

Investicinės kintamojo kapitalo bendrovės

„OMX Baltic Benchmark Fund“

2012 METŲ I PUSMEČIO

ATASKAITA

Vilnius 2012

I. BENDROJI INFORMACIJA

1. Kolektyvinio investavimo subjekto pavadinimas, teisinė forma, Komisijos pritarimo kolektyvinio investavimo subjekto sudarymo dokumentams data.

Kolektyvinio investavimo subjekto pavadinimas	Investicinė kintamojo kapitalo bendrovė “OMX Baltic Benchmark Fund”
Teisinė forma	Investicinė kintamojo kapitalo bendrovė
Vertybinių popierių komisijos pritarimo kolektyvinio investavimo subjekto sudarymo dokumentams data	2000 m. rugsėjo 14 d. (pritarta memorandumui)

Galiojanti Investicinės kintamojo kapitalo bendrovės licencija Nr.IKB-02 išduota Lietuvos vertybinių popierių komisijos 2004 m. sausio 29 d. sprendimu.

2. Ataskaitinis laikotarpis, už kurį pateikta ataskaita.

2012 sausio 1d. – 2012 birželio 30 d.

3. Valdymo įmonės duomenys:

3.1. pavadinimas ir įmonės kodas.

Uždaroji akcinė bendrovė “Orion Asset Management“.
Įmonės kodas 111707985.

3.2. buveinė (adresas).

A. Tumėno g. 4, Vilnius

3.3. telefono, fakso numeriai, el. pašto adresas, tinklapio adresas.

Telefonas: (8-5) 204-15-41,
Faksas: (8-5) 231-38-40.
Elektroninio pašto adresas: oam@orion.lt
Interneto svetainės adresas: www.orion.lt

3.4. veiklos licencijos numeris.

Veiklos licencijos numeris VĮK - 011.

3.5. kolektyvinio investavimo subjekto valdytojo vardas, pavardė, pareigos (asmuo ar asmenys priimančys investicinius sprendimus).

Valdymas perduotas valdymo įmonei UAB Investicinių bendrovių valdymo įmonė “Orion Asset Management“.

Asmenys, priimančys investicinius sprendimus:
UAB Investicinių bendrovių valdymo įmonė “Orion Asset Management“ generalinis direktorius Rytis Davidovičius.

UAB Investicinių bendrovių valdymo įmonė “Orion Asset Management“ finansų analitikas Vytautas Jurėnas.

4. Depozitoriumo pavadinimas, kodas, adresas, telefono ir fakso numeriai.

Depozitoriumo pavadinimas: AB SEB bankas.
Įmonės kodas: 112021238
Adresas: Gedimino 12, 2600 Vilnius, Lietuva.
Tel.: 8-5-2682680; 8-5-2682682.
Faksas: 8-5-2682683.

II. GRYNŪJŲ AKTYVŲ, INVESTICINIŲ VIENETŲ (AKCIJŲ) SKAIČIAUS IR VERTĖS POKYČIAI

5. Nurodyti grynujų aktyvų, investicinių vienetų (akcijų) skaičius ir vertę.

	Ataskaitinio laikotarpio pradžioje 2011 12 31	Ataskaitinio laikotarpio pabaigoje 2012 06 30	Prieš metus 2011 06 30	Prieš dvejus metus 2010 06 30
Grynujų aktyvų vertė, Lt.	7 576 015 LTL	7 958 475 LTL	9 715 028 LTL	7 030 157 LTL
Investicinio vieneto (akcijos) vertė, Lt	19,6942 LTL*	22,1652 LTL*	23,6868 LTL*	1 890,34 LTL
Investicinių vienetų (akcijų), esančių apyvartoje, skaičius	384 682 vnt.*	359 052 vnt.*	410 146 vnt.*	3 719 vnt.

* 2010 12 29 d. buvo atliktas akcijų skaidymas santykiu 100 už 1. Kaina dalinama iš 100, akcijų skaičius dauginamas iš 100.

6. Nurodyti per ataskaitinį laikotarpį išplatintų ir išpirktų investicinių vienetų ar akcijų skaičių bei vertę.

	Investicinių vienetų (akcijų) skaičius	Vertė, Lt.
Išplatinta (konvertuojant pinigines lėšas į investicinius vienetus)	440	9 020
Išpirkta (konvertuojant investicinius vienetus į pinigines lėšas)	26 070	561 094

III. KOLEKTYVINIO INVESTAVIMO SUBJEKTO IŠLAIDŲ IR APYVARTUMO RODIKLIAI

7. Atskaitymų iš kolektyvinio investavimo subjekto turto rūšys, sumos, procentinė išraiška, bendrasis išlaidų koeficientas, portfelio apyvartumo rodiklis (jei per ataskaitinį laikotarpį keitėsi atskaitymų dydis, pateikti atskirai sumas pagal kiekvieną dydį). Jei yra skaičiuojamas sąlyginis tikėtinas bendrasis išlaidų koeficientas, turi būti pateikiama papildoma informacija, nurodyta taisyklių 42.6 punkte.

Atskaitymai	Atskaitymų dydis		Per ataskaitinį laikotarpį priskaičiuotų atskaitymų suma (LTL)	Per ataskaitinį laikotarpį sumokėta atskaitymų suma (LTL)	Procentinė dalis nuo ataskaitinio laikotarpio vidutinės gryųjų aktyvų vertės
	maksimalus, nustatytas sudarymo dokumentuose	ataskaitiniu laikotarpiu taikytas			
Už valdymą:			40 433	40 185	0,50
Nekintamas mokestis	1% vidutinių metinių aktyvų	1% vidutinių metinių aktyvų	40 433	40 185	0,50
Sėkmės mokestis	-----	-----	-----	-----	-----
Depozitoriumui :			9 525	9 052	0,12
Depozitoriumo mokestis	0.22% vidutinių metinių GAV	0.22% vidutinių metinių GAV	8 895	8 812	0,11
Fiksuotas mokestis	Fiksuotas mokestis už operaciją (10 Lt.)	Fiksuotas mokestis už operaciją (10 Lt.)	630	240	0,01
Už sandorių sudarymą:	Komisiniai – 0,45% (Jeigu sandorio suma viršija 100000 Lt. – 0,35%)	Komisiniai – 0,45% (Jeigu sandorio suma viršija 100000 Lt. – 0,35%)	1 500	1 470	0,02
Už auditą:	-----	-----	6 099	4 840	0,08
Kitos veiklos išlaidos (nurodyti išlaidų rūšis)	-----	-----	12 457	16 490	0,15
Skelbimai ir reklama	-----	-----	3 685	3 685	0,05
Sąnaudos teisiniam konsultantams	-----	-----	998	998	0,01
Nasdaq OMX biržos informacijos sąnaudos	-----	-----	4 175	8 008	0,05
Platinimo mokesčių sąnaudos	-----	-----	1266	1 466	0,01
Banko paslaugos	-----	-----	165	165	0,00
VP sąskaitų tvarkymas	-----	-----	1 419	1 419	0,02

Kancialerinės sąnaudos	-----	-----	749	749	0,01
Išlaidų, įskaičiuojamų į BIK, suma			68 514	70 567	0,85
BIK % nuo GAV*					0,85
Visų išlaidų suma			70 014	72 037	0,87
PAR (praėjusio analogiško ataskaitinio laikotarpio PAR)*					-----

***Rodiklių paaiškinimai:**

Bendrasis išlaidų koeficientas (BIK) – procentinis dydis, kuris parodo, kokia vidutinė subjekto grynųjų aktyvų dalis skiriama jo valdymo išlaidoms padengti. Šios išlaidos tiesiogiai mažina investuotojo investicijų grąžą. Pažymėtina, kad skaičiuojant BIK, į sandorių sudarymo išlaidas neatsižvelgiama.

Portfelio apyvartumo rodiklis (PAR) – rodiklis, apibūdinantis prekybos kolektyvinio investavimo subjekto portfelį sudarančiomis priemonėmis aktyvumą. Subjektai, kurių PAR aukštas, turi daugiau sandorių sudarymo išlaidų.

8. Mokėjimai tarpininkams (nurodyti konkrečius tarpininkus ir jiems sumokėtas mokėjimų sumas, paslaugas). Pažymėti, kurie tarpininkai susiję su kolektyvinio investavimo subjekto valdymo įmone.

Fondo akcijų platintojui “SEB bankui” platinimo mokestį (2% nuo įsigyjamų akcijų vertės) tiesiogiai sumoka investuotojai, įsigyjantys fondo akcijas.

UAB FMĮ „Orion Securities“ 1 470 LTL už finansų maklerio paslaugas.

9. Informacija apie visus egzistuojančius susitarimus dėl mokėjimų pasidalijimo, taip pat paslėptuosius komisinius (jų tiekėjas, vertė, suteiktų prekių ir (ar) paslaugų pobūdis ir kt.).

Investuotojai, išperkantys fondo akcijas, moka diferencijuotą (nuo 0% iki 2%) išpirkimo mokestį, priklausantį nuo akcijų išlaikymo termino. Nuo 2010 m. gruodžio 29 d. išleistoms akcijoms išpirkimo mokestis yra fiksuotas 1%, kuris atitenka BENDROVĖS Valdymo Įmonei.

Atlyginimas Valdymo įmonei už Fondo turto valdymą (investicijų konsultavimą, finansų apskaitą, metų ir pusmečio ataskaitas, GAV skaičiavimą ir pan.) yra lygus 1% Fondo grynųjų aktyvų vidutinės metinės vertės.

10. Pateikti konkretų iliustruojantį pavyzdį apie atskaitymų įtaką galutinei investuotojui tenkančiai investicijų grąžai (pateikti tik metų ataskaitoje). Pavyzdyje pateikti paskaičiavimus, kiek būtų atskaityta (litais) nuo kolektyvinio investavimo subjekto dalyvio įmokų, esant dabartiniam atskaitymų lygiui ir kokią sumą jis gautų po 1,3,5,10 metų, jei būtų investuota 10 000 Lt., o metinė investicijų grąža – 5 proc.

	Po 1 metų	Po 3 metų	Po 5 metų	Po 10 metų
Sumokėta atskaitymų	-----	-----	-----	-----
Sukaupta suma, jei nebūtų atskaitymų	-----	-----	-----	-----
Sukaupta suma, esant dabartiniam atskaitymų lygiui	-----	-----	-----	-----

