

NOVUS BALANCED PORTFOLIO | 2020 Rugpjūtis



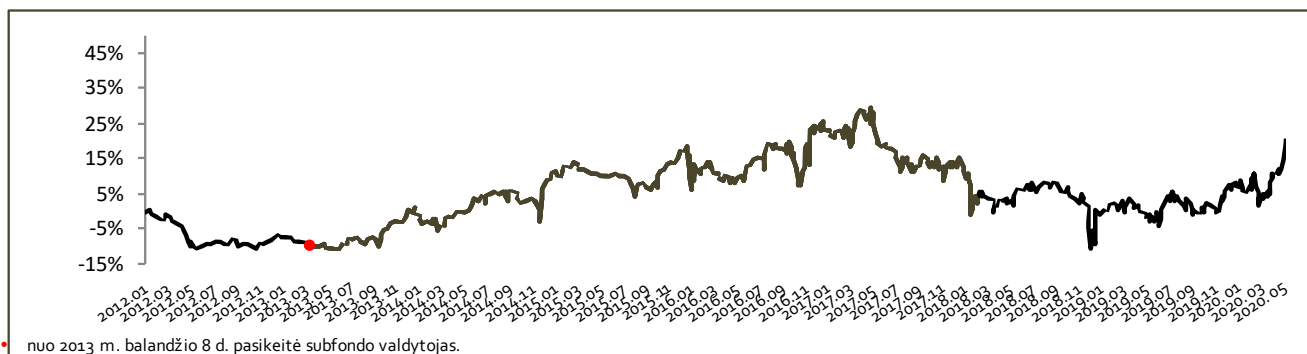
Subfondo rezultatų apžvalga

Paskutinis vasaros mėnuo finansų rinkoms buvo palankus ir daugelis turto klasių fiksavo teigiamus kainų pokyčius. Kai kurių aktyvų kainų augimą jau galima vertinti kaip kainų „burbulą“. Pavyzdžiui technologijų sektoriaus bendrovių akcijos auga vedamos didelių naujų investicijų iš rinkos dalyvių šturmuoja naujas aukštumas ir kai kurių bendrovių akcijų kainos jau pasiekė lygius kuriuos sunku pagrįsti bet kokiais skaičiavimo metodais. Tai leidžia daryti prielaidą, kad rugsėjo mėnesį galime sulaukti kainų korekcijos žemyn.

Vertinant ilgesnę perspektyvą, situacija išlieka palanki kainų augimui, nes ekonomikos skatinimo programos veikia pilnu pajėgumu, o baimės dėl antros viruso plėtos bangos mažėja, nes susirgimų duomenys rodo ženkliai sumažėjusį mirtingumą. Tai reiškia, kad bus išlaikomos tik būtinosios saugumo priemonės, neribojant žmonių judėjimo ir neuždarant verslų.

Pasaulio Centriniai bankai prognozuoja, kad žemos palūkanos išliks dar keletą metų. Tai rodo, kad viruso plitimo pasekoje panaudotos ekonomikos skatinimo priemonės lėmė dirbtinį ekonomikos ciklo pratęsimą ir kas vėliau gali lemti ekonomikos augimo pagreitėjimą ir ženklų infliacijos žiūri

Pagrindiniai rodikliai



Istorinė grąža

	Sau	Vas	Kov	Bal	Geg	Bir	Lie	Rugpj	Rugs	Spa	Lap	Gruo
2013	0,62%	-1,23%	-1,43%	0,37%	-1,12%	0,97%	1,13%	-0,27%	0,07%	3,76%	1,84%	2,87%
2014	-3,57%	1,23%	-0,02%	1,33%	1,45%	2,40%	2,22%	0,24%	-0,37%	-1,99%	-0,16%	5,99%
2015	1,00%	2,74%	-0,46%	-1,92%	0,02%	-0,05%	-0,76%	-1,28%	-1,89%	5,58%	2,14%	2,65%
2016	-3,38%	0,07%	-2,70%	-0,98%	0,56%	3,89%	1,46%	2,75%	-0,94%	-7,30%	12,49%	-0,01%
2017	-0,27%	-0,24%	1,71%	2,31%	-5,53%	-2,56%	-3,81%	1,03%	1,56%	-0,79%	-2,77%	1,43%
2018	-2,27%	-6,45%	0,32%	-0,59%	1,10%	3,10%	-0,77%	1,59%	-0,04%	-1,87%	0,25%	-8,98%
2019	6,21%	1,25%	0,68%	-0,57%	-3,76%	3,63%	4,98%	-2,95%	-1,08%	2,79%	-2,21%	7,60%
2020	1,12%	-1,50%	-3,31%	7,23%	8,99%	1,94%	-2,89%	0,81%				

Grynoji investicijų pozicija (Net Exposure)

