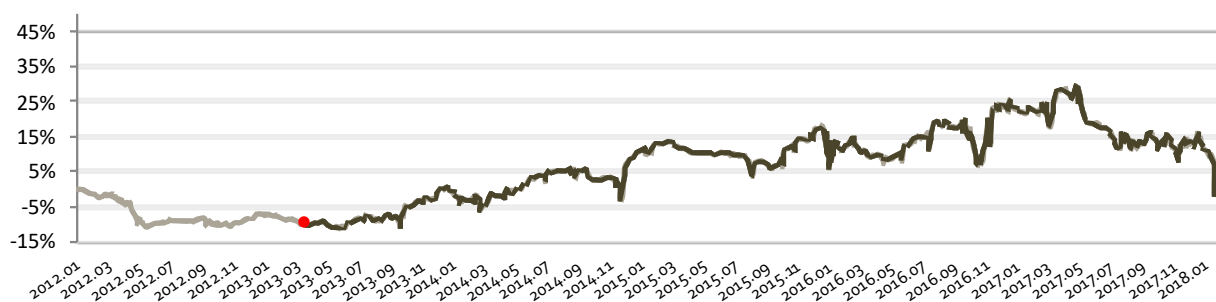


### Pagrindiniai rodikliai



• nuo 2013 m. balandžio 8 d. pasikeitė subfondo valdytojas.

### 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%	

### 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%	

### Struktūra pagal turto klases

Akcijos	66,16%
Obligacijos	9,22%
Išvestinės finansinės priemonės	-1,15%
Indėliai	0,00%
Depozitai	1,77%
Piniginės lėšos	24,00%
** Valiutinė rizika gali būti apdrausta	100,00%

### Rodikliai

Pelningų mėnesių procentas*	57,69%
Metinis kintamumas (Volatility)*	12,98%
Sharpe'o rodiklis*	0,80
Koreliacija su MSCI World (EUR)*	0,39
Didžiausias kritimas*	-30,96%

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

### Informacija apie subfondą

Subfondo dydis (EUR)	1 635 546
Subfondo valdymo įmonė	UAB "Novus Asset Management"
Subfondo valdytojas	Leonardas Diržys
Minimali investicijų suma (EUR)	10 000
Galimybė nirkti/įnarkuoti subfondą	Kiekviena darbo diena

### Grąža

1 metų grąža	-4,64%
2 metų grąža	-10,32%
3 metų grąža	-18,96%
Vidutinė metinė grąža *	1,94%
Fondo grąža	-0,36%
Fondo grąža*	10,93%

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

### 1 mėn. grąža ir rizika

	DK***	Grąža
Novus Balanced Portfolio	-2,80%	-2,21%
MSCI World (EUR)	-0,76%	3,84%
MSCI Emerging Markets (EUR)	-2,98%	1,00%
S&P 500 (EUR)	-1,17%	4,35%
HFRX Global Hedge Fund Index (EUR)	-0,76%	2,02%

\*\*\* Didžiausias kritimas mėnesio bėgyje

## NOVUS BALANCED PORTFOLIO | 2019 Lapkritis



## Novus Balanced Portfolio subfondo struktūra

Pavadinimas	Šalis	Sektorius	Valiuta	% nuo portfelio
<b>Akcijos:</b>				
NOVATURAS PVA	LTU	Vartojimo prekės/paslaugos	EUR	2,21%
PHILIP MORRIS INTL INC CMN	JAV	Vartojimo prekės/paslaugos	USD	9,65%
VMWARE INC	JAV	Technologijos	USD	8,84%
L BRANDS INC	JAV			3,71%
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	JAV			9,41%
SHOPIFY INC	JAV			8,40%
APPLE INC	JAV			6,66%
				<b>48,88%</b>
<b>Obligacijos:</b>				
LUKOIL 6.125% 09.11.2020 USD	Rusija	Nafta ir dujos	USD	9,22%
				<b>9,22%</b>
<b>Investiciniai fondai:</b>				
BALTIC HORIZON FUND	Baltijos šalys	NT	EUR	4,06%
DIREXION DLY SMALL CAP BULL 3X	JAV	Fondas	USD	7,40%
PROSHARES ULTRAPRO SHORT S&P 500	JAV	Fondas	USD	5,82%
				<b>17,27%</b>
<b>Indėliai:</b>				
				0,00%
				<b>0,00%</b>
<b>Depozitai:</b>				
Užstatinis depozitas pagal FUTURE sandorį 2019 12 18			EUR	1,77%
				<b>1,77%</b>
<b>Išvestinės finansinės priemonės:</b>				
Išankstinis valiutos keitimo sandoris (EUR/USD 2019 12 18)			EUR	-1,15%
				<b>-1,15%</b>
<b>Piniginės lėšos:</b>				
Piniginės lėšos sąskaitoje			EUR	0,74%
Piniginės lėšos sąskaitoje			USD	23,26%
				<b>24,00%</b>
<b>Bendrai:</b>				<b>100,00%</b>

\* Angliškai - Forward, future, options

## Teisinės atsakomybės apribojimas

Novus Asset Management yra investicijų valdymo bendrovė (toliau – „Bendrovė“) kurią prižiūri Lietuvos Bankas. Šioje apžvalgoje yra pateikiama informacinė pobūdžio informacija ir ji negali būti vertinama kaip rekomendacija, nurodymas ar kvietimas pirkti ar parduoti įvairius 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.

## NOVUS BALANCED PORTFOLIO | 2019 Lapkritis



## Teisinės atsakomybės apribojimas

---

Novus Asset Management yra investicijų valdymo bendrovė (toliau – „Bendrovė“) kurią prižiūri Lietuvos Bankas. Šioje apžvalgoje yra pateikiama informacinė 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.