IV. INFORMACIJA APIE KOLEKTYVINIO INVESTAVIMO SUBJEKTO INVESTICINIŲ PRIEMONIŲ PORTFELĮ

11. Ataskaitinio laikotarpio pabaigos investicinių priemonių portfelio sudėtis:

Emitento pavadinimas	Šalis	ISIN kodas	Kiekis, vnt.	Bendra nominali vertė	Bendra įsigijimo vertė	Bendra rinkos vertė	Rinka, pagal kurios duomenis nustatyta rinkos vertė (tinklapio adresas)	Balsų dalis emitente %	Dalis GA, %
Nuosavybės vertybiniai popieriai, įtraukti į Oficialųjį ar jį atitinkantį prekybos sąrašą									
AB Apranga	Lietuva	LT0000102337	43 795	43 795	131 030	276 724	www.nasdaqomxb altic.com	0,08	3,48
AB CITY SERVICE	Lietuva	LT0000127375	23 280	23 280	175 477	143 882	www.nasdaqomxb altic.com	0,07	1,81
AB Invalda	Lietuva	LT0000102279	41 942	41 942	197 648	369 284	www.nasdaqomxb altic.com	0,07	4,64
AB Lietuvos dujos	Lietuva	LT0000116220	50 269	50 269	118 385	96 331	www.nasdaqomxb altic.com	0,01	1,21
AB Grigiškės	Lietuva	LT0000102030	44 015	44 015	40 755	79 939	www.nasdaqomxb altic.com	0,07	1,00
AB Panevėžio statybos trestas	Lietuva	LT0000101446	17 185	17 185	62 560	64 677	www.nasdaqomxb altic.com	0,05	0,81
AB Pieno žvaigždės	Lietuva	LT0000111676	66 878	66 878	224 486	427 195	www.nasdaqomxb altic.com	0,12	5,37
AB Rokiškio sūris	Lietuva	LT0000100372	30 015	30 015	78 801	140 945	www.nasdaqomxb altic.com	0,08	1,77
AB Lesto	Lietuva	LT0000128449	53 123	53 123	192 411	105 652	www.nasdaqomxb altic.com	0,01	1,32
AB Šiaulių bankas	Lietuva	LT0000102253	257 370	257 370	261 366	218 607	www.nasdaqomxb altic.com	0,11	2,75
AB TEO LT	Lietuva	LT0000123911	263 508	263 508	599 320	579 568	www.nasdaqomxb altic.com	0,03	7,28
AB Ūkio bankas	Lietuva	LT0000102352	247 786	247 786	175 928	141 167	www.nasdaqomxb altic.com	0,08	1,77
AB Linas Agro Group	Lietuva	LT0000128092	103 657	103 657	203 727	180 917	www.nasdaqomxb altic.com	0,07	2,27
AB Vilniaus baldai	Lietuva	LT0000104267	971	3 884	38 411	39 897	www.nasdaqomxb altic.com	0,02	0,50
Grindeks	Latvija	LV0000100659	8 670	42 975	280 923	192 956	www.nasdaqomxb altic.com	0,45	2,42
Latvijas Kugnieciba	Latvija	LV0000101103	15 696	77 800	31 709	19 606	www.nasdaqomxb altic.com	0,01	0,25
Olainfarm	Latvija	LV0000100501	5 999	29 735	77 115	87 719	www.nasdaqomxb altic.com	0,04	1,10
SAF Technika	Latvija	LV0000101129	2 687	13 319	37 401	16 116	www.nasdaqomxb altic.com	0,45	0,20
Tallinna Kaubamaja	Estija	EE0000001105	28 553	59 153	632 244	552 092	www.nasdaqomxb altic.com	0,07	6,94
Silvano Fashion Group	Estija	EE3100001751	61 501	84 940	700 867	734 733	www.nasdaqomxb altic.com	0,16	9,23
AS Tallink Grupp	Estija	EE3100004466	734 074	1 520 766	2 050 129	1 556 251	www.nasdaqomxb altic.com	0,11	19,55
Nordecon AS	Estija	EE3100039496	8 094	0	31 297	32 698	www.nasdaqomxb altic.com	0,03	0,41
Merko Ehitus	Estija	EE3100098328	9 887	0	318 471	213 020	www.nasdaqomxb altic.com	0,06	2,68
Harju Elekter	Estija	EE3100004250	15 662	37 854	184 869	133 572	www.nasdaqomxb altic.com	0,09	1,68
Tallina Vesi	Estija	EE31000026436	11 990	24 839	356 994	306 353	www.nasdaqomxb altic.com	0,06	3,85
Olympic Entertainment Group	Estija	EE3100084021	102 698	0	531 162	460 974	www.nasdaqomxb altic.com	0,07	5,79
Premia Foods AS	Estija	EE3100101031	76 153	157 765	252 447	180 903	www.nasdaqomxb altic.com	0,20	2,27
Iš viso	-----	-----	-----	-----	7 985 933	7 351 778	-----	-----	92,38
Nuosavybės vertybiniai popieriai, įtraukti į Papildomąjį ar jį atitinkantį prekybos sąrašą									
AB Klaipėdos nafta	Lietuva	LT0000111650	198 545	198 545	234 593	269 416	www.nasdaqomxb altic.com	0,05	3,39
AB Žemaitijos pienas	Lietuva	LT0000121865	40 403	40 403	33 627	87 190	www.nasdaqomxb altic.com	0,08	1,10
AB Snaigė	Lietuva	LT0000109274	22 500	22 500	40 828	41 718	www.nasdaqomxb altic.com	0,06	0,52
Valmieras stikla skiedra	Latvija	LV0000100485	3810	18 885	13 401	12 672	www.nasdaqomxb altic.com	0,02	0,16
Iš viso	-----	-----	-----	-----	322 449	410 996	-----	-----	5,16
Nuosavybės vertybiniai popieriai, kuriais prekiaujama kitose reguliuojamose rinkose									

-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----
Iš viso:	-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----
Išleidžiami nauji nuosavybės vertybiniai popieriai									
-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----
Iš viso	-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----
Iš viso nuosavybės vertybinių popierių	-----	-----	-----	-----	8 308 382	7 762 774	-----	-----	97,54

Emitento pavadinimas	Šalis	ISIN kodas	Kiekis, vnt.	Bendra nominali vertė	Bendra įsigijimo vertė	Bendra rinkos vertė	Palūkanų norma	Išpirkimo / konvertavimo data	Dalis GA, %
Ne nuosavybės vertybiniai popieriai, įtraukti į Oficialųjį ar jį atitinkantį prekybos sąrašą									
-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----
Iš viso	-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----
Ne nuosavybės vertybiniai popieriai, įtraukti į Papildomąjį ar jį atitinkantį prekybos sąrašą									
-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----
Iš viso	-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----
Ne nuosavybės vertybiniai popieriai, kuriais prekiaujama kitose reguliuojamose rinkose									
-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----
Iš viso	-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----
Išleidžiami nauji ne nuosavybės vertybiniai popieriai									
-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----
Iš viso	-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----
Iš viso ne nuosavybės vertybinių popierių	-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----

KIS pavadinimas	Šalis	ISIN kodas	Kiekis, vnt.	Valdytojas	Bendra įsigijimo vertė	Bendra rinkos vertė	Šaltinis, pagal kurio duomenis nustatyta rinkos vertė (tinklapio adresas)	KIS tipas*	Dalis GA, %
Kolektyvinių investavimo subjektų įstatymo 61 str. 1 d. reikalavimus atitinkančių Kolektyvinio investavimo subjektų (KIS) vienetai (akcijos)									
-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----
Iš viso	-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----
Kitų kolektyvinio investavimo subjektų vienetai (akcijos)									
-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----
Iš viso	-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----
Iš viso KIS vienetų (akcijų)	-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----

*- nurodyti KIS tipą:

KIS 1 – KIS, kurių investavimo strategijoje numatyta iki 100 proc. grynujų aktyvų investuoti į ne nuosavybės vertybinius popierius;

KIS 2 – KIS, kurių investavimo strategijoje numatytas mišrus (subalansuotas) investavimas;

KIS 3 – KIS, kurių investavimo strategijoje numatyta iki 100 proc. grynujų aktyvų investuoti į nuosavybės vertybinius popierius;

KIS 4 – KIS, kurių investavimo strategijoje numatyta iki 100 proc. grynujų aktyvų investuoti į pinigų rinkos priemones;

KIS 5 – visų kitų rūšių KIS (alternatyvaus investavimo, privataus kapitalo, nekilnojamojo turto, žaliavų ir kt.).

Pastaba. Investuojant į fondų fondus, juos priskirti tam tikrai KIS grupei pagal fondų fondų investavimo strategiją.

Emitento pavadinimas	Šalis	Priemonės pavadinimas	Kiekis, vnt.	Valiuta	Bendra rinkos vertė	Palūkanų norma	Galiojimo pabaigos data	Dalis GA, %
Pinigų rinkos priemonės, kuriomis prekiaujama reguliuojamose rinkose								
-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----
Iš viso	-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----
Kitos pinigų rinkos priemonės								
-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----
Iš viso	-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----
Iš viso pinigų rinkos priemonių	-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----

Kredito įstaigos pavadinimas	Šalis			Valiuta	Bendra rinkos vertė	Palūkanų norma	Indėlio termino pabaiga	Dalis GA, %
Indėliai kredito įstaigose								
-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----
Iš viso:	-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----

Priemonės pavadinimas	Emitento pavadinimas	Šalis	Kita sandorio šalis	Valiuta	Investicinis sandoris (pozicija)	Investicinio sandorio (pozicijos) vertė	Bendra rinkos vertė	Rinkos pavadinimas (tinklapio adresas)	Galiojimo terminas	Dalis GA, %
Išvestinės investicinės priemonės, kuriomis prekiaujama reguliuojamose rinkose										
-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----
Iš viso	-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----
Kitos išvestinės investicinės priemonės										
-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----
Iš viso	-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----
Iš viso išvestinės finansinės priemonės	-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----

Banko pavadinimas	Valiuta	Bendra rinkos vertė	Palūkanų norma	Dalis GA, (%)
Pinigai				
AB SEB bankas	LTL	3 796	-----	0,05
AB SEB bankas	EUR	157 976	-----	1,98
AB SEB bankas	LVL	22 848	-----	0,29
Iš viso pinigai:	-----	184 620	-----	2,32

Pavadinimas	Trumpas apibūdinimas	Bendra vertė	Paskirtis	Dalis GA, %
Kitos priemonės (aiškiai įvardyti), nenurodytos Kolektyvinio investavimo subjektų įstatymo 57 str. 1d.				
-----	-----	-----	-----	-----
Iš viso	-----	-----	-----	-----

12. Investicijų pasiskirstymas pagal investavimo strategiją atitinkančius kriterijus (pildyti pagal investavimo strategiją atitinkančius kriterijus, pavyzdžiui, pagal turto rūšis, pramonės šakas, geografinę zoną, valiutas, rinkas, emitentų tipus (vyriausybė, bendrovės), emitentų kredito reitingus, priemonių galiojimo trukmę bei kt.)

12.1. Pagal investavimo objektus.

Fondo investicinės veiklos tikslas yra investuojant ir reinvestuojant pinigines lėšas, gautas platinant išperkamasias Fondo akcijas, kiek galima tiksliau atkartoti OMX Baltic Benchmark GI indekso sudėtį, laikantis likvidumo ir investicinio portfelio diversifikavimo reikalavimų. Šis investicinės veiklos tikslas yra pasiekiamas laikantis indeksavimo strategijos. (Indeksavimas – tai investavimas į visus pasirinktą rinkos indeksą sudarančius vertybinius popierius tokiu santykiu, kokiu jie įeina į indeksą). Fondas investuoja į OMX Baltic Benchmark GI (toliau - Indeksas) akcijų indeksą sudarančias priemones. Indeksas yra skaičiuojamas The Nasdaq OMX Group, Inc. ir intelektinės nuosavybės teisės į Indeksą priklauso The Nasdaq OMX Group, Inc. Fondo investicinis portfelis sudaromas sekant Indeksą, t.y. kiek tai įmanoma, investuojama į visus Indeksą sudarančius vertybinius popierius tokiu santykiu, kokiu jie įeina į Indeksą. Indeksas yra sudarytas iš didžiausios laisvų akcijų kapitalizacijos Lietuvos, Latvijos ir Estijos bendrovių, kurių akcijos listinguojamos NASDAQ OMX Vilnius, NASDAQ OMX Tallinn ir NASDAQ OMX Riga biržose (toliau - Biržos), akcijų. Indeksas yra kapitalizuotas, t.y. didžiausios laisvų akcijų kapitalizacijos bendrovės (įmonės) turi didžiausią svorį Indekse. Indekso sudarymo tvarka, skaičiavimo metodika ir sudėtis skelbiami NASDAQ OMX tinklapyje <http://www.nasdaqomxbaltic.com/>.

Žemiau pateikiame investicijų pasiskirstymą (didėjančia tvarka).