	Sau	Vas	Kov	Bal	Geg	Bir	Lie	Rugpj	Rugs	Spa	Lap	Gruo
2013	35%	59%	88%	51%	31%	45%	83%	49%	84%	46%	58%	38%
2014	49%	46%	78%	87%	17%	74%	11%	67%	6%	7%	15%	18%
2015	11%	8%	15%	21%	20%	18%	21%	32%	31%	13%	26%	9%
2016	25%	27%	9%	28%	25%	39%	77%	36%	73%	78%	46%	48%
2017	28%	38%	88%	42%	44%	31%	69%	40%	52%	59%	93%	94%
2018	64%	44%	28%	21%	81%	21%	22%	24%	51%	54%	60%	47%
2019	26%	30%	53%	75%	76%	73%	69%	82%	86%	57%	76%	84%
2020	82%	80%	16%	99%	87%	80%	96%	40%				

Struktūra pagal turto klases

Akcijos	23,60%
Obligacijos	8,50%
Išvestinės finansinės priemonės	7,94%
Indėliai	0,00%
Depozitai	0,00%
Piniginės lėšos	59,96%
** Valiutinė rizika gali būti apdrausta	100,00%

Rodikliai

Pelningų mėnesių procentas*	55,43%
Metinis kintamumas (Volatility)*	13,39%
Sharpe'o rodiklis*	1,68
Koreliacija su MSCI World (EUR)*	0,45
Didžiausias kritimas*	-30,96%

* nuo valdytojo pasikeitimo momento 2013 m. balandžio 8 d.

Informacija apie subfondą

Subfondo dydis (EUR)	1 620 925
Subfondo valdymo įmonė	UAB "Novus Asset Management"
Subfondo valdytojas	Leonardas Diržys
Minimali investicijų suma (EUR)	10 000

Grąža

1 metų grąža	19,05%
2 metų grąža	12,23%
3 metų grąža	6,19%
Vidutinė metinė grąža*	4,04%
Fondo grąža	20,43%
Fondo grąža*	34,08%

* nuo valdytojo pasikeitimo momento 2013 m. balandžio 8 d.

1 mėn. grąža ir rizika

	DK***	Grąža
Novus Balanced Portfolio	-3,04%	0,81%
MSCI World (EUR)	-4,31%	5,33%
MSCI Emerging Markets (EUR)	-3,70%	0,94%
S&P 500 (EUR)	-5,10%	5,46%
HFRX Global Hedge Fund Index (EUR)	-1,59%	0,02%

*** Didžiausias kritimas mėnesio bėgyje

Novus Asset Management yra investicijų valdymo bendrovė (toliau – „Bendrovė“) kurią prižiūri Lietuvos Bankas. Šioje apžvalgoje yra pateikiama informacinio pobūdžio informacija ir ji negali būti vertinama kaip rekomendacija, nurodymas ar kvietimas pirkti ar parduoti įvardytas ar kitas finansines priemones taip pat negali būti jokio vėliau sudaryto sandorio pagrindas ar šalis.

Investavimas į finansines priemones yra susijęs su rizika. Bendrovė įspėja ir negarantuoja, kad apžvalgoje pateikiami praeities rezultatai bus tokie patys. Investicijų vertė priklausomai nuo rinkos sąlygų gali tiek kilti tiek kristi. Tam tikrais atvejais Jūsų investicijų vertė gali būti mažesnė negu Jūs investavote.

Pagrindiniai terminai

Didžiausias kritimas (angl. Maximum Drawdown). Investicinio vieneto vertės sumažėjimas per tam tikrą laikotarpį nuo aukščiausio iki žemiausio taško. Dažniausiai maksimalus kritimas nuo piko yra išreiškiamas procentais.

Metinis kintamumas (angl. Annual volatility). Tai statistinis rodiklis, rodantis, kaip per metus svyravo subfondo pelningumas, lyginant su vidutiniu pelningumu. Kuo aukštesnis rodiklis, tuo didesnė investicijų vertės svyravimo rizika.

Šarpo rodiklis (angl. Sharpe ratio). Skaičiuojamas kaip portfelio grąžos ir nerizikingo aktyvo grąžos skirtumas, padalintas iš portfelio grąžos standartinio nuokrypio. Rodiklis parodo papildomos grąžos ir rizikos santykį, taigi kuo jis didesnis, tuo portfelis patrauklesnis.

Koreliacijos koeficientas parodo kaip subfondo grąža yra priklausoma nuo MSCI World akcijų indekso grąžos. Koreliacija matuojama nuo 1 iki -1. Jei koreliacijos koeficientas yra 1, tai reiškia, kad MSCI World indeksui pakilus ar nukritus subfondo rezultatas bus identiškas. Kuo mažesnis koreliacijos koeficientas tuo mažiau subfondo grąža yra priklausoma nuo pasirinkto indekso.

UAB Novus Asset Management | Tilto g. 35/4, LT-01101 Vilnius | Tel. +370 620 71922, +370 612 62912 | info@novusam.lt | www.novusam.lt