



OMX BALTIC BENCHMARK FUND



OMX Baltic Benchmark Fund (Fondas) yra biržoje prekiaujamas fondas (ETF), listinguojamas NASDAQ OMX Vilnius biržoje. Fondas seka OMX Baltic Benchmark GI indeksą, kurį sudaro didžiausios ir likvidžiausios bendrovės Baltijos rinkoje iš daugelio ekonominės veiklos sektorių. Fondo investicinių portfelių sudaro didžiausią laisvą kapitalizaciją turinčių bendrovių akcijos, kuriomis prekiaujama NASDAQ OMX Baltic biržoje. Daugiau informacijos <http://www.orion.lt>

2016 m. kovo mėn.

Pagrindinė informacija

Fondo dydis 2,02 mln.
GAV vienam fondo vienetui 8,3129
Valiuta EUR

Kodai

ISIN kodas LT0000990012
Bloomberg tikeris OAM0BBF1L LH
Indekso Bloomberg tikeris OMXBBGI

Fondo tipas

UCITS III suderinamumas Taip
Teisinė forma UCITS, IKKB
Portfelio sudėtis akcijos ir gryniesi pinigai
Sandorio šalies / kredito rizika Nėra
Įsteigimo data 2001 04 09
Valdymo įmonė Orion Asset Management
Prižiūrinti institucija Lietuvos Respublikos Vertybinių popierių komisija
Registruotas platinimui Lietuva, Švedija, Norvegija
Depozitoriumas AB SEB bankas
Atsiskaitymo data T + 2
Dividendai Nėra (reinvestuojami)
Investavimo periodas 2-5 metai
Rinkos formuotojas Orion Securities

Mokesčiai

Valdymo mokestis 1,00%
Platinimo mokestis* 2,00%
Išpirkimo mokestis* 1,00%

*Šių mokesčių nėra, jei fondo vienetais prekiaujama biržoje

Svarbiausi rodikliai

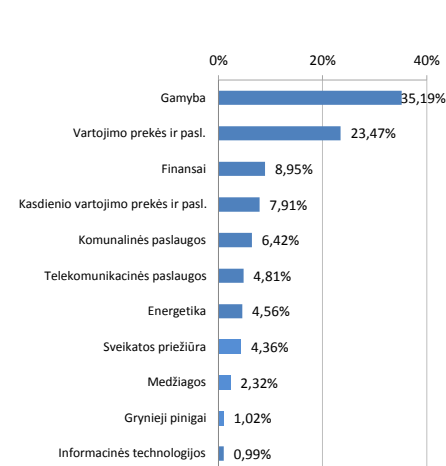
Rodiklis	Indeksas	Fondas
Pozicijų skaičius (2016.03.31)	27	27
Standartinis nuokrypis (12 mėn)	9,44%	9,32%
Alpha (12 mėn)	-2,45%	
Beta (12 mėn)		1,00
Sharpe (12 mėn)***	0,75	0,48
Koreliacijos koeficientas (12 mėn)		0,99
Metinė sekimo paklaida (12 mėn)		0,77%
Portfelio apyvartumo rodiklis (2014)		3,00%
Bendrasis išlaidų koeficientas (2014)		1,87%

*** Mažai rizikingos investicijos metinis pajamingumas: 2%

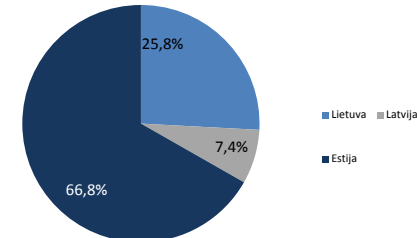
Kontaktai

Adresas A. Tumėno g. 4B, 9-as aukštasis
LT-01109 Vilnius, Lietuva
Telefonas +370-5-2032698
El. paštas oam@orion.lt
Interneto svetainė am.orion.lt

Pasiskirstymas pagal sektorius (GICS)



Akcijų dalis pagal valstybę



5 didžiausios pozicijos (%)

Įmonė	Valstybė	Procentas
AS Tallink Grupp	EE	29,68
Olympic Entertainment Group	EE	8,60
Tallinna Kaubamaja	EE	7,48
Tallina Vesi	EE	6,42
AB Šiaulių bankas	LT	4,97