Investicijų pasiskirstymas	Rinkos vertė	Dalis aktyvuose (%)	Rinkos vertė ataskaitinio laikotarpio pradžioje	Dalis aktyvuose ataskaitinio laikotarpio pradžioje (%)
AS Tallink Group	1 556 251	19,55	1 488 902	19,65
Silvano Fashion Group	734 733	9,23	620 736	8,19
AB TEO LT	579 568	7,28	1 055 538	13,93
Tallinna Kaubamaja	552 092	6,94	450 938	5,95
Olympic Entertainment Group	460 974	5,79	361 913	4,78
AB Pieno žvaigždės	427 195	5,37	378 354	4,99
AB Invalda	369 284	4,64	330 374	4,36
Tallina Vesi	306 353	3,85	237 813	3,14
AB Apranga	276 724	3,48	212 081	2,80
AB Klaipėdos nafta	269 416	3,39	263 423	3,48
AB Šiaulių bankas	218 607	2,75	129 269	1,71
Merko Ehitus	213 020	2,68	184 344	2,43
GRINDEKS	192 956	2,42	183 475	2,42
AB Linas Agro Group	180 917	2,27	144 952	1,91
Premia Foods AS	180 903	2,27	155 466	2,05
AB City service	143 882	1,81	158 029	2,09
AB Ūkio bankas	141 167	1,77	148 011	1,95
AB Rokiškio sūris	140 945	1,77	134 519	1,78
Harju Elekter	133 572	1,68	123 297	1,63
AB LESTO	105 652	1,32	102 717	1,36
AB Lietuvos dujos	96 331	1,21	103 968	1,37
OLAINFARM	87 719	1,10	-----	-----
AB Žemaitijos pienas	87 190	1,10	94 723	1,25
AB Grigiškės	79 939	1,00	70 212	0,93
AB Panevėžio statybos trestas	64 677	0,81	64 677	0,85
AB Snaigė	41 718	0,52	-----	-----
AB Vilniaus baldai	39 897	0,50	-----	-----
Nordecon AS	32 698	0,41	53 272	0,70
LATVIJAS KUGNIECIBA	19 606	0,25	68 035	0,90
SAF TECHNIKA	16 116	0,20	22 044	0,29
Valmieras stikla šķiedra	12 672	0,16	-----	-----

12.2. Pagal sektorius.

	Investicijų pasiskirstymas	Rinkos vertė	Dalis aktyvuose (%)	Rinkos vertė ataskaitinio laikotarpio pradžioje	Dalis aktyvuose ataskaitinio laikotarpio pradžioje (%)
1.	Nuosavybės vertybiniai popieriai	7 762 774	97,54	7 341 084	96,90
1.1.	Rezidentai	3 263 110	41,00	3 390 847	44,76
1.1.1.	Nefinansų įmonės	2 903 336	36,48	3 113 567	41,10
1.1.2.	Finansų įmonės	359 774	4,52	277 280	3,66
1.1.2.1.	Bankai	359 774	4,52	277 280	3,66
1.1.2.2.	Draudimo įmonės	-----	-----	-----	-----
1.1.2.3.	Kitos finansų įmonės	-----	-----	-----	-----
1.2.	Nerezidentai	4 499 664	56,54	3 950 237	52,14
2.	Skolos vertybiniai popieriai	-----	-----	-----	-----
2.1.	Rezidentai	-----	-----	-----	-----
2.1.1.	Valstybės ir savivaldybių institucijos	-----	-----	-----	-----
2.1.2.	Nefinansų įmonės	-----	-----	-----	-----
2.1.3.	Finansų įmonės	-----	-----	-----	-----
2.2.	Nerezidentai	-----	-----	-----	-----
3.	Kolektyvinio investavimo subjektų vienetai (akcijos)	-----	-----	-----	-----
3.1.	Rezidentai	-----	-----	-----	-----
3.2.	Nerezidentai	-----	-----	-----	-----
4.	Pinigų rinkos priemonės	-----	-----	-----	-----
4.1.	Rezidentai	-----	-----	-----	-----
4.1.1.	Valstybės ir savivaldybių institucijos	-----	-----	-----	-----
4.1.2.	Nefinansų įmonės	-----	-----	-----	-----
4.1.3.	Finansų įmonės	-----	-----	-----	-----
4.2.	Nerezidentai	-----	-----	-----	-----
5.	Indėliai kredito įstaigose	-----	-----	-----	-----
5.1.	Rezidentai	-----	-----	-----	-----
5.2.	Nerezidentai	-----	-----	-----	-----
6.	Išvestinės investicinės priemonės	-----	-----	-----	-----
6.1.	Rezidentai	-----	-----	-----	-----
6.1.1.	Valstybės ir savivaldybių institucijos	-----	-----	-----	-----
6.1.2.	Nefinansų įmonės	-----	-----	-----	-----
6.1.3.	Finansų įmonės	-----	-----	-----	-----
6.2.	Nerezidentai	-----	-----	-----	-----
7.	Pinigai	184 620	2,32	173 900	2,30
7.1.	Rezidentai	184 620	2,32	173 900	2,30
7.2.	Nerezidentai	-----	-----	-----	-----
8.	Kitos investicijos	-----	-----	-----	-----
8.1.	Rezidentai	-----	-----	-----	-----
8.1.1.	Valstybės ir savivaldybių institucijos	-----	-----	-----	-----
8.1.2.	Nefinansų įmonės	-----	-----	-----	-----
8.1.3.	Finansų įmonės	-----	-----	-----	-----
8.2.	Nerezidentai	-----	-----	-----	-----

12.3. Pagal valiutas ir geografinę zoną.

Investicijų pasiskirstymas	Rinkos vertė	Dalis aktyvuose (%)	Rinkos vertė ataskaitinio laikotarpio pradžioje	Dalis aktyvuose ataskaitinio laikotarpio pradžioje (%)
Pagal valiutas:				
LTL	3 266 906	41,05	3 510 273	46,34
EUR	4 328 572	54,39	3 676 686	48,53
LVL	351 916	4,42	328 025	4,33
Iš viso	7 947 394	99,86	7 514 984	99,20
Pagal geografinę zoną:				
Lietuva	3 447 729	43,32	3 564 748	47,06
Latvija	329 068	4,13	273 554	3,61
Estija	4 170 597	52,41	3 676 682	48,53
kitos Europos Sąjungos valstybės	-----	-----	-----	-----
Europos ekonominės erdvės valstybės (Islandija, Norvegija, Lichtenšteinas)	-----	-----	-----	-----
Jungtinės Amerikos Valstijos ir Kanada	-----	-----	-----	-----
Japonija	-----	-----	-----	-----
Kitos šalys	-----	-----	-----	-----
Iš viso	7 947 394	99,86	7 514 984	99,20

13. Per ataskaitinį laikotarpį įvykdyti išvestinių finansinių priemonių sandoriai, išskyrus tuos, kurie nurodyti šio priedo 11 punkte (pagal išvestinių priemonių rūšis nurodyti sandorių vertes, išvestinių finansinių priemonių panaudojimo tikslus (valiutų keitimo, palūkanų normos, susiję su nuosavybe ir kt.), sandorius reguliuojamose rinkose ir šalių tarpusavio sandorius bei kitą svarbią informaciją).

14. (Vadovaujantis Kolektyvinio investavimo subjektų išvestinių finansinių priemonių naudojimo ir susijusių rizikų vertinimo tvarka) Aprašyti šio priedo 11 punkte nurodytų išvestinių finansinių priemonių rūšis, su jomis susijusią riziką, kiekybines ribas ir metodus, kuriais vertinama su išvestinių finansinių priemonių sandoriais susijusi kolektyvinio investavimo subjekto rizika, ir nurodyti, kaip išvestinė finansinė priemonė gali apsaugoti investicinį sandorį (investicinę poziciją) nuo rizikos (jei priemonė naudojama rizikos valdymo tikslais).

15. Iš išvestinių finansinių priemonių sandorių kylančių įsipareigojimų bendra vertė ataskaitinio laikotarpio pabaigoje (atskirai nurodyti sumas pagal skirtingas įsigytų išvestinių finansinių priemonių kategorijas).

16. Pateikti analizę, kaip turimas investicijų portfelis atitinka (neatitinka) kolektyvinio investavimo subjekto investavimo strategiją (investicijų kryptis, investicijų specializaciją, geografinę zoną ir pan.).

Fondo investicinės veiklos tikslas yra investuojant ir reinvestuojant pinigines lėšas, gautas platinant išperkamasias Fondo akcijas, kiek galima tiksliau atkartoti OMX Baltic Benchmark GI indekso sudėtį, laikantis likvidumo ir investicinio portfelio diversifikavimo reikalavimų. Šis investicinės veiklos tikslas yra pasiekiamas laikantis indeksavimo strategijos. (Indeksavimas – tai investavimas į visus pasirinktą rinkos indeksą sudarančius vertybinius popierius tokiu santykiu, kokiu jie įeina į indeksą). Fondas investuoja į OMX Baltic Benchmark GI (toliau - Indeksas) akcijų indeksą sudarančias priemones. Indeksas yra skaičiuojamas The Nasdaq OMX Group, Inc. ir intelektinės nuosavybės teisės į Indeksą priklauso The Nasdaq OMX Group, Inc. Fondo investicinis portfelis sudaromas sekant Indeksą, t.y. kiek tai įmanoma, investuojama į visus Indeksą sudarančius vertybinius popierius tokiu santykiu, kokiu jie įeina į Indeksą. Indeksas yra sudarytas iš didžiausios laisvų akcijų kapitalizacijos Lietuvos, Latvijos ir Estijos bendrovių, kurių akcijos listinguojamos NASDAQ OMX Vilnius, NASDAQ OMX Tallinn ir NASDAQ OMX Riga biržose (toliau - Biržos), akcijų. Indeksas yra kapitalizuotas, t.y. didžiausios laisvų akcijų kapitalizacijos bendrovės (įmonės) turi didžiausią svorį Indekse. Indekso sudarymo tvarka, skaičiavimo metodika ir sudėtis skelbiami NASDAQ OMX tinklapyje <http://www.nasdaqomxbaltic.com/>.

17. Nurodyti veiksnius, per ataskaitinį laikotarpį turėjusius didžiausią įtaką investicinių priemonių portfelio struktūros ir jo vertės pokyčiams.

Didžiausią įtaką investicinių priemonių portfelio struktūrai ir jo vertės pokyčiams turėjo antros pagal dydį pozicijos AB TEO LT sumažėjimas dėl didžiausio šios bendrovės akcininko TeliaSonera, AB vykdyto akcijų supirkimo, septintos pagal dydį Ab Invalda pozicijos sumažėjimas dėl savų akcijų supirkimo bei 2012 m. pradžioje The Nasdaq OMX Group, Inc. atlikti Indekso sudėties pakeitimai.

VI. KOLEKTYVINIO INVESTAVIMO SUBJEKTO FINANSINĖ BŪKLĖ

22. Pateikti šias kolektyvinio investavimo subjekto ataskaitas, parengtas vadovaujantis Lietuvos Respublikos įstatymų ir teisės aktų reikalavimais:

22.1. balansą.

2012M. BIRŽELIO 30 D. BALANSAS

2012 07 30 Nr.2

Eil. Nr.	TURTAS	Pastabos Nr.	Finansiniai metai	Praėję finansiniai metai
A.	ILGALAIKIS TURTAS			
I.	NEMATERIALUSIS TURTAS			
II.	MATERIALUSIS TURTAS			
II.1.	Investicinis turtas			
II.1.1.	Žemė			
II.1.2.	Pastatai			
II.1.3.	Kitas investicinis turtas			
II.2.	Kitas materialusis turtas			
III.	FINANSINIS TURTAS			
III.1.	Investicijos į susijusias įmones			
III.2.	Kiti nuosavybės vertybiniai popieriai			
III.3.	Ne nuosavybės vertybiniai popieriai			
III.4.	Kitų kolektyvinio investavimo subjektų investiciniai vienetai ir akcijos			
III.5.	Išvestinės finansinės priemonės			
III.6.	Terminuotieji indėliai			
III.7.	Kitas ilgalaikis finansinis turtas			
IV.	KITAS ILGALAIKIS TURTAS			
IV.1.	Atidėtojo mokesčio turtas			
IV.2.	Kitas ilgalaikis turtas			
B.	TRUMPALAIKIS TURTAS		8 014 861	9 793 204
I.	IŠ ANKSTO SUMOKĖTOS SUMOS			
II.	PER VIENUS METUS GAUTINOS SUMOS		67 387	135 598
II.1.	Investicijų pardavimo sandorių gautinos sumos			
II.2.	Susijusių įmonių skolos			
II.3.	Kitos gautinos sumos		67 387	135 598
III.	TERMINUOTIEJI INDĖLIAI			
IV.	PINIGŲ RINKOS PRIEMONĖS			
V.	PERLEIDŽIAMIEJI VERTYBINIAI POPIERIAI	3,4,5	7 762 774	9 365 094
V.1.	Ne nuosavybės vertybiniai popieriai			
V.1.1.	Vyriausybių ir centrinių bankų arba jų garantuoti skolos vertybiniai popieriai			
V.1.2.	Kiti skolos vertybiniai popieriai			
V.2.	Nuosavybės vertybiniai popieriai	3,4,5	7 762 774	9 365 094
V.3.	Kitų kolektyvinio investavimo subjektų investiciniai vienetai ir akcijos			
VI.	IŠVESTINĖS FINANSINĖS PRIEMONĖS			
VII.	KITAS TRUMPALAIKIS TURTAS		80	44 507
VIII.	PINIGAI	3,4,5	184 620	248 005
	TURTO IŠ VISO:		8 014 861	9 793 204

