

**Investicinės kintamojo kapitalo bendrovės  
„OMX Baltic Benchmark Fund“**

**2017 METŲ I PUSMEČIO  
ATASKAITA**

Vilnius, 2017

# 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 (šiuo metu funkcijas perėmė Lietuvos bankas) pritarimo kolektyvinio investavimo subjekto sudarymo dokumentams data	2000 m. rugsėjo 14 d.

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.**

2017 m. sausio 1 d. – 2017 m. 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) 231-38-33,
Faksas:	(8-5) 231-38-40.
Elektroninio pašto adresas:	<a href="mailto:oam@orion.lt">oam@orion.lt</a>
Interneto svetainės adresas:	<a href="http://www.am.orion.lt">www.am.orion.lt</a>

### **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 “Orion Asset Management”.  
Asmenys, priimančys investicinius sprendimus:  
UAB “Orion Asset Management“ fondo valdytojas Donatas Frejus.

## **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. GRYNŲJŲ AKTYVŲ, VIENETŲ SKAIČIUS IR VERTĖ

### 5. Nurodyti grynujų aktyvų, vienetų skaičių ir vertę:

	Ataskaitinio laikotarpio pradžioje (2017 01 01)	Ataskaitinio laikotarpio pabaigoje (2017 06 30)	Prieš metus (2016 06 30)	Prieš dvejus metus (2015 06 30)
Grynujų aktyvų vertė, EUR	2 225 578	2 414 566	2 025 631	2 032 509
Vieneto vertė, EUR	9,2588	10,0795	8,4877	7,6635
Vienetų ,esančių apyvartoje, skaičius	240 375	239 553	238 656	265 218

### 6. Nurodyti per ataskaitinį laikotarpį parduotų ir išpirktų vienetų skaičių bei vertę:

	Vienetų skaičius	Vertė, Eur.
Išplatinta (konvertuojant pinigines lėšas į vienetus)	6 091	58 264
Išpirkta (konvertuojant vienetus į pinigines lėšas)	( 6 913 )	( 68 148 )

### 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 49.6 punkte.

Atskaitymai	Atskaitymų dydis	Per ataskaitinį laikotarpį priskaičiuotų atskaitymų suma (Eur.)	Procentinė dalis nuo ataskaitinio laikotarpio vidutinės grynujų aktyvų vertės
	maksimalus, nustatytas sudarymo dokumentuose		
<b>Už valdymą:</b>		11 782	0,50
Nekintamas mokestis	1% Fondo grynujų aktyvų vidutinės metinės vertės.	11 782	0,50
Sėkmės mokestis	-----	-	-
<b>Depozitoriumui:</b>	0,3% Fondo grynujų aktyvų vidutinės metinės vertės	1 495	0,06
mokestis nuo aktyvų	0,12 % Fondo grynujų aktyvų vidutinės metinės vertės.	1 414	0,06
už sandorių sudarymą	Fiksuotas mokestis už operaciją 2,90 EUR	81	0,00
<b>Už sandorių sudarymą:</b>		196	0,01
<b>Už auditą:</b>	Atlyginimas auditoriui už audito paslaugas negali būti didesnis už 8688,60 EUR	1 829	0,08
<b>Kitos veiklos išlaidos (nurodyti išlaidų rūšis)</b>	-----	9 443	0,41
VP kotiravimo sąnaudos	-----	304	0,01
Nasdaq OMX licencijos mokestis	-----	1 544	0,07
Apskaitos paslaugos	-----	6 897	0,30
Kiti mokesčiai	-----	698	0,03
<b>Išlaidų, įskaičiuojamų į BIK, suma</b>	-----	<b>24 549</b>	<b>1,05</b>
<b>BIK % nuo GAV*</b>	-----		<b>1,05 %</b>
<b>Visų išlaidų suma</b>	išlaidų dydis negali būti didesnis kaip 3% Bendrovės grynujų aktyvų vidutinės metinės vertės	<b>24 745</b>	<b>1,06</b>
<b>PAR (praėjusio analogiško ataskaitinio laikotarpio PAR)*</b>	-----	-	

**\*Rodiklių paaiškinimai:**

**Bendrasis išlaidų koeficientas (BIK)** – procentinis dydis, kuris parodo, kokia vidutinė subjekto grynujų 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“ 196 EUR 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 grynujų 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 (eurais) nuo kolektyvinio investavimo subjekto dalyvio įmokų, esant dabartiniams atskaitymų lygiui ir kokią sumą jis gautų po 1,3,5,10 metų, jei būtų investuota 3 000 EUR., o metinė investicijų grąža – 5 proc.**

(Pateikiama tik su metine ataskaita)

