Akcijos (fizinė pozicija)	50%	55%	58%
Įsipareigojimai pagal pasirinkimo sandorius	36%	29%	29%

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

Pozicija	Svoris mėnesio pabaigoje	Sektorius	Pozicijos forma
SPY	25.11%	Indeksas	Fizinė pozicija
QQQ	21.37%	Indeksas	Fizinė pozicija
SLB	3.97%	Energetika	Įsipareigojimas
MSFT	3.59%	IT	Fizinė pozicija
BAC	3.56%	Finansai	Įsipareigojimas
VNA	3.46%	NT	Įsipareigojimas
DE	3.44%	Industrinis	Įsipareigojimas
CVX	3.20%	Energetika	Įsipareigojimas
JPM	2.85%	Finansai	Įsipareigojimas
AMZN	2.69%	Vartojimo prekės	Įsipareigojimas