Eil. Nr.	NUOSAVAS KAPITALAS IR ĮSIPAREIGOJIMAI	Pastabos Nr.	Finansiniai metai	Praėję finansiniai metai
C.	NUOSAVAS KAPITALAS		7 958 475	9 715 028
I.	PASIRAŠYTASIS (APMOKĖTAS) AKCINIS KAPITALAS		8 200 031	9 462 458
II.	AKCIJŲ PRIEDAI			
III.	PERKAINOJIMO REZERVAS (REZULTATAI)			
IV.	REZERVAI			
IV.1.	Privalomasis			
IV.2.	Kiti rezervai			
V.	NEPASKIRSTYTASIS PELNAS (NUOSTOLIAI)		(241 556)	252 570
V.I.	Ataskaitinių metų pelnas (nuostoliai)		935 344	(10 02 307)
V.II.	Ankstesnių metų pelnas (nuostoliai)		(1 176 900)	1 254 877
D.	MOKĖTINOS SUMOS IR ĮSIPAREIGOJIMAI		56 386	78 176
I.	PO VIENŲ METŲ MOKĖTINOS SUMOS IR ILGALAIKIAI ĮSIPAREIGOJIMAI			
I.1.	Finansinės skolos kredito įstaigoms			
I.2.	Atidėjiniai			
I.3.	Atidėtojo mokesčio įsipareigojimas			
I.4.	Įsipareigojimai pagal išvestinių finansinių priemonių sutartis			
I.5.	Kitos mokėtinos sumos ir ilgalaikiai įsipareigojimai			
II.	PER VIENUS METUS MOKĖTINOS SUMOS IR TRUMPALAIKIAI ĮSIPAREIGOJIMAI		56 386	78 176
II.1.	Ilgalaikių skolų einamųjų metų dalis			
II.2.	Finansinės skolos kredito įstaigoms			
II.3.	Atidėjiniai			
II.4.	Finansinio ir investicinio turto pirkimo įsipareigojimai		34 337	45 982
II.5.	Iš anksto gautos sumos			
II.6.	Įsipareigojimai pagal išvestinių finansinių priemonių sutartis			
II.7.	Pelno mokesčio įsipareigojimai			
II.8.	Su darbo santykiais susiję įsipareigojimai			
II.9.	Valdymo įmonei ir depozitoriumui mokėtinos sumos		11 546	13 561
II.10.	Kitos mokėtinos sumos ir trumpalaikiai įsipareigojimai		10 503	18 633
	NUOSAVO KAPITALO IR ĮSIPAREIGOJIMŲ IŠ VISO:		8 014 861	9 793 204

Gen. direktorius

Rytis Davidovičius

(įmonės administracijos vadovo pareigų pavadinimas) (parašas)

(vardas ir pavardė)

22.2. Pelno (nuostolio) ataskaitą, nuosavo kapitalo pokyčių ataskaita ir pinigų srautų ataskaitą.

2012M. BIRŽELIO 30 D. PELNO (NUOSTOLIŲ) ATASKAITA
2012 07 30 Nr.2

Eil. Nr.	STRAIPSNIAI	Pastabos Nr.	Finansiniai metai	Praėję finansiniai metai
I.	PAGRINDINĖS VEIKLOS PAJAMOS		1 173 168	711 684
I.1.	Palūkanų pajamos		19	84
I.2.	Dividendai		276 353	261 971
I.3.	Pelnas dėl investicijų vertės pasikeitimo ir pardavimo		896 551	449 170
I.4.	Pelnas dėl užsienio valiutos kursų pokyčio		245	459
I.5.	Išvestinių finansinių priemonių sandorių pelnas			
I.6.	Garantinės įmokos			
I.7.	Su bendrovės akcijų pardavimu (išpirkimu) susijusių atskaitymų pajamos			
I.8.	Kitos pagrindinės veiklos pajamos			
II.	PAGRINDINĖS VEIKLOS SĄNAUDOS		167 810	1 585 350
II.1.	Nuostoliai (pelnas) dėl investicijų vertės pasikeitimo ir pardavimo		166 267	1 580 558
II.2.	Nuostoliai dėl užsienio valiutos kursų pokyčio		1 543	4 792
II.3.	Išvestinių finansinių priemonių sandorių nuostoliai			
II.4.	Bendrovės akcijų pardavimo sąnaudos			
II.5.	Kitos pagrindinės veiklos sąnaudos			
III.	PAGRINDINĖS VEIKLOS PELNAS (NUOSTOLIAI)		1 005 358	(873 666)
IV.	BENDROSIOS IR ADMINISTRACINĖS SĄNAUDOS		70 014	128 641
IV.1.	Valdymo sąnaudos:	18	70 014	128 641
IV.1.1.	Atlyginimas valdymo įmonei	18	40 433	48 512
IV.1.2.	Atlyginimas depozitoriumui	18	9 525	12 792
IV.1.3.	Atlyginimas tarpininkams	8,18	1 500	11 241
IV.1.4.	Audito sąnaudos	18	6 099	6 027
IV.1.5.	Teisnės bazės ruošimo sąnaudos	18	998	
IV.1.6.	Reklamos sąnaudos	18	3 685	
IV.1.7.	Kitos sąnaudos	18	7 774	50 069
IV.2.	Kitos bendrosios administracinės sąnaudos			
IV.3.	Sąnaudų kompensavimas (-)			
V.	TIPINĖS VEIKLOS PELNAS (NUOSTOLIAI)		935 344	(1 002 307)
VI.	KITA VEIKLA			0
VI.1.	Pajamos			
VI.2.	Sąnaudos			
VII.	ĮPRASTINĖS VEIKLOS PELNAS (NUOSTOLIAI)		935 344	(1 002 307)
VIII.	PAGAUTĖ			
IX.	NETEKIMAI			
X.	PELNAS (NUOSTOLIAI) PRIEŠ APMOKESTINIMĄ		935 344	(1 002 307)
XI.	PELNO MOKESTIS			

Gen. direktorius
(įmonės administracijos vadovo pareigų pavadinimas) (parašas)

Rytis Davidovičius
(vardas ir pavardė)

2012M. BIRŽELIO 30 D. NUOSAVO KAPITALO POKYČIŲ ATASKAITA

2012 07 30 Nr. 2

Rodikliai	Pasirašytasis (apmokėtas) akcinis kapitalas	Akcijų priedai	Įstatymo numatytas privalomasis rezervas	Perkainojimo rezervas (rezultatai)		Kiti rezervai	Nepaskirstytasis pelnas (nuostoliai)	Iš viso
				Ilgalaikio materialiojo turto	Finansinio turto			
1. Likutis už praėjusių finansinių metų pabaigoje	9 887 956						741 519	10 629 475
2. Apskaitos politikos pakeitimo rezultatas								
3. Esminių klaidų taisymo rezultatas								
4. Perskaičiuotas likutis už praėjusių finansinių metų pabaigoje	9 887 956						741 519	10 629 475
5. Ilgalaikio materialiojo ir finansinio turto vertės padidėjimas (sumažėjimas)								
6. Pelno (nuostolių) ataskaitoje nepripažintas pelnas (nuostoliai)								
7. Ataskaitinio laikotarpio grynas pelnas (nuostoliai)							(2 610 283)	(2 610 283)
8. Paskelbti dividendai ir kitos su pelno paskirstymu susijusios išmokos								
9. Sudaryti rezervai								
10. Panaudoti rezervai								
11. Akcinio kapitalo padidėjimas pardavus bendrovės akcijas	602 677							602 677
12. Akcinio kapitalo sumažėjimas išpirkus bendrovės akcijas	(1 425 754)						379 900	(1 045 854)
13. Įnašai nuostoliams padengti								
14. Likutis praėjusių finansinių metų pabaigoje	9 064 879						(1 488 864)	7 576 015
15. Ilgalaikio materialiojo ir finansinio turto vertės padidėjimas (sumažėjimas)								
16. Pelno (nuostolių) ataskaitoje nepripažintas pelnas (nuostoliai)								
17. Ataskaitinio laikotarpio grynas pelnas (nuostoliai)							935 344	935 344

18. Dividendai ir kitos su pelno paskirstymu susijusios išmokos								
19. Sudaryti rezervai								
20. Panaudoti rezervai								
21. Akcinio kapitalo padidėjimas pardavus bendrovės akcijas	9 020							9 020
22. Akcinio kapitalo sumažėjimas išpirkus bendrovės akcijas	(873 868)						311 964	(561 904)
23. Įnašai nuostoliams padengti								
24. Likutis ataskaitinių finansinių metų pabaigoje	8 200 031						(241 556)	7 958 475

Gen. direktorius

(įmonės administracijos vadovo pareigų pavadinimas) (parašas)

Rytis Davidovičius

(vardas ir pavardė)

2012M. BIRŽELIO 30 D. PINIGŲ SRAUTŲ ATASKAITA

2012 07 30 Nr. 2

Eil. Nr.	Straipsniai	Pastabos Nr.	Finansiniai metai	Praėję finansiniai metai
I.	Pagrindinės veiklos pinigų srautai			
I.1.	Ataskaitinio laikotarpio pinigų įplaukos		1 189 043	5 321 116
I.1.1.	Už parduotą finansinį ir investicinį turtą gauti pinigai		945 514	5 092 437
I.1.2.	Gautos palūkanos		19	95
I.1.3.	Gauti dividendai		243 510	228 584
I.1.4.	Kitos veiklos įplaukos			
I.2.	Ataskaitinio laikotarpio pinigų išmokos		(623 897)	6 093 172
I.2.1	Išmokos už finansinio ir investicinio turto įsigijimą ir įvykdyti įsipareigojimai		(557 234)	5 963 453
I.2.2	Išmokos, susijusios su valdymu		(45 558)	71 104
I.2.3	Išmokos, susijusios su administracinėmis ir bendrosiomis reikmėmis		(21 105)	58 275
I.2.4	Kitos išmokos			340
	Grynieji pagrindinės veiklos pinigų srautai		565 146	(772 056)
II.	Finansinės veiklos pinigų srautai			
II.1	Bendrovės akcijų pardavimas		9 020	400 218
II.2	Bendrovės akcijų išpirkimas		(561 904)	310 482
II.3	Išmokos iš pelno			
II.4	Gauta paskolų			
II.5	Grąžinta paskolų			
II.6	Sumokėta palūkanų			
II.7	Pinigų srautai, susiję su kitais finansavimo šaltiniais			
II.8	Kitas finansinės veiklos pinigų srautų padidėjimas			
II.9	Kitas finansinės veiklos pinigų srautų sumažėjimas			
	Grynieji finansinės veiklos pinigų srautai		(552 884)	89 736
III.	Valiutos kursų pokyčio įtaka grynujų pinigų likučiui		(1 542)	(4 333)
IV.	Grynasis pinigų srautų padidėjimas (sumažėjimas)		10 720	(686 653)
V.	Pinigai ataskaitinio laikotarpio pradžioje		173 900	934 658
VI.	Pinigai ataskaitinio laikotarpio pabaigoje		184 620	248 005

Gen. direktorius
(įmonės administracijos vadovo pareigų pavadinimas)

(parašas)

Rytis Davidovičius
(vardas ir pavardė)

22.3. Aiškinamąjį raštą (pateikiamas tik metų ir pusmečio ataskaitose).

Aiškinamasis raštas

I. Bendroji informacija

1. Informacija apie fondą:

Pavadinimas	Investicinė kintamojo kapitalo bendrovė „OMX Baltic Benchmark Fund“ (toliau – Fondas). Iki 2011 m. vasario mėnesio Fondo pavadinimas buvo „NSEL 30 indekso fondas“
<i>Teisinė forma</i>	Investicinė kintamojo kapitalo bendrovė
VPK pritarimo sudarymo dokumentams data	2000 m. rugsėjo 14 d. (pritarta memorandumui)
Dalyvių skaičius	467
Veiklos trukmė	Neterminuota

2. Duomenys apie valdymo įmonę:

Pavadinimas	Uždaroji akcinė bendrovė “Orion Asset Management“ (buvusi UAB „Investicijų portfelio valdymas“).
Kodas	111707985
<i>Buveinė (adresas)</i>	A. Tumėno g. 4, Vilnius
<i>Telefono numeriai, fakso numeriai, el. pašto adresas, interneto svetainės adresas</i>	+370 5 2041541 +370 5 2313840 oam@orion.lt www.orion.lt
<i>Leidimo verstis valdymo įmonės veikla numeris</i>	VĮK - 011.
<i>Įregistravimo Juridinių asmenų registre data, vieta, kodas</i>	2000 rugpjūčio 4 d. LR Ūkio ministerijoje; UĮ 2000-205.
<i>Kolektyvinio investavimo subjekto valdytojo vardas, pavardė, pareigos</i>	finansų analitikas Vytautas Jurėnas.