Naujausi rezultatai

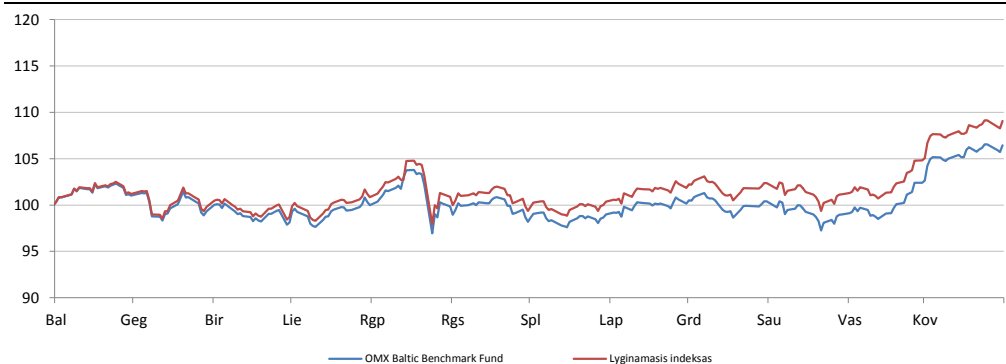
	1 mėn.	3 mėn.	6 mėn.	1 m.	3 m.	YTD
Fondas, %	3,94	6,04	8,40	6,44	4,70	6,04
Indeksas, %	4,07	6,56	9,78	9,07	11,41	6,56

Istoriniai rezultatai

	2001**	2002	2003	2004	2005	2006	2007	2008	2009	2010	2011	2012	2013	2014	2015
Fondas, %	-6,42	0,54	83,82	49,19	34,23	4,98	8,69	-67,69	38,82	54,65	-24,58	23,45	9,44	-8,87	11,64
Indeksas, %	-12,69	12,20	105,80	68,18	52,93	9,78	4,38	-65,14	46,04	56,49	-19,11	26,63	12,16	-7,65	14,43

** nuo 2001 m. balandžio 9 d.

Istorija (1 metai)



Svarbi informacija

OMX Baltic Benchmark Fund (Fondas) gali neatitikti visų investuotojų poreikių. Orion Asset Management (valdymo įmonė) neatsako už Fondo kainos pokyčius, priklausančius nuo rinkos. Fondo praeities rezultatai negarantuoja ar jokia kitu būdu neveikia ateities rezultatų. Taip pat valdymo įmonė ir (arba) susijusios bendrovės ir (arba) jų darbuotojai tam tikru metu gali turėti fondo vienetų arba bet kurių šiame dokumente paminėtų bendrovių akcijų bei gali įgalinti kitus asmenis ar jiems gali būti patikėta pirkti ar parduoti šias akcijas.

OMX Baltic Benchmark Fund yra investicinė kintamojo kapitalo bendrovė, kurios veiklą sankcionuoja ir reguliuoja Lietuvos Respublikos Centrinis Bankas. Šis dokumentas leidžiamas tik informaciniais tikslais ir nėra suformuluotas kaip pasiūlymas, rekomendacija ar kvietimas pirkti (parduoti) Fondo akcijas.

Rekomenduojama peržvelgti Fondo prospektą ir įstatus prieš priimančią investicinių sprendimą investuoti į Fondą.

2016 m. kovo mėn.

<http://www.orion.lt> • A. Tumėno g. 4B, Vilnius, Lietuva • Orion Asset Management

