



**Atvirojo tipo informuotiesiems investuotojams skirtas sudėtinis  
investicinis fondas  
„Algorithmic Trading Portfolio“ subfondas „ATP M“**

**2020 METŲ I PUSMEČIO  
VEIKLOS ATASKAITA**

## Bendroji informacija

### 1. Informacija apie fondą:

<b>Pavadinimas</b>	Atvirojo tipo informuotiesiems investuotojams skirtas sudėtinis investicinis fondas „Algorithmic Trading Portfolio“ subfondas „ATP M“
<i>Teisinė forma</i>	Atvirojo tipo informuotiesiems investuotojams skirtas sudėtinis investicinis fondas, neturintis juridinio asmens statuso.
<b>LB pritarimo sudarymo dokumentams data</b>	2012-10-11 / 2020-01-01 (taisiklių pakeitimas).
<b>Dalyvių skaičius</b>	62
<b>Veiklos trukmė</b>	Neterminuota

### 2. Duomenys apie įmonę:

<b>Pavadinimas</b>	Uždaroji akcinė bendrovė „Orion Asset Management“
<b>Kodas</b>	111707985
<i>Buveinė (adresas)</i>	A. Tumėno g. 4, Vilnius
<i>Telefona numeriai, fakso numeriai, el. pašto adresas, interneto svetainės adresas</i>	+370 5 2032699 <a href="mailto:oam@orion.lt">oam@orion.lt</a> <a href="http://www.am.orion.lt">www.am.orion.lt</a>
<i>Leidimo verstis valdymo įmonės veikla numeris</i>	VĮK - 011
<i>Įregistravimo Juridinių asmenų registre data, vieta, kodas</i>	2000 m. rugpjūčio 4 d. LR ūkio ministerijoje; UĮ 2000-205.
<i>Kolektyvinio investavimo subjekto valdytojo vardas, pavardė, pareigos</i>	Fondo valdytojas Aistis Raudys.

### 3. Informacija apie turto saugotoją:

<b>Pavadinimas</b>	AB SEB bankas
<b>Kodas</b>	112021238
<i>Adresas</i>	Gedimino pr. 12, Vilnius
<i>Telefona ir fakso numeriai</i>	+370 5 268 2680; +370 5 268 2682; Faksas: +370 5 268 2683

### 4. Informacija apie auditorius:

<b>Auditoriaus pavadinimas</b>	„Ernst & Young Baltic“, UAB
<i>Adresas</i>	Aukštaičių g. 7, Vilnius
<i>Telefona, fakso numeriai</i>	+370 5 274 2200, +370 5 274 2333

### 5. Ataskaitinis laikotarpis:

<b>Ataskaitinis laikotarpis</b>	2020 m. sausio 1 d. – 2020 m. birželio 30 d.
---------------------------------	--

### Grynujų aktyvų vertė, vienetų skaičius ir vertė ataskaitinio laikotarpio pabaigoje

	Ataskaitinio laikotarpio pabaigoje 2020 m. I pusmetis
Grynujų aktyvų vertė, Eur	4 069 623
A klasės grynujų aktyvų vertė, Eur	2 056 699
A klasės vieneto vertė, Eur	121,5448
A klasės vienetų, esančių apyvartoje, skaičius	16 921
B klasės grynujų aktyvų vertė, Eur	1 044 369
B klasės vieneto vertė, Eur	137,1512
B klasės vienetų, esančių apyvartoje, skaičius	7 615
C klasės grynujų aktyvų vertė, Eur	968 555
C klasės vieneto vertė, Eur	162,7490
C klasės vienetų, esančių apyvartoje, skaičius	5 951

### Fondo įsiskolinimai ataskaitinio laikotarpio pabaigoje

	Ataskaitinis laikotarpis 2020 m. I pusmetis
Už finansinį ir investicinį turtą mokėtinos sumos	-
Valdymo įmonei ir depozitoriumui mokėtinos sumos	4 211
Kitos mokėtinos sumos	-
Sukauptos sąnaudos	19 361
Finansinės skolos kredito įstaigoms	-
Įsipareigojimai pagal išvestinių finansinių priemonių sutartis	-
Kiti įsipareigojimai	-
<b>Viso</b>	<b>23 572</b>