3. Informacija apie depozitoriumą:

Pavadinimas	AB SEB bankas
<i>Kodas</i>	112021238
<i>Adresas</i>	Gedimino pr. 12, Vilnius
<i>Telefono ir fakso numeriai</i>	+370 5 2682680, +370 5 2682682 +370 5 2682683

4. Informacija apie auditorius:

Auditoriaus pavadinimas	„KPMG Baltics“, UAB
<i>Adresas</i>	Upės g. 21, Vilnius
<i>Telefono, fakso numeriai</i>	+370 5 2102600, +370 5 2102659

5. Ataskaitinis laikotarpis:

Ataskaitinis laikotarpis	2012 m. sausio 1 d. – 2012 m. birželio 30 d.
---------------------------------	--

II. Apskaitos politika

1. Teisės aktai, kuriais vadovaujantis parengtos finansinės ataskaitos

Valdymo įmonė, tvarkydama Fondo buhalterinę apskaitą ir sudarydama finansines ataskaitas, vadovaujasi Lietuvos Respublikos buhalterinės apskaitos įstatymu, Lietuvos Respublikos Kolektyvinio investavimo subjektų įstatymu, 39 Lietuvos Respublikos Verslo apskaitos standartu ir kitais teisės aktais.

Pateiktos finansinės ataskaitos yra parengtos remiantis istorine savikaina, išskyrus investicijas į vertybinius popierius ir išvestines finansines priemones, kurios yra apskaitomos tikraja verte.

Valdymo įmonė apskaitą tvarko ir šiose finansinėse ataskaitose visas sumas pateikia Lietuvos Respublikos nacionaline valiuta – litais. Nuo 2002 m. vasario mėn. 2 d. litas yra susietas su euru santykiu 3,4528 litai už 1 eurą, o lito kursą kitų valiutų atžvilgiu kasdien nustato Lietuvos Bankas.

Fondo finansiniai metai sutampa su kalendoriniais metais. Fondo finansinė ataskaita turi būti sudaroma per keturis mėnesius nuo finansinių metų pabaigos. Fondo vadovybė patvirtino šias finansines ataskaitas 2012 m. kovo 30 d. Fondo akcininkai turi įstatymine teisę patvirtinti šias finansines ataskaitas arba nepatvirtinti jų ir reikalauti vadovybės paruošti naujas finansines ataskaitas.

2. Investavimo politika

Fondo investicinės veiklos tikslas yra investuojant ir reinvestuojant pinigines lėšas, gautas platinant išperkamasias Fondo akcijas, kiek galima tiksliau atkartoti OMX Baltic Benchmark GI indekso sudėtį, laikantis likvidumo ir investicinio portfelio diversifikavimo reikalavimų. Šis investicinės veiklos tikslas yra pasiekiamas laikantis indeksavimo strategijos.

Fondas investuoja į OMX Baltic Benchmark GI (toliau – Indeksas) akcijų indeksą sudarančias priemones. Indeksas yra skaičiuojamas The Nasdaq OMX Group, Inc. ir intelektualinės nuosavybės teisės į Indeksą priklauso The Nasdaq OMX Group, Inc. Fondo investicinis portfelis sudaromas sekant Indeksą, t.y. kiek tai įmanoma, investuojama į visus Indeksą sudarančius vertybinius popierius tokiu santykiu, kokiu jie įeina į Indeksą. Indeksas yra sudarytas iš didžiausios laisvų akcijų kapitalizacijos Lietuvos, Latvijos ir Estijos bendrovių, kurių akcijos listinguojamos NASDAQ OMX Vilnius, NASDAQ OMX Riga ir NASDAQ OMX Tallinn biržose (toliau – Biržos), akcijų. Indeksas yra kapitalizuotas, t.y. didžiausios laisvų akcijų kapitalizacijos bendrovės (įmonės) turi didžiausią svorį Indekse. Indekso sudarymo tvarka, skaičiavimo metodika ir sudėtis skelbiami NASDAQ OMX tinklapyje <http://www.nasdaqomxbaltic.com/>.

Keičiantis Biržose listinguojamų bendrovių kapitalizacijai, akcininkų sudėčiai, įtraukiant į prekybos sąrašus naujas akcijas ar išbraukiant akcijas iš Biržų sąrašų, ar dėl kitų priežasčių, Indekso sudėtis keičiasi. Pasikeitus Indekso sudėčiai, atitinkamai koreguojamas ir Fondo investicinis portfelis. Indeksas yra performuojamas kartą per pusmetį. Fondo investicinis portfelis gali neatitikti Indekso dėl galiojančiuose teisės aktuose numatytų ir Fondo investiciniam portfeliui taikomų diversifikavimo reikalavimų, akcijų atsiradusių investiciniame portfelyje dėl bendrovių reorganizavimo (skaidymo) ir kitų teisės aktuose bei Fondo sudarymo dokumentuose numatytų priežasčių.

Pagal Fondui taikomus investicinio portfelio diversifikavimo reikalavimus į vieno emitento nuosavybės vertybinius popierius gali būti investuota iki 20 procentų Fondo grynųjų aktyvų vertės. Lietuvos bankui sutikus, jei tai būtina dėl ypatingų sąlygų reguliuojamoje rinkoje dominuojant vienam emitentui, į jo akcijas gali būti investuojama iki 35 procentų grynųjų aktyvų. Šiuo atveju Fondo sutrumpintame prospekte turi būti pateikiama tokias išskirtines sąlygas pagrindžianti informacija.

3. Finansinės rizikos valdymo politika

Baltijos šalių (Lietuvos, Latvijos ir Estijos) vertybinių popierių rinka nėra pakankamai likvidi. Kai kurie vertybiniai popieriai, kuriais prekiaujama Baltijos šalių vertybinių popierių rinkoje, nėra pakankamai likvidūs. Kai kurie iš šių vertybinių popierių gali patekti ir į fondo investicijų portfelį. Tai gali būti neišvengiama, kadangi Fondas investuoja į 30 akcijų portfelį.

Egzistuoja ir specifinė kompanijos, į kurią investavęs fondas rizika. Bet kuri iš Fondo investicijų portfelyje esančių akcijų gali prarasti savo vertę dėl laikinų finansinių sunkumų, rinkų nuosmukio, bankroto ar sanavimo.

Baltijos šalių vertybinių popierių rinkos likvidumo riziką ir specifinę bendrovės, į kurią investavęs Fondas, riziką siekiama minimizuoti kiek galima didesnę dalį fondo grynųjų aktyvų vertės investuojant į

likvidžiausias akcijas. Šią galimybę riboja galiojantys vertybinių popierių portfelio diversifikavimo reikalavimai. Į mažiau likvidžias akcijas yra investuojama likusi Fondo investicijų portfelio dalis.

Neigiamos trumpalaikių rinkos kritimų įtakos Fondas siekia išvengti skatindamas savo akcininkus investuoti ilgesniam laikotarpiui.

Be to, rizika mažinama teisės aktų nustatyta tvarka diversifikuojant Fondo vertybinių popierių portfelį.

Kiti egzistuojančių rizikų valdymo metodai yra išsamiai aprašyti Fondo prospekto 4 punkte.

4. Turto padidėjimo ir sumažėjimo pripažinimo principai

Piniginio mato principas – visas Fondo turtas, jo padidėjimas ir sumažėjimas finansinėse ataskaitose išreiškiami pinigais.

Kaupimo principas – Fondas turto padidėjimą ir sumažėjimą apskaitoje registruoja tada, kai jie atsiranda, ir pateikia tų laikotarpių finansinėse ataskaitose, neatsižvelgdamas į pinigų gavimą ar išmokėjimą.

Turinio svarbos principas – atspindėdamas turto padidėjimą ir sumažėjimą, Fondas daugiausia dėmesio skiria jų turiniui ir prasmei, o ne tik formaliems pateikimo reikalavimams. Fondas ūkines operacijas ir įvykius registruoja apskaitoje ir pateikia finansinėse ataskaitose pagal jų turinį ir ekonominę prasmę net ir tada, kai pateikimas skiriasi nuo teisinės formos.

Pinigų padidėjimas pripažįstamas fiksuojant pinigų padidėjimą banko sąskaitoje. Atitinkamai pripažįstamas šios sąskaitos sumažėjimas.

Vertybinių popierių padidėjimas pripažįstamas išigyjant vertybinius popierius bei padidėjus vertybinių popierių vertei. Atitinkamai, vertybinių popierių sumažėjimas pripažįstamas juos pardavus bei sumažėjus vertybinių popierių vertei. Vertybinių popierių pripažinimo momentas yra sandorio diena kai yra perduodama vertybinių popierių nuosavybės teisė.

Gautinų sumų straipsnio padidėjimas fiksuojamas sumokant avansus ir registruojant gautiną sumą. Sumažėjimas pripažįstamas gavus prekes ar paslaugas.

Gautinų sumų už išleistas Fondo akcijas padidėjimas pripažįstamas šių akcijų išleidimo dieną. Šių sumų sumažėjimas fiksuojamas apmokėjimo dieną.

Padidėjimas ar sumažėjimas fiksuojamas, jei atsiskaitoma užsienio valiuta – perkainuota oficialaus lito ir Lietuvos Banko skelbiamo kurso suma.

Sumažėjimas fiksuojamas pardavus turtą ar pripažįstant turto vertės sumažėjimą.

5. Atskaitymų valdymo bendrovei ir depozitoriumui taisyklės

Atlyginimas Valdymo įmonei už Fondo turto valdymą (investicijų konsultavimą, finansų apskaitą, metų ir pusmečio ataskaitas, grynųjų aktyvų vertės (toliau – GAV) skaičiavimą ir pan.) yra lygus 1% Fondo grynųjų aktyvų vidutinės metinės vertės. Pagal 2008 m. gegužės 6 d. susitarimą dėl 2007 m. lapkričio 5 d. platinimo sutarties tarp Fondo ir UAB „SEB investicijų valdymas“ (toliau – Platintojas), Fondas moka platinimo mokesčių. Šio mokesčio suma mažinamas atlyginimas Valdymo įmonei. Bendra Fondo mokama suma Valdymo įmonei ir Platintojui yra lygi 1% Fondo grynųjų aktyvų vidutinės metinės vertės. 2011 m. vasario 1 d. Fondas ir Platintojas abipusiu šalių susitarimu nutraukė 2007 m. lapkričio 5 d. sudarytą platinimo sutartį.

Atlyginimo Valdymo įmonei dydis skaičiuojamas kiekvieną kartą, kai yra skaičiuojama Fondo GAV, o sumokamas mėnesio pabaigoje per 10 darbo dienų. Pasibaigus metams atlyginimo Valdymo įmonei dydis yra tikslinamas. Per metus susidarę atlyginimo Valdymo įmonei permokėjimai per 10 darbo dienų grąžinami Fondui, susidarę atlyginimo Valdymo įmonei neprimokėjimai per 10 darbo dienų pervedami Valdymo įmonei.

Atlyginimas Depozitoriumui už Fondo turto apskaitą negali būti didesnis 0,3% Fondo grynųjų aktyvų vidutinės metinės vertės. Iš Fondo lėšų Depozitoriumui papildomai mokamas fiksuotas 30 litų (LTL) mokestis už kiekvieną vertybinių popierių ir pinigų operaciją Fondo pinigų ir vertybinių popierių sąskaitose.