Investavimo į OMX Baltic Benchmark Fund privalumai

Likvidumas	Investuotojai bet kuriuo metu gali parduoti fondo vienetus valdymo įmonei. Už išperkamas akcijas sumokama vėliausiai per 7 darbo dienas, tačiau dažniausiai tą pačią dieną. Fondo akcijų listingavimas NASDAQ OMX Vilnius reguliuojamoje rinkoje suteikia galimybę parduoti ir įsigyti akcijas iš karto ir dažnai palankesne kaina.
Saugumas	Fondo veiklą reguliuoja Lietuvos Respublikos Vertybinių popierių komisija ir Lietuvos įstatymai. Fondo akcijos saugomos AB SEB bankas, didžiausiame komerciniame banke Lietuvoje. Audita atlieka KPMG. Fondas yra suderinamas su UCITS III standartu.
Diversifikacija	Fondo aktyvai yra investuojami į daugiau nei 30 bendrovių iš skirtingų ekonominių sektorių. Tikėtina, kad investicinis fondas, kurio portfelį sudaro daug skirtingų akcijų, bus ne toks volatilis kaip mažiau diversifikuotas akcijų portfelis, sudarytas iš mažesnio akcijų skaičiaus.
Patogumas	Suteikiama patogi galimybė uždirbti iš daugelio akcijų ilgalaikio augimo potencialo naudojant vieną nebrangų instrumentą. Investuotojui nereikia kiekvieną dieną sekti rinkos ir priimti pirkimo ir pardavimo sprendimų. Fondo investicinio vieneto kaina kiekvieną dieną pateikiama Fondo interneto svetainėje. Dividendai, kuriuos išmoka fondo portfelje esančios bendrovės yra automatiškai reinvestuojami į Fondą, taigi investuotojui nereikia sekti, kada bendrovė moka dividendus, tam, kad laiku juos reinvestuotų.
Efektyvumas	Fonde nėra darbuotojų. Fondą valdo valdymo įmonė, kuriai Fondas per metus moka tik 1% vidutinės grynujų aktyvų vertės. Investavimas yra pasyvus sekant OMX Baltic Benchmark GI indeksą. Portfelio sudėties peržiūra vyksta tik kas pusmetį, todėl komisiniai mokesčiai už prekybą akcijomis yra labai nedideli.
Istorija	Pirmasis investicinis fondas Lietuvoje.
Rezultatai	Vieni geriausių investicinio fondo rezultatų Baltijos šalyse 2012 m.

Išsami portfelio sudėtis (% nuo Fondo GAV)

AS Tallink Grupp	29,68	Grigeo Grigiškės	2,32	INVL Technology	0,67
Olympic Entertainment Group	8,60	AB Klaipėdos nafta	2,31	Vilkyškių pieninė	0,64
Tallinna Kaubamaja	7,48	Harju Elekter	2,03	Valmieras stikla šķiedra	0,39
Tallina Vesi	6,42	Grindeks	1,69	SAF Technika	0,32
AB Šiaulių bankas	4,97	Latvijas kuģniecība	1,50		
AB TEO LT	4,81	AB Pieno žvaigždės	1,48		
Pro Kapital Grupp, AS (PKG)	3,98	AB Žemaitijos pienas	1,19		
AB Apranga	3,71	AS Premia Foods AS	1,13		
Merko Ehitus	3,48	AB Rokiškio sūris	1,10		
Olainfarm	2,67	Grynieji pinigai	1,02		
Silvano Fashion Group	2,53	Baltika	0,76		
AB Linas Agro Group	2,37	Latvijas Gāze	0,75		

Alternatyvūs investavimo į Baltijos rinkas būdai

	Valiuta	Fondo aktyvai (mln. EUR)	Valdymo mokesčiai, %	Įsteigimo data	Grąža, %					Stand. nuokrypis (12m), %	Sharpe	Interneto svetainė
					1 mėn.	3 mėn.	6 mėn.	1 metai	YTD			
East Capital Baltic Fund	SEK	51,33	2,5	1998.06.30	4,1	2,5	2,5	-3,9	2,5	7,30	0,30	www.eastcapital.com
Danske Invest Baltic Equity	EUR	10,80	2,4	1998.04.01	3,8	2,9	4,3	0,0	2,9	9,71	0,24	www.danskeinvest.fi/en
Finasta Baltic Fund	EUR	1,92	2,0	2005.12.15	3,4	3,9	5,7	2,3	3,9	6,53	0,05	www.finasta.com
OMX Baltic Benchmark Fund	EUR	2,02	1,0	2001.04.09	6,0	8,4	6,4	4,7	6,0	9,32	0,48	am.orion.lt

Šaltiniai: Bloomberg, East Capital, Danske Capital, Prudentis Investment Management

Kodėl Baltijos regionas?