Kategorija	Dalyvių skaičius
Profesionalieji investuotojai	1
Profesionaliųjų investuotojų statuso neturintys fiziniai asmenys, kurie yra valdymo įmonei ar investicinei bendrovei-valdytojai raštu patvirtinę savo kaip informuotųjų investuotojų statusą ir kurie atitinka bent vieną iš šių reikalavimų:  a) į kolektyvinio investavimo subjektą investuoja arba įsipareigoja investuoti ne mažiau kaip 125 000 eurų ar ekvivalentišką sumą kita valiuta arba  b) juridinis asmuo (arba analogiškas kitos valstybės narės subjektas), turintis teisę teikti investicines paslaugas Lietuvos Respublikoje, surinkęs ir įvertinęs Finansinių priemonių rinkų įstatymo 30 straipsnio 1 dalyje nurodytą informaciją, raštu patvirtino, kad kolektyvinio investavimo subjekto vertybiniai popieriai yra tinkami tam asmeniui atsižvelgiant į jo toleranciją rizikai ir galimybes priimti nuostolius;	8
profesionaliųjų investuotojų statuso neturintys fiziniai asmenys, kurie yra kolektyvinio investavimo subjekto, į kurį investuoja arba įsipareigoja investuoti, valdymo įmonės, investicinės bendrovės-valdytojos ar paties kolektyvinio investavimo subjekto vadovai arba valdymo įmonės, investicinės bendrovės-valdytojos ar paties kolektyvinio investavimo subjekto investicinius sprendimus priimančios darbuotojai (fiziniai asmenys) (tuo atveju, kai yra sudarytas kolegialus investicinius sprendimus dėl turto valdymo priimančias organas, – kiekvienas jį sudarantis asmuo) (toliau – investicinius sprendimus priimančias asmuo)	51
profesionaliųjų investuotojų statuso neturintys juridiniai asmenys, kurių pagrindinė veikla nėra investavimas į kolektyvinio investavimo subjektus, jeigu jie valdymo įmonei ar investicinei bendrovei-valdytojai yra raštu patvirtinę savo kaip informuotųjų investuotojų statusą ir kurie atitinka bent vieną iš šių reikalavimų:  a) į kolektyvinio investavimo subjektą investuoja arba įsipareigoja investuoti ne mažiau kaip 125 000 eurų ar ekvivalentišką sumą kita valiuta arba  b) juridinis asmuo (arba analogiškas kitos valstybės narės subjektas), turintis teisę teikti investicines paslaugas Lietuvos Respublikoje, surinkęs ir įvertinęs Finansinių priemonių rinkų įstatymo 30 straipsnio 1 dalyje nurodytą informaciją, raštu patvirtino, kad kolektyvinio investavimo subjekto vertybiniai popieriai yra tinkami tam asmeniui atsižvelgiant į jo toleranciją rizikai ir galimybes priimti nuostolius.	2

Per ataskaitinį laikotarpį išplatintų (konvertuojant pinigų į vienetus) ir išpirktų (konvertuojant vienetus į pinigų) vienetų skaičius ir vertė. Kai vienetai yra skirtingų klasių, duomenys pateikiami pagal klases.

	Ataskaitinis laikotarpis 2020 m. I pusmetis	
	Apskaitos vienetų skaičius	Vertė, EUR
Išplatinta A klasės (konvertuojant pinigines lėšas į investicinius vienetus)	-	-
Išpirkta A klasės (konvertuojant investicinius vienetus į pinigines lėšas)	(3 973)	(513 145)
A klasės vnt. padidėjimas konvertuojant iš kitos klasės	-	-
A klasės vnt. sumažėjimas konvertuojant į kitą klasę	-	-
<b>Skirtumas tarp A klasės išplatintų ir išpirktų vienetų skaičiaus ir vertės</b>	<b>(3 973)</b>	<b>(513 145)</b>
Išplatinta B klasės (konvertuojant pinigines lėšas į investicinius vienetus)	-	-
Išpirkta B klasės (konvertuojant investicinius vienetus į pinigines lėšas)	(384)	(52 866)
B klasės vnt. padidėjimas konvertuojant iš kitos klasės	-	-
B klasės vnt. sumažėjimas konvertuojant į kitą klasę	-	-
<b>Skirtumas tarp B klasės išplatintų ir išpirktų vienetų skaičiaus ir vertės</b>	<b>(384)</b>	<b>(52 866)</b>
Išplatinta C klasės (konvertuojant pinigines lėšas į investicinius vienetus)	-	-
Išpirkta C klasės (konvertuojant investicinius vienetus į pinigines lėšas)	-	-
C klasės vnt. padidėjimas konvertuojant iš kitos klasės	-	-
C klasės vnt. sumažėjimas konvertuojant į kitą klasę	-	-
<b>Skirtumas tarp C klasės išplatintų ir išpirktų vienetų skaičiaus ir vertės</b>	<b>-</b>	<b>-</b>