Atlyginimas depozitoriumui už Fondo akcijų apskaitą skaičiuojamas kiekvieną kartą, kai yra skaičiuojama Fondo GAV, o sumokamas kiekvieno metų ketvirčio pabaigoje per 10 darbo dienų. Pasibaigus metams mokestis depozitoriumui už Fondo akcijų apskaitą dydis yra tikslinamas. Per metus susidarę mokesčio permokėjimai per 10 darbo dienų grąžinami Fondui, susidarę mokesčio neprimokėjimai per 10 darbo dienų nuskaitomi iš Fondo sąskaitų depozitoriumui.

6. Turto ir įsipareigojimų įvertinimo metodai ir periodiškumas

Fondo turtas ir įsipareigojimai vertinami vadovaujantis Lietuvos Respublikos įstatymų, LR Vertybinių popierių komisijos patvirtintos Grynujų aktyvų vertės skaičiavimo metodikos ir kitų teisės aktų nustatyta tvarka.

Turtas (ar jo dalis) yra nurašomas tik tada, kai įgyvendinamos teisės į šį turtą (ar jo dalį) arba, kai baigiasi teisių galiojimo laikas, arba, kai šios teisės perleidžiamos.

Įsipareigojimai (ar jų dalis) turi būti nurašomi tik tada, kai jie išnyksta, t. y., kai sutartyje nustatyti įsipareigojimai įvykdomi, anuliuojami ar nustoja galioti.

Turto ir įsipareigojimų skaičiavimas yra grindžiamas jų tikrąja verte, kuri atspindi grynujų aktyvų vertę, už kurią labiausiai tikėtina šiuos aktyvus parduoti.

Skaičiuojant grynujų aktyvų vertę, užsienio valiuta denominuotų turto ir įsipareigojimų vertė nustatoma pagal Lietuvos banko nustatytą oficialų tos valiutos ir lito kursą, galiojantį vertinimo dieną.

Investicijos finansinėse ataskaitose atvaizduojamos ataskaitinio laikotarpio pabaigos tikrąja verte. Vertybinių popierių, kuriais prekiaujama reguliuojamose rinkose, tikroji vertė nustatoma pagal rinkos viešai paskelbtą vertinimo dieną uždarymo kainą. Jei vertybiniai popieriai nebuvo kotiruojami per paskutinę prekybos sesiją, naudojama paskutinė žinoma uždarymo kainą.

Vertybinių popierių, turėtų ataskaitinio laikotarpio pradžioje, tikrosios vertės ataskaitinio laikotarpio pabaigoje ir tikrosios vertės ataskaitinio laikotarpio pradžioje skirtumas, taip pat ataskaitinį laikotarpį įsigytų vertybinių popierių tikrosios vertės ataskaitinio laikotarpio pabaigoje ir jų įsigijimo savikainos skirtumas priskiriamas investicijų vertės padidėjimui arba sumažėjimui.

Sudarant finansines ataskaitas, investicijų pervertinimas atliekamas kiekvieną ketvirtį. Skaičiuojant grynuosius aktyvus investicijų pervertinimas atliekamas kiekvieną dieną.

Grynieji pinigai vertinami nominaliąja verte. Pinigams priskiriami pinigai Fondo banko sąskaitose. Pinigų ekvivalentais pripažįstami trumpalaikiai indėliai, iki kurių termino pabaigos liko ne daugiau kaip 3 mėnesiai. Pinigai ir pinigų ekvivalentai, nominuoti užsienio valiuta, įvertinami Lietuvos Respublikos nacionaline valiuta litais pagal skaičiavimo dieną nustatytą oficialų Lietuvos Banko valiutų kursą.

7. Investicinio vieneto vertės nustatymo taisyklės.

1. Fondo GAV yra apskaičiuojama kiekvieną darbo dieną tokia tvarka:

1.1. Paraiškos pirkti (išpirkti) akcijas priimamos procedūrose nustatyta tvarka iki X darbo dienos (dienos, kai pateikiama paraiška) 16.00 val. Lietuvos laiku.

1.2. Paraišką priėmęs asmuo vieną paraiškos egzempliorių turi gražinti investuotojui su patvirtinimu, kad ją gavo.

1.3. Jei paraiškos pateikiamos po 16.00 val. Lietuvos laiku, skaičiuojant X darbo dienos GAV į jas neatsižvelgiama. Jos bus įvertintos skaičiuojant kitos (X+1) darbo dienos GAV.

1.4. Pasibaigus X dienos NASDAQ OMX Vilnius biržos prekybos sesijai (16 valandą), skaičiuojama tos (X) darbo dienos GAV ir pagal ją apskaičiuojama Fondo akcijos vertė; skaičiavimas baigiamas iki kitos darbo dienos 17.00 val. Lietuvos laiku.

1.5. Apskaičiavus fondo akcijos vertę, vykdomos (X-1) darbo dieną po 16.00 val. Lietuvos laiku gautos ir X darbo dieną iki 16.00 val. Lietuvos laiku gautos paraiškos.

1.6. Įvykdžius minėtas paraiškas, apskaičiuojama galutinė X darbo dienos GAV. Skaičiavimas baigiamas iki tos pačios dienos 17.30 val. Lietuvos laiku.

2. Vienos fondo akcijos kaina yra lygi fondo grynujų aktyvų vertei padalintai iš fondo išleistų ir neišpirktų akcijų skaičiaus.

3. Fondas savo nuosavus (grynuosius) aktyvus, tenkančius vienai akcijai, privalo skelbti kiekvieną kartą, kai išleidžia arba išperka savo akcijas, bet ne rečiau kaip nustatyta galiojančiuose teisės aktuose. Akcijos kaina skelbiama visose fondo akcijų pardavimo ir išpirkimo vietose ir fondo tinklapiuose www.indexfund.lt.

4. Fondo akcijos vertė turi sutapti su vienai akcijai tenkančių fondo grynujų aktyvų dalimi.

5. Parduodant fondo akcijas, akcijos pardavimo kaina padidinama vienai akcijai tenkančių fondo akcijų platinimo sąnaudų suma, kurios sudaro 2 procentus akcijos kainos. Vienai akcijai tenkančių platinimo sąnaudų suma skelbiama fondo prospekte.

6. Išperkant fondo akcijas, akcijos išpirkimo kaina mažinama vienai akcijai tenkančių išpirkimo sąnaudų suma. Išpirkimo sąnaudų dydį apskaičiuoja fondo Valdymo įmonė. Vienai akcijai tenkančių išpirkimo sąnaudų suma skelbiama fondo prospekte.

2010 m. gruodžio 29 d. buvo atliktas Fondo akcijų kainos skaidymas (skaidymo santykis 100:1; akcijų skaičius buvo padaugintas iš 100, o akcijos kaina padalinta iš 100). Akcijos kaina nuo 2010 m. gruodžio 29 d. skaičiuojama su 4 skaičiais po kablelio.

9. Investicijų portfelio struktūra.

Fondas investuoja į OMX Baltic Benchmark GI akcijų indeksą sudarančias priemones. Indeksas yra skaičiuojamas The Nasdaq OMX Group, Inc. ir intelektinės nuosavybės teisės į Indeksą priklauso The Nasdaq OMX Group, Inc. Fondo investicinis portfelis sudaromas sekant Indeksą, t.y. kiek tai įmanoma, investuojama į visus Indeksą sudarančius vertybinius popierius tokiu santykiu, koku jie įeina į Indeksą. Indeksas yra sudarytas iš didžiausios laisvų akcijų kapitalizacijos Lietuvos, Latvijos ir Estijos bendrovių, kurių akcijos listinguojamos NASDAQ OMX Vilnius, NASDAQ OMX Riga ir NASDAQ OMX Tallinn biržose (toliau - Biržos), akcijų. Indeksas yra kapitalizuotas, t.y. didžiausios laisvų akcijų kapitalizacijos bendrovės (įmonės) turi didžiausią svorį Indekse. Indeksas yra performuojamas kartą per pusmetį.

Investicinio portfelio struktūra 2012 m. birželio 30 d. pateikta šių finansinių ataskaitų 3 ir 4 pastabose.

III. Pastabos

1. Grynujų aktyvų vertė, vienetų skaičius ir vertė ataskaitinio laikotarpio pradžioje ir pabaigoje, prieš metus, prieš dvejus metus. Kai vienetai yra skirtingų klasių, duomenys pateikiami pagal klases.

	Ataskaitinio laikotarpio pradžioje (2011.12.31)	Ataskaitinio laikotarpio pabaigoje (2012.06.30)	Prieš metus (2011.06.30)	Prieš dvejus metus (2010.06.30)
Grynujų aktyvų vertė, Lt	7 576 015	7 958 475	9 715 028	7 030 157
Apskaitos vieneto vertė, Lt	19,6942*	22,1652*	23,6868*	1 890,34
Apskaitos vienetų skaičius	384 682*	359 052*	410 146*	3 719

* 2010 12 29 d. buvo atliktas akcijų skaidymas santykiu 100 už 1. Kaina dalinama iš 100, akcijų skaičius dauginamas iš 100.

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

	Ataskaitinis laikotarpis 2012 m. I pusmetis		Ankstesnis ataskaitinis laikotarpis 2011 m. I pusmetis	
	Apskaitos vienetų skaičius	Vertė, Lt	Apskaitos vienetų skaičius	Vertė, Lt
Išplatintų apskaitos vienetų skaičius (konvertuojant pinigus į vienetus)	440	9 020	15 774	405 128
Išpirktų apskaitos vienetų skaičius (konvertuojant vienetus į pinigus)	26 070	561 094	12 663	310 482
Skirtumas	(25 630)	(552 074)	3 111	94 646

3. Investicijų paskirstymas

Investicijų pasiskirstymas	Ataskaitinio laikotarpio pabaigoje (2012 06 30)		Prieš metus (2011 06 30)	
	Rinkos vertė, LTL	Dalis GA, %	Rinkos vertė, LTL	Dalis GA, %
Pagal investavimo objektus				
Nuosavybės vertybiniai popieriai	7 762 774	97,54	9 365 094	96,40
Pinigai	184 620	2,32	248 005	2,55
Iš viso:	7 947 394	99,86	9 613 099	98,95
Pagal valiutas				
LTL	3 266 906	41,05	4 630 416	0,83
EUR	4 328 572	54,39	4 517 697	93,33
LVL	351 916	4,42	464 986	4,79
Iš viso:	7 947 394	99,86	9 613 099	98,95
Pagal geografinę zoną				
Lietuva	3 447 729	43,32	4 797 799	49,39
Latvija	229 068	4,13	464 693	4,78
Estija	4 170 597	52,41	4 350 607	44,78
Iš viso:	7 947 394	99,86	9 613 099	98,95

4. Investicijų portfelio struktūra. Parodomas investicijų pasiskirstymas pagal investavimo strategiją atitinkančius kriterijus nurodant, kokią subjekto grynųjų aktyvų vertės dalį (procentais) sudaro investicijos.

