

NOVUS BALANCED PORTFOLIO | 2020 Lapkritis

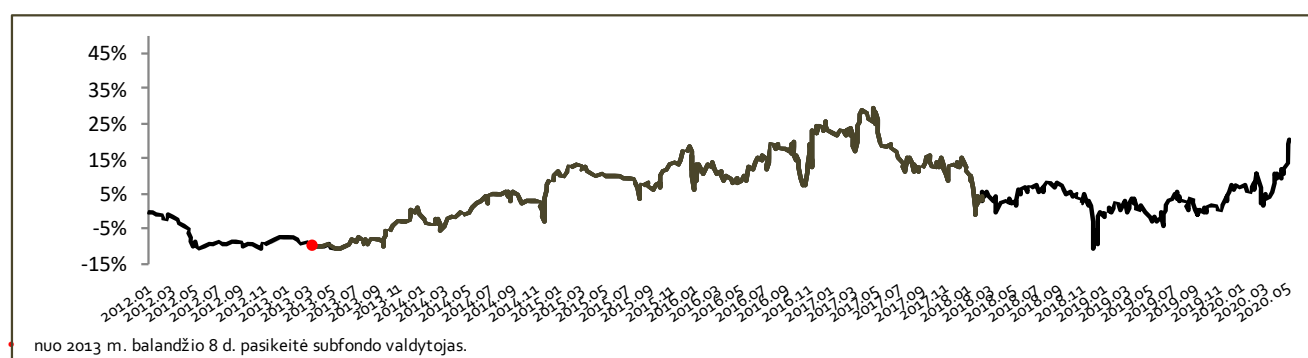


Subfondo rezultatų apžvalga

Pasaulį išgelbės vakcina nuo COVID. Būtent su tokiu šūksniu finansų rinkos gyveno lapkričio mėnesį. Nors už lango karantinas ir įvedami vis nauji ribojimai, tačiau rinkos dalyviai horizonte jau mato pavasario masinę vakcinaciją ir kartu skuba pirkti ženkliai nuvertintų sektorių akcijas. Kelionių, naftos ir žaliavų sektoriai fiksavo didžiausius teigiamus pokyčius. Lapkričio mėnesį Fondas fiksavo gana ženklių teigiamą pokytį. Fondo struktūra mėnesio bėgyje buvo keičiama ir buvo perkamos būtent didžiausią augimo potencialą turinčių sektorių bendrovės, kartu mažinant technologijų sektoriaus bendrovių investicijas.

Nors atrodo rizikų išlieka labai daug, tačiau išliekant skatinimo programoms ir esant milžiniškam pinigų kiekiui rinkose ir toliau stebime nepailstantį investuotojų apetitą rizikingoms investicijoms. Panašu, kad tokia aplinka išliks ir toliau ir vis rinkų pakitimai pritrauks vis naujus pinigų srautus. Rinkos gyvena lūkesčiais ir tai tikėtina lems, kad didesnis kainų kritimas bus tik tada kai bus aišku, kad pandemija įveikta ir visi lūkesčiai jau bus įsakaičiuoti į kainas.

Pagrindiniai rodikliai



Istorinė grąža

	Sau	Vas	Kov	Bal	Geg	Bir	Lie	Rugp	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%	-3,34%	0,81%	2,66%	

Grynoji investicijų pozicija (Net Exposure)

	Sau	Vas	Kov	Bal	Geg	Bir	Lie	Rugp	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%	91%	45%	86%	

Struktūra pagal turto klases

Akcijos	85,63%
Obligacijos	0,00%
Išvestinės finansinės priemonės	0,46%
Indėliai	0,00%
Depozitai	0,00%
Piniginės lėšos	13,90%
** Valiutinė rizika gali būti apdrausta	100,00%

Rodikliai

Pelningų mėnesių procentas*	55,79%
Metinis kintamumas (Volatility)*	13,29%
Sharpe'o rodiklis*	1,77
Koreliacija su MSCI World (EUR)*	0,51
Didžiausias kritimas*	-30,96%

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

Informacija apie subfondą

Subfondo dydis (EUR)	1 536 872
Subfondo valdymo įmonė	UAB "Novus Asset Management"
Subfondo valdytojas	Leonardas Diržys
Minimali investicijų suma (EUR)	10 000

Grąža

1 metų grąža	20,92%
2 metų grąža	15,31%
3 metų grąža	8,44%
Vidutinė metinė grąža*	3,54%
Fondo grąža	20,48%
Fondo grąža*	34,14%

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

1 mėn. grąža ir rizika

	DK***	Grąža
Novus Balanced Portfolio	-4,25%	2,66%
MSCI World (EUR)	-5,28%	9,70%
MSCI Emerging Markets (EUR)	-6,15%	6,35%
S&P 500 (EUR)	-4,14%	8,73%
HFRX Global Hedge Fund Index (EUR)	-1,14%	1,11%

*** Didžiausias kritimas mėnesio bėgyje

NOVUS BALANCED PORTFOLIO | 2020 Lapkritis

Teisinės atsakomybės apribojimas

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 įvadytas 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.