#### Investicijų portfelio struktūra 2020 m. I pusmetis

Emitento pavadinimas	Šalis	ISIN kodas	Kiekis, vnt.	Bendra įsigijimo vertė	Bendra rinkos vertė	Palūkanų norma	Išpirkimo/konvertavimo data	Dalis GA, %
Ne nuosavybės vertybiniai popieriai, kuriais prekiaujama reguliuojamose rinkose								
-	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>Iš viso:</b>	-	-	-	-	-	-	-	-
Ne nuosavybės vertybiniai popieriai, kuriais reguliuojamose rinkose neprekiuojama								
-	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>Iš viso:</b>	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>Iš viso ne nuosavybės vertybinių popierių:</b>	-	-	-	-	-	-	-	-

Banko pavadinimas	Šalis	Valiuta	Bendra rinkos vertė, EUR	Dalis GA, %
Pinigai:				
AB SEB bankas	LT	EUR	560 582	13,77
AB SEB bankas	LT	USD	221 828	5,45
JP Morgan	USA	USD	1 874 581	46,06
JP Morgan	USA	EUR	1 406 255	34,55
JP Morgan	USA	GBP	29 949	0,74
<b>Iš viso pinigų:</b>	-	-	<b>4 093 195</b>	<b>100,57</b>

## ATSAKINGI ASMENYS

Ataskaitą parengusių asmenų vardai, pavardės, pareigos, darbovietė (jeigu ataskaitą rengė asmenys nėra bendrovės darbuotojai).

*UAB "Orion Asset Management" generalinis direktorius Mantas Skipitis.*

*UAB "Orion Asset Management" vyr.finansininkas Dainius Minelga.*

Valdymo įmonės administracijos vadovo, vyriausiojo finansininko, ataskaitą rengusių asmenų ir konsultantų parašai ir patvirtinimas, kad joje pateikta informacija teisinga ir nėra nutylėtų faktų, galinčių daryti esminę įtaką pateikiamų rodiklių vertėms.

*UAB "Orion Asset Management"*

*Generalinis direktorius Mantas Skipitis \_\_\_\_\_*

*UAB "Orion Asset Management"*

*Vyr.finansininkas Dainius Minelga \_\_\_\_\_*

Asmenys, atsakingi už ataskaitoje pateiktą informaciją.

už ataskaitą atsakingi įmonės valdymo organų nariai, darbuotojai ir administracijos vadovas (nurodomi vardai pavardės, telefonų ir faksų numeriai, el. pašto adresai).

*UAB "Orion Asset Management" generalinis direktorius Mantas Skipitis. Tel.. +37052032699. El. pašto adresas [msk@orion.lt](mailto:msk@orion.lt).*

*UAB "Orion Asset Management" vyr.finansininkas Dainius Minelga. Tel. +37052032699. El. pašto adresas [dm@orion.lt](mailto:dm@orion.lt).*

jeigu ataskaitą rengia konsultantai arba ji rengiama padedant konsultantams, nurodyti konsultantų vardus, pavardes, telefonų ir faksų numerius, el. pašto adresus (jeigu konsultantas yra juridinis asmuo, nurodyti jo pavadinimą, telefonų ir faksų numerius, el. pašto adresą bei konsultanto atstovo (-ų) vardą, pavardę); pažymėti, kokias konkrečias dalis rengė konsultantai arba kokios ataskaitos dalys parengtos jiems padedant, bei nurodyti konsultantų atsakomybės ribas.

*Konsultantų paslaugomis ruošiant ataskaitas nebuvo naudotasi.*