2012 m. birželio 30 d.:

Emitento pavadinimas	Šalis	ISIN kodas	Kiekis, vnt.	Bendra nominali vertė	Bendra įsigijimo vertė	Bendra rinkos vertė	Dalis GA, %
Nuosavybės vertybiniai popieriai, įtraukti į Oficialųjį ar jį atitinkantį prekybos sąrašą:							
AB Apranga	LT	LT0000102337	43 795	43 795	131 030	276 724	3,48
AB CITY SERVICE	LT	LT0000127375	23 280	23 280	175 477	143 882	1,81
AB Invalda	LT	LT0000102279	41 942	41 942	197 648	369 284	4,64
AB Lietuvos dujos	LT	LT0000116220	50 269	50 269	118 385	96 331	1,21
AB Grigiškės	LT	LT0000102030	44 015	44 015	40 755	79 939	1,00
AB Panevėžio statybos trestas	LT	LT0000101446	17 185	17 185	62 560	64 677	0,81
AB Pieno žvaigždės	LT	LT0000111676	66 878	66 878	224 486	427 195	5,37
AB Rokiškio sūris	LT	LT0000100372	30 015	30 015	78 801	140 945	1,77
AB Lesto	LT	LT0000128449	53 123	53 123	192 411	105 652	1,32
AB Šiaulių bankas	LT	LT0000102253	257 370	257 370	261 366	218 607	2,75
AB TEO LT	LT	LT0000123911	263 508	263 508	599 320	579 568	7,28
AB Ūkio bankas	LT	LT0000102352	247 786	247 786	175 928	141 167	1,77
AB Linas Agro Group	LT	LT0000128092	103 657	103 657	203 727	180 917	2,27
AB Vilniaus baldai	LT	LT0000104267	971	3 884	38 411	39 897	0,50
Grindeks	LV	LV0000100659	8 670	42 975	280 923	192 956	2,42
Latvijas Kugnieciba	LV	LV0000101103	15 696	77 800	31 709	19 606	0,25
Olainfarm	LV	LV0000100501	5 999	29 735	77 115	87 719	1,10
SAF Technika	LV	LV0000101129	2 687	13 319	37 401	16 116	0,20
Tallinna Kaubamaja	EE	EE0000001105	28 553	59 153	632 244	552 092	6,94
Silvano Fashion Group	EE	EE3100001751	61 501	84 940	700 867	734 733	9,23
AS Tallink Grupp	EE	EE3100004466	734 074	1 520 766	2 050 129	1 556 251	19,55
Nordecon AS	EE	EE3100039496	8 094	0	31 297	32 698	0,41
Merko Ehitus	EE	EE3100098328	9 887	0	318 471	213 020	2,68
Harju Elekter	EE	EE3100004250	15 662	37 854	184 869	133 572	1,68
Tallina Vesi	EE	EE31000026436	11 990	24 839	356 994	306 353	3,85
Olympic Entertainment Group	EE	EE3100084021	102 698	0	531 162	460 974	5,79
Premia Foods AS	EE	EE3100101031	76 153	157 765	252 447	180 903	2,27
Iš viso					7 985 933	7 351 778	92,38
Nuosavybės vertybiniai popieriai, įtraukti į Papildomąjį ar jį atitinkantį prekybos sąrašą:							
AB Klaipėdos nafta	LT	LT0000111650	198 545	198 545	234 593	269 416	3,39
AB Žemaitijos pienas	LT	LT0000121865	40 403	40 403	33 627	87 190	1,10
AB Snaigė	LT	LT0000109274	22 500	22 500	40 828	41 718	0,52
Valmieras stikla skiedra	LV	LV0000100485	3 810	18 885	13 401	12 672	0,16
Iš viso					322 449	410 996	5,16
Iš viso nuosavybės vertybinių popierių					8 308 382	7 762 774	97,54

Banko pavadinimas	Šalis	Valiuta	Bendra rinkos vertė, Lt	Dalis GA, %
Pinigai:				
AB SEB bankas	LT	EUR	157 976	1,98
AB SEB bankas	LT	LTL	3 796	0,05
AB SEB bankas	LT	LVL	22 848	0,29
Iš viso pinigų:			184 620	2,32

2011 m. birželio 30 d.:

Emitento pavadinimas	Šalis	ISIN kodas	Kiekis, vnt.	Bendra nominali vertė	Bendra įsigijimo vertė	Bendra rinkos vertė	Dalis GA, %
Nuosavybės vertybiniai popieriai, įtraukti į Oficialųjį ar jį atitinkantį prekybos sąrašą:							
AB APRANGA	LT	LT0000102337	41 244	41 244	91 144	230 130	2.37
AB CITY SERVICE	LT	LT0000127375	23 280	23 280	175 477	227 479	2.34
AB INVALIDA	LT	LT0000102279	47 745	47 745	256 031	395 650	4.07
AB LIETUVOS DUJOS	LT	LT0000116220	50 269	50 269	118 385	114 208	1.18
AB LINAS AGRO GROUP	LT	LT0000128092	87 705	87 705	176 965	145 357	1.50
AB PANEVĖŽIO STATYBOS TRESTAS	LT	LT0000101446	17 185	17 185	62 560	107 458	1.11
AB PIENO ŽVAIGŽDĖS	LT	LT0000111676	68 448	68 448	220 142	373 413	3.84
AB ROKIŠKIO SŪRIS	LT	LT0000100372	27 915	27 915	68 322	138 794	1.43
AB LESTO	LT	LT0000128449	53 123	53 123	192 411	141 236	1.45
AB SANITAS	LT	LT0000106171	14 233	14 233	116 718	469 568	4.83
AB ŠIAULIŲ BANKAS	LT	LT0000102253	152 112	237 391	152 112	165 967	1.71
AB TEO LT	LT	LT0000123911	498 098	498 098	1 045 860	1 126 491	11.60
AB ŪKIO BANKAS	LT	LT0000102352	265 386	265 386	281 862	274 897	2.83
AB BANKAS SNORAS	LT	LT0000101925	77 788	77 788	94 107	89 708	0.92
AB GRIGIŠKĖS	LT	LT0000102030	44 015	44 015	40 754	115 501	1.19
AB SNAIGĖ	LT	LT0000109274	44 400	66 052	746 331	45 796	0.47
AS NORDECON AS	EE	EE3100039496	24 191	265 386	121 733	107 415	1.11
AS TALLINK GROUPE	EE	EE3100004466	703 244	24 191	2 025 972	1 685 144	17.35
AS PREMIA FOODS AS	EE	EE3100101031	70 353	703 244	238 629	198 704	2.05
SILVANO FASHION GROUP	EE	EE3100001751	57 947	70 353	661 144	660 262	6.80
MERKO EHITUS	EE	EE3100098328	9 507	57 947	308 035	257 682	2.65
OLYMPIC ENTERTAINMENT GROUP	EE	EE3100084021	96 698	9 507	526 544	445 728	4.59
TALLINNA KAUBAMAJA	EE	EE0000001105	26 104	96 698	599 605	466 613	4.77
TALLINA VESI	EE	EE3100026436	10 950	26 104	331 857	279 780	2.88
AS EKSPRESS GRUPE	EE	EE3100016965	24 400	10 950	148 673	114 157	1.18
HARJU ELEKTER	EE	EE3100004250	14 712	24 400	175 947	135 122	1.39
GRINDEKS	LV	LV0000100659	8 670	14 712	280 923	287 133	2.96
SAF TECHNIKA	LV	LV0000101129	2 687	8 670	37 401	35 464	0.37
VENSPILS NAFTA	LV	LV0000100816	9 198	2 687	62 452	64 956	0.67
LATVIJAS KUGNIECIBA	LV	LV0000101103	39 696	9 198	80 273	77 139	0.79
Iš viso					9 438 369	8 976 952	92.40
Nuosavybės vertybiniai popieriai, įtraukti į Papildomąjį ar jį atitinkantį prekybos sąrašą:							
AB KLAIPĖDOS NAFTA	LT	LT0000111650	198 964	198 964	218 614	298 151	3.07
AB ŽEMAITIJOS PIENAS	LT	LT0000121865	35 703	35 703	22 277	89 991	0.93
Iš viso					240 891	388 142	4.00
Iš viso nuosavybės vertybinių popierių					9 679 260	9 365 094	96.40

Banko pavadinimas	Šalis	Valiuta	Bendra rinkos vertė, Lt	Dalis GA, %
Pinigai:				
AB SEB bankas	LT	LTL	248 005	2,55
Iš viso pinigų:			248 005	2,55

5. Investicijų vertės pokytis per ataskaitinį laikotarpį dėl jų įsigijimo, pardavimo ar išpirkimo ir tikrosios vertės pasikeitimo.

Investicijos	Pokytis					
	Praėjusio ataskaitinio laikotarpio pabaigoje 2011.12.31	Įsigyta	Parduota (išpirkta) *	Vertės padidėjimas	Vertės sumažėjimas	Ataskaitinio laikotarpio pabaigoje 2011.12.31
Terminuoti indėliai						
Pinigų rinkos priemonės						
Ne nuosavybės vertybiniai popieriai						
Vyriausybių ir centrinių bankų arba jų garantuoti ne nuosavybės vertybiniai popieriai						
Kiti ne nuosavybės vertybiniai popieriai						
Nuosavybės vertybiniai popieriai	7 341 084	636 872	932 789	872 467	15 4 860	7 762 774
Kitų kolektyvinio investavimo subjektų investiciniai vienetai ir akcijos						
Išvestinės finansinės priemonės						
Nekilnojamo turto objektai						
Kitos investicijos						
Iš viso:	7 341 084	636 872	932 789	872 467	15 4 860	7 762 774

* Investicijų pardavimo pelnas (24 132 Lt) ir investicijų pardavimo nuostoliai (11 407 Lt) per 2012 m. I pusmetį įtraukti į parduotų (išpirktų) investicijų vertės eilutę.

Investicijos	Pokytis					
	Praėjusio ataskaitinio laikotarpio pabaigoje 2010.12.31	Įsigyta	Parduota (išpirkta) *	Vertės padidėjimas	Vertės sumažėjimas	Ataskaitinio laikotarpio pabaigoje 2011.06.30
Terminuoti indėliai						
Pinigų rinkos priemonės						
Ne nuosavybės vertybiniai popieriai						
Vyriausybių ir centrinių bankų arba jų garantuoti ne nuosavybės vertybiniai popieriai						
Kiti ne nuosavybės vertybiniai popieriai						
Nuosavybės vertybiniai popieriai	9 716 065	5 874 763	5 277 320	416 745	1 365 159	9 365 094
Kitų kolektyvinio investavimo subjektų investiciniai vienetai ir akcijos						
Išvestinės finansinės priemonės						
Nekilnojamo turto objektai						
Kitos investicijos						
Iš viso:	9716065	5920745	5277320	417671	1365159	9412002

* Investicijų pardavimo pelnas (39 181 Lt) ir investicijų pardavimo nuostoliai (223 081 Lt) per 2011 m. I pusmetį įtraukti į parduotų (išpirktų) investicijų vertės eilutę.

6. Investicijų pardavimo rezultatai (pelnas ir nuostoliai).

Grynųjų aktyvų ataskaitos straipsniai	Ataskaitinis laikotarpis 2012.01.01-2012.06.30	Praėję finansiniai metai 2011.01.01-2011.06.30
Vyriausybių ir centrinių bankų arba jų garantuoti ne nuosavybės vertybiniai popieriai		
Nuosavybės vertybiniai popieriai	12 724	(183 900)
Kitų kolektyvinio investavimo subjektų investiciniai vienetai ir akcijos		
Iš viso:	12 724	(183 900)

Investicijų pardavimo pelnas 2012 m. I pusmetį sudarė 24 131 Lt, o investicijų pardavimo nuostoliai – 11 407 Lt.

Investicijų pardavimo pelnas 2010 m. I pusmetį sudarė 39 181 Lt, o investicijų pardavimo nuostoliai – 223 081 Lt.

7. Išvestinės finansinės priemonės ar jų grupės pagal 26-ąjį verslo apskaitos standartą „Išvestinės finansinės priemonės“. **Nebuvo.**

8. Atlyginimo tarpininkams sąnaudos

Tarpininkas	Suteiktų paslaugų pobūdis	Atlygis už paslaugą (Lt) 2012 m. I pusmetis	Atlygis už paslaugą (Lt) 2011 m. I pusmetis	Ryšys su subjekto valdymo įmone
UAB FMI „Orion Securities“	Finansinių priemonių pirkimo/pardavimo komisiniai	1 500	11 241	

9. Dalyviams apskaičiuoti ir (ar) išmokėti dividendai ar kitos išmokos, kurias išmokėjus vienetų skaičius nesikeičia. **Nebuvo.**

10. Pasiskolintos ir paskolintos lėšos. **Nebuvo.**

11. Trečiosios šalies įsipareigojimai garantuoti subjekto pajamingumo dydį. **Nebuvo.**

12. Sandorių su susijusiais asmenimis (valdymo įmone, tos pačios valdymo įmonės subjektais ir pan.) ataskaitinio ir praėjusio ataskaitinio laikotarpių sumos, suskirstytos į grupes, kita reikšminga informacija pagal 30-ąjį verslo apskaitos standartą „Susiję asmenys“.

2012 metų I pusmetį valdymo įmonei buvo priskaičiuota 40 433 Lt. valdymo mokesčio (2011 m. – 48 512 Lt.).