## IV. INFORACIJA 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 (internetu svetainės adresas)	Balsų dalis emitente %	Dalis GA, %
Nuosavybės vertybiniai popieriai, įtraukti į Oficialųjį ar jį atitinkantį prekybos sąrašą:									
Tallinna Kaubamaja	EE	EE000001105	23 004	9 202	149 312	211 637	<a href="http://www.nasdaqomxbaltic.com">www.nasdaqomxbaltic.com</a>	0,0565	8,77
AS Silvano Fashion Group	EE	EE3100001751	34 075	10 223	99 107	95 069	<a href="http://www.nasdaqomxbaltic.com">www.nasdaqomxbaltic.com</a>	0,0921	3,94
AS Baltika	EE	EE3100003609	56 510	11 302	35 381	16 218	<a href="http://www.nasdaqomxbaltic.com">www.nasdaqomxbaltic.com</a>	0,1385	0,67
Harju Elekter	EE	EE3100004250	18 466	-	57 695	76 634	<a href="http://www.nasdaqomxbaltic.com">www.nasdaqomxbaltic.com</a>	0,1041	3,17
AS Tallink Group	EE	EE3100004466	435 692	261 415	351 979	396 480	<a href="http://www.nasdaqomxbaltic.com">www.nasdaqomxbaltic.com</a>	0,0650	16,42
Pro Kapital Grupp, AS (PKG)	EE	EE3100006040	32 678	6 536	68 043	68 624	<a href="http://www.nasdaqomxbaltic.com">www.nasdaqomxbaltic.com</a>	0,0602	2,84
Tallina Vesi	EE	EE3100026436	10 156	6 016	100 914	126 950	<a href="http://www.nasdaqomxbaltic.com">www.nasdaqomxbaltic.com</a>	0,0508	5,26
Nordecon	EE	EE3100039496	19 446	-	23 826	24 502	<a href="http://www.nasdaqomxbaltic.com">www.nasdaqomxbaltic.com</a>	0,0601	1,01
LHV Group	EE	EE3100073644	24 298	24 298	186 399	242 980	<a href="http://www.nasdaqomxbaltic.com">www.nasdaqomxbaltic.com</a>	0,0958	10,06
Olympic Entertainment Group	EE	EE3100084021	92 736	-	146 237	160 433	<a href="http://www.nasdaqomxbaltic.com">www.nasdaqomxbaltic.com</a>	0,0611	6,64
Merko Ehitus	EE	EE3100098328	8 322	-	76 921	76 562	<a href="http://www.nasdaqomxbaltic.com">www.nasdaqomxbaltic.com</a>	0,0470	3,17
AS Premia Foods AS	EE	EE3100101031	64 560	12 912	53 695	25 178	<a href="http://www.nasdaqomxbaltic.com">www.nasdaqomxbaltic.com</a>	0,1669	1,04
AB Rokiškio sūris	LT	LT0000100372	17 419	5 052	20 692	41 631	<a href="http://www.nasdaqomxbaltic.com">www.nasdaqomxbaltic.com</a>	0,0540	1,72
Grigeo Grigiškės	LT	LT0000102030	48 484	14 060	30 621	54 787	<a href="http://www.nasdaqomxbaltic.com">www.nasdaqomxbaltic.com</a>	0,0738	2,27
AB Šiaulių bankas	LT	LT0000102253	426 458	123 673	110 756	209 817	<a href="http://www.nasdaqomxbaltic.com">www.nasdaqomxbaltic.com</a>	0,1130	8,69
AB Apranga	LT	LT0000102337	30 312	8 790	48 489	77 296	<a href="http://www.nasdaqomxbaltic.com">www.nasdaqomxbaltic.com</a>	0,0548	3,2
AB Klaipėdos nafta	LT	LT0000111650	114 568	33 225	49 459	52 587	<a href="http://www.nasdaqomxbaltic.com">www.nasdaqomxbaltic.com</a>	0,0301	2,18
AB Pieno žvaigždės	LT	LT0000111676	25 943	7 523	46 769	36 839	<a href="http://www.nasdaqomxbaltic.com">www.nasdaqomxbaltic.com</a>	0,0575	1,53
AB Telia Lietuva	LT	LT0000123911	118 601	34 394	87 325	105 911	<a href="http://www.nasdaqomxbaltic.com">www.nasdaqomxbaltic.com</a>	0,0204	4,39
AB Linas Agro Group	LT	LT0000128092	69 057	200 027	35 531	45 578	<a href="http://www.nasdaqomxbaltic.com">www.nasdaqomxbaltic.com</a>	0,0434	1,89
Olainfarm	LV	LV0000100501	7 114	9 960	35 779	77 543	<a href="http://www.nasdaqomxbaltic.com">www.nasdaqomxbaltic.com</a>	0,0505	3,21
Grindeks	LV	LV0000100659	4 346	6 084	36 037	33 030	<a href="http://www.nasdaqomxbaltic.com">www.nasdaqomxbaltic.com</a>	0,0453	1,37
Latvijas kuģniecība	LV	LV0000101103	69 331	20 799	34 098	49 710	<a href="http://www.nasdaqomxbaltic.com">www.nasdaqomxbaltic.com</a>	0,0347	2,06
SAF Technika	LV	LV0000101129	1 737	2 432	7 052	8 424	<a href="http://www.nasdaqomxbaltic.com">www.nasdaqomxbaltic.com</a>	0,0585	0,35
<b>Iš viso</b>	-	-	<b>1 753 313</b>		<b>1 892 117</b>	<b>2 314 420</b>		-	<b>95,85</b>
Nuosavybės vertybiniai popieriai, įtraukti į Papildomąjį ar jį atitinkantį prekybos sąrašą:									
AB Žemaitijos pienas	LT	LT0000121865	34 800	8 759	8 114	14 268	<a href="http://www.nasdaqomxbaltic.com">www.nasdaqomxbaltic.com</a>	0,0719	0,59
AB AUGA group	LT	LT0000127466	30 203	10 092	16 453	51 647	<a href="http://www.nasdaqomxbaltic.com">www.nasdaqomxbaltic.com</a>	0,0161	2,14
Valmieras stikla šķiedra	LV	LV0000100485	3 200	4 480	10 675	10 496	<a href="http://www.nasdaqomxbaltic.com">www.nasdaqomxbaltic.com</a>	0,0134	0,43
<b>Iš viso</b>	-	-	<b>68 203</b>	-	<b>35 242</b>	<b>76 411</b>		-	<b>3,16</b>
<b>Iš viso nuosavybės vertybinių popierių</b>	-	-	<b>1 821 516</b>		<b>1 927 359</b>	<b>2 390 831</b>		-	<b>99,01</b>