Daugiau informacijos apie Baltijos valstybių ekonomikas:

<http://www.investinbaltics.com>
<http://www.businesslithuania.com>
<http://www.liaa.lv>
<http://www.investinestonia.com>
<http://www.nasdaqomxbaltic.com/files/baltic/invest/nomxb/start.html>

Pagrindiniai Baltijos šalių rodikliai

	Lietuva	Latvija	Estija
Metinis BVP augimas, % (2015 Q4)	1,9	2,7	0,7
Harmonizuoto VKI pokytis, % (12 mėn)	-0,3	0,2	0,2
Biudžeto balansas, % nuo BVP (2014)	-0,7	-1,4	0,6
Valstybės skola, % nuo BVP (2014)	40,9	40	10,6
Nedarbo lygis, % (2015 Q4)	8,8	9,8	6,4
BVP vienam gyventojui, PGS (2014)	74	64	73

Šaltiniai: Eurostat, Lietuvos statistikos departamentas, Latvijos statistika, Eesti statistika.

Baltijos akcijų rinkos duomenys

	2002	2003	2004	2005	2006	2007	2008	2009	2010	2011	2012	2013	2014	2015
Rinkos kapitalizacija (mln. EUR)	4.417,0	6.671,8	10.587,2	12.081,3	14.340,8	13.095,7	5.177,5	6.386,1	6.846,0	5.206,0	5.602,6	5.731,2	5.853,7	6.552,3
Rinkos apyvarta (mln. EUR)	567,0	783,0	1.065,0	2.603,1	2.460,1	2.385,7	978,4	495,0	487,9	400,6	282,0	301,5	223,7	268,1
Vidutinė mėnesio apyvarta (mln. EUR)	47,3	65,3	88,8	216,9	205,0	198,8	81,5	41,3	40,7	33,4	23,5	25,1	18,6	22,3
Bendrovių skaičius	128	114	95	104	98	99	94	90	87	83	81	80	79	75
IPO skaičius	0	0	1	3	3	3	1	0	2	0	1	0	0	0
Vidutinė bendrovės kapitalizacija (mln. EUR)	34,5	58,5	111,4	116,2	146,3	132,3	55,1	71,0	78,7	62,7	69,2	71,6	74,1	87,4
Rinkos kapitalizacija (% nuo BVP)	13,5%	19,0%	27,1%	26,8%	26,9%	20,1%	7,3%	10,8%	11,4%	9,2%	7,80%	7,50%	7,33%	7,99%
Rinkos apyvarta (% nuo kapitalizacijos)	12,8%	11,7%	10,1%	21,5%	17,2%	18,2%	18,9%	7,8%	7,1%	7,7%	5,03%	5,26%	3,82%	4,09%

Šaltiniai: NASDAQ OMX, Eurostat, Latvijos statistika, Eesti statistika.

Svarbi informacija

OMX Baltic Benchmark Fund (Fondas) gali neatitikti visų investuotojų poreikių. Orion Asset Management (valdymo įmonė) neatsako už Fondo kainos pokyčius, priklausančius nuo rinkos. Fondo praeities rezultatai negarantuoja ar jokių kitu būdu neveikia ateities rezultatų. Taip pat valdymo įmonė ir (arba) susijusios bendrovės ir (arba) jų darbuotojai tam tikru metu gali turėti fondo vienetų arba bet kurių šiame dokumente paminėtų bendrovių akcijų bei gali įgalioti kitus asmenis ar jiems gali būti patikėta pirkti ar parduoti šias akcijas.

OMX Baltic Benchmark Fund yra investicinė kintamojo kapitalo bendrovė, kurios veiklą sankcionuoja ir reguliuoja Lietuvos Respublikos Centrinis Bankas. Šis dokumentas leidžiamas tik informaciniais tikslais ir nėra suformuluotas kaip pasiūlymas, rekomendacija ar kvietimas pirkti (parduoti) Fondo akcijas.

Rekomenduojama peržvelgti Fondo prospektą ir įstatus prieš priimančią investicinį sprendimą investuoti į Fondą.

2016 m. kovo mėn.

<http://www.orion.lt> • A. Tumėno g. 4B, Vilnius, Lietuva • Orion Asset Management