13. Reikšmingas apskaitinių įvertinimų, jeigu tokių buvo, pakeitimo poveikis ar pateiktos lyginamosios informacijos koregavimas dėl apskaitos politikos keitimo ar dėl klaidų taisymo pagal 7-ąjį verslo apskaitos standartą „Apskaitos politikos, apskaitinių įvertinimų keitimas ir klaidų taisymas“. **Nebuvo.**

14. Trumpas reikšmingų pobalansinių įvykių, kurių neatskleidimas gali turėti reikšmingos įtakos įmonės finansinių ataskaitų vartotojų galimybei priimti sprendimus, apibūdinimas pagal 19-ąjį verslo apskaitos standartą „Atidėjiniai, neapibrėžtieji įsipareigojimai ir turtas bei pobalansiniai įvykiai“. **Nebuvo.**

15. Po grynųjų aktyvų skaičiavimo datos įvykę reikšmingi turto ir įsipareigojimų pokyčiai, neįtraukti į grynųjų aktyvų vertę. **Nebuvo.**

16. Kita reikšminga informacija apie kolektyvinio investavimo subjekto ar pensijų fondo finansinę būklę, veiksniai ir aplinkybės, turėję įtakos subjekto turtui ar įsipareigojimams pagal 18-ąjį verslo apskaitos standartą „Finansinis turtas ir finansiniai įsipareigojimai“ ir kitus verslo apskaitos standartus. **Nebuvo.**

17. Investicijų grąža ir investicijų grąžos lyginamoji informacija. **Teikiama tik metų ataskaitoje.**

18. Atskaitymai

Atskaitymai	Atskaitymų dydis, taikytas ataskaitiniu laikotarpiu	Per ataskaitinį laikotarpį sumokėtų atskaitymų suma (Lt)	Per ataskaitinį laikotarpį priskaičiuotų atskaitymų suma (Lt)	Procentinė dalis nuo ataskaitinio laikotarpio vidutinės grynujų aktyvų vertės
2012.01.01-2012.06.30				
Už valdymą:				
<i>nekintamas dydis</i>	1% vidutinių metinių GAV	40 185	40 433	0,50%
<i>sėkmės mokestis</i>				
Depozitoriumui				
<i>valdymo mokestis</i>	0,22% vidutinių metinių GAV	8 812	8 895	0,11%
<i>už sandorių sudarymą</i>		240	630	0,01%
Už sandorių sudarymą		1 470	1 500	0,02%
Už auditą		4 840	6 099	0,08%
Kitos veiklos išlaidos		16 490	12 457	0,15%
Išlaidų, įskaičiuojamų į BIK, suma		70 567	68 514	0,85%
BIK % nuo vidutinės GAV*		0,85%		
Visų išlaidų suma	3% vidutinių metinių GAV	72 037	70 014	0,87%
PAR (jei skaičiuojamas)*		-----		
2011.01.01-2011.06.30				
Už valdymą:				
<i>nekintamas dydis</i>	1% vidutinių metinių GAV	40 185	40 433	0,50%
<i>sėkmės mokestis</i>				
Depozitoriumui				
<i>valdymo mokestis</i>	0,22% vidutinių metinių GAV	8 812	8 895	0,11%
<i>už sandorių sudarymą</i>		240	630	0,01%
Už sandorių sudarymą		1 470	1 500	0,02%
Už auditą		4 840	6 099	0,08%
Kitos veiklos išlaidos		16 490	12 457	0,15%
Išlaidų, įskaičiuojamų į BIK, suma		70 567	68 514	0,85%
BIK % nuo vidutinės GAV*		0,85%		
Visų išlaidų suma	3% vidutinių metinių GAV	72 037	70 014	0,87%
PAR (jei skaičiuojamas)*		-----		

* Bendrasis išlaidų koeficientas (BIK) – procentinis dydis, kuris parodo, kokia vidutinė fondo grynujų aktyvų dalis skiriama jo valdymo išlaidoms padengti. Šios išlaidos tiesiogiai sumažina investuotojo investicijų grąžą. Pažymėtina, kad, skaičiuojant BIK, į sandorių sudarymo išlaidas neatsižvelgiama.

* Portfelio apyvartumo rodiklis (PAR) – rodiklis, apibūdinantis prekybos kolektyvinio investavimo subjekto fondo portfelį sudarančiomis priemonėmis aktyvumą. Fondai, kurių PAR aukštas, patiria didesnes sandorių sudarymo išlaidas.

19. Esminiai įvykiai. **Nebuvo.**

Gen. direktorius
(įmonės administracijos vadovo pareigų pavadinimas)

(parašas, data)

Rytis Davidovičius
(vardas ir pavardė)

23. Visas audito išvados tekstas.

24. Informacija apie kolektyvinio investavimo subjekto investicinės veiklos pajamas ir patirtas sąnaudas per ataskaitinį laikotarpį:

I.	Pajamos iš investicinės veiklos	
1.	<i>Palūkanų pajamos</i>	19
2.	<i>Realizuotas pelnas iš investicijų į:</i>	287 780
2.1.	nuosavybės vertybinius popierius	289 078
2.2.	vyriausybės ne nuosavybės vertybinius popierius	-----
2.3.	įmonių ne nuosavybės vertybinius popierius	-----
2.4.	finansines priemones	-----
2.5.	išvestines finansines priemones	-----
2.6.	kitų kolektyvinio investavimo subjektų vienetų	-----
2.7.	Kita (valiutų kursų pasikeitimo įtaka)	(1 298)
3.	<i>Nerealizuotas (nuostolis) / pelnas iš:</i>	717 559
3.1.	nuosavybės vertybinių popierių	717 559
3.2.	vyriausybės ne nuosavybės vertybinių popierių	-----
3.3.	įmonių ne nuosavybės vertybinių popierių	-----
3.4.	finansinių priemonių	-----
3.5.	išvestinių finansinių priemonių	-----
3.6.	kitų kolektyvinio investavimo subjektų vienetų	-----
3.7.	Kitų	-----
	Pajamų iš viso	1 005 358
II.	Sąnaudos	
1.	<i>Veiklos sąnaudos:</i>	70 014
1.1.	atskaitymai už valdymą	40 433
1.2.	atskaitymai depozitoriumui	9 525
1.3.	mokėjimai tarpininkams	1 500
1.4.	mokėjimai už auditą	6 099
1.5.	kiti atskaitymai ir išlaidos	12 457
2.	<i>Kitos išlaidos</i>	-----
	Sąnaudų iš viso	70 014
III.	Grynosios pajamos	935344
IV.	Išmokos (dividendai) investicinių vienetų savininkams	-----
V.	Reinvestuotos pajamos	-----

25. Kita reikšminga informacija apie kolektyvinio investavimo subjekto finansinę būklę, veiksniai ir aplinkybės, turėję įtakos kolektyvinio investavimo subjekto turtui ar įsipareigojimams.

VII. INFORMACIJA APIE DIVIDENDŲ IŠMOKĖJIMĄ

26. Pateikti informaciją apie priskaičiuotų ir (ar) išmokėtų dividendų (pusmečio ataskaitoje – tarpinių dividendų po mokesčių) sumas, nurodyti laikotarpį, už kurį dividendai buvo mokami, išmokėjimo datas, dividendų dydį, tenkantį vienam vienetui (akcijai), ir kitą svarbią informaciją.

VIII. INFORMACIJA APIE KOLEKTYVINIO INVESTAVIMO SUBJEKTO REIKMĖMS PASISKOLINTAS LĖŠAS

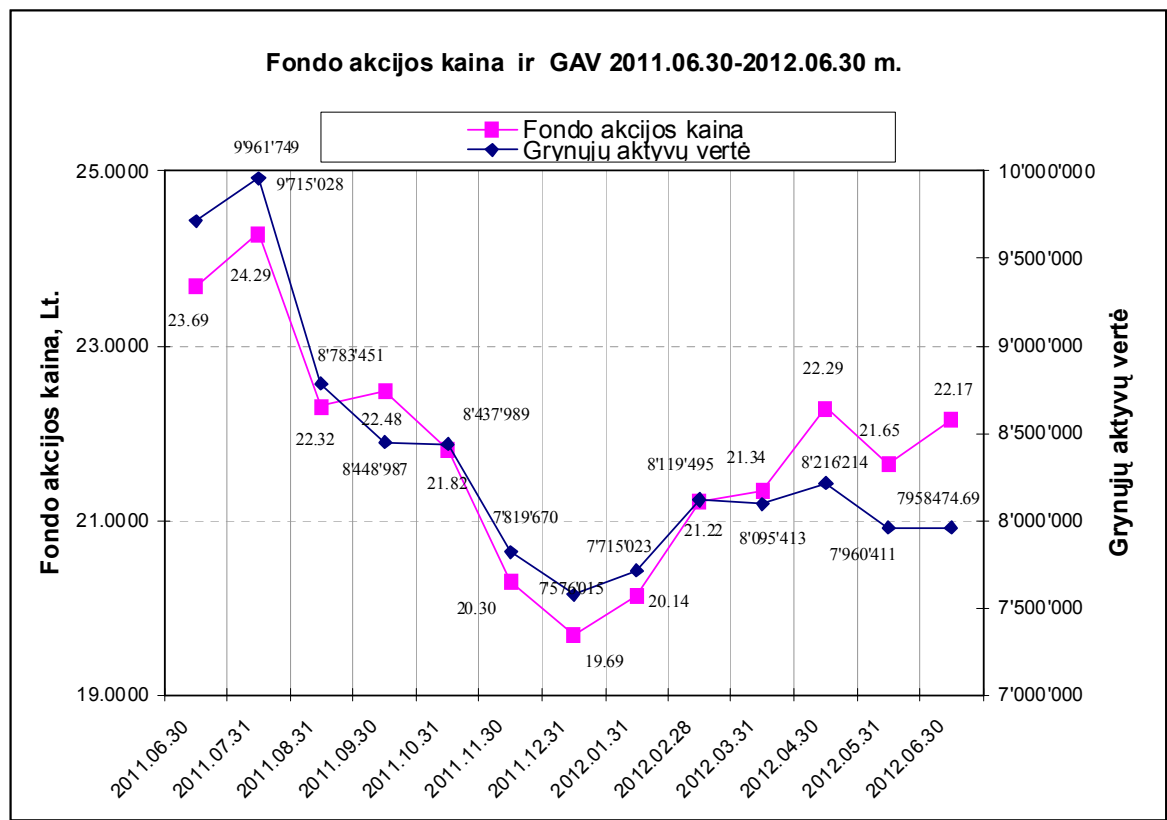
27. Kolektyvinio investavimo subjekto reikmėms pasiskolintos lėšos ataskaitinio laikotarpio pabaigoje:

IX. KITA INFORMACIJA

28. Paaiškinimai, komentarai, iliustruojamoji grafinė medžiaga ir kita svarbi informacija apie kolektyvinio investavimo subjekto veiklą, kad investuotojas galėtų tinkamai įvertinti subjekto veiklos pokyčius ir rezultatus.

Žemiau pateikiame fondo akcijų kainų ir fondo aktyvų pokyčius grafiškai:

a) Fondo akcijos kaina ir fondo aktyvai 2011.06.30. - 2012.06.30. litais:



Ankstesnė Fondo veikla negarantuoja ateities rezultatų.

X. ATSAKINGI ASMENYS

29. Konsultantų, kurių paslaugomis buvo naudotasi rengiant ataskaitą (FMĮ, auditoriai, kt.) vardai, pavardės (juridinių asmenų pavadinimai), adresai, leidimų verstis atitinkama veikla pavadinimas ir numeris.

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

UAB "Orion Asset Management" generalinis direktorius Rytis Davidovičius.

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

31. 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 Rytis Davidovičius _____

UAB "Orion Asset Management"

Vyr.finansininkas Dainius Minelga _____

32. Asmenys, atsakingi už ataskaitoje pateiktą informaciją.

32.1. 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 Rytis Davidovičius. Tel./fax. 2041541. El. pašto adresas rd@orion.lt.

UAB "Orion Asset Management" vyr.finansininkas Dainius Minelga. Tel./fax. 2313833. El. pašto adresas dm@orion.lt.

32.2. 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.