Banko pavadinimas	Šalis	Valiuta	Bendra rinkos vertė, EUR	Dalis GA, %
Pinigai:				
AB SEB bankas	LT	EUR	17 646	0,73
<b>Iš viso pinigų:</b>	-	-	<b>17 646</b>	<b>0,73</b>

Nekilnojamojo turto objekto pavadinimas	Šalis	Valiuta	Bendra įsigijimo vertė	Rinkos vertė	Dalis GA, %
Nekilnojamojo turto objektai					
-	-	-	-	-	-
<b>Iš viso nekilnojamojo turto objektų:</b>	-	-	-	-	-

Pavadinimas	Šalis	Trumpas apibūdinimas (aiškiai įvardyti)	Valiuta	Rinkos vertė	Paskirtis	Dalis GA, %
Kitos investicinės priemonės						
-	-	-	-	-	-	-
<b>Iš viso kitų investicinių priemonių:</b>	-	-	-	-	-	-

**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.**

Fondas investuoja į OMX Baltic Benchmark GI (toliau - Indeksas) akcijų indeksą sudarančias priemones. Indeksas yra skaičiuojamas Nasdaq, Inc. ir intelektinės nuosavybės teisės į Indeksą priklauso Nasdaq, 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 Vilnius, NASDAQ Tallinn ir NASDAQ 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 BALTIC tinklapyje <http://www.nasdaqbaltic.com/>

Susidariusi situacijai, kai yra būtina apsaugoti akcininkų interesus, Valdymo įmonės atskiru sprendimu, gali būti investuojama į kitus Fondo Turto valdymo sutartyje nurodytus instrumentus ir turtą.

Fondo investicinis portfelis privalo atitikti visus reikalavimus, numatytus LR Vertybinių popierių rinkos įstatyme, LR kolektyvinio investavimo subjektų įstatyme, priežiūros institucijos nutarimuose ir kituose galiojančiuose teisės aktuose. Į nuosavybės vertybinius popierius gali būti investuota iki 20 procentų Fondo grynujų aktyvų. Priežiūros institucijai sutikus, jei tai būtina dėl ypatingų sąlygų reguliuojamoje rinkoje dominuojant vienam emitentui, į jo akcijas gali būti investuojama iki 35 procentų grynujų aktyvų.

2013 m. gegužės 24 d. buvo gautas Lietuvos banko leidimas investuoti iki 35 proc. Fondo grynujų aktyvų vertės į vieną emitentą – AS Tallink Group.



**Žemiau pateikiame investicijų pasiskirstymą (didėjančia tvarka).**

<b>Investicijų pasiskirstymas</b>	<b>Rinkos vertė</b>	<b>Dalis aktyvuose (%)</b>	<b>Rinkos vertė ataskaitinio laikotarpio pradžioje</b>	<b>Dalis aktyvuose ataskaitinio laikotarpio pradžioje (%)</b>
AS Tallink Group	396 480	16,42	466 992	20,98
LHV Group	242 980	10,06	212 303	9,54
Tallinna Kaubamaja	211 637	8,77	174 920	7,86
AB Šiaulių bankas	209 817	8,69	152 652	6,86
Olympic Entertainment Group	160 433	6,64	149 940	6,74
AS Tallina Vesi	126 950	5,26	138 359	6,22
AB Telia Lietuva	105 911	4,39	109 069	4,90
Silvano Fashion Group	95 069	3,94	100 862	4,53
Olainfarm	77 543	3,21	57 996	2,61
AB Apranga	77 296	3,2	76 180	3,42
Harju Elekter	76 634	3,17	43 203	1,94
AS Merko Ehitus	76 562	3,17	67 350	3,03
Pro Kapital Grupp, AS (PKG)	68 624	2,84	64 049	2,88
Grigeo Grigiškės	54 787	2,27	54 787	2,46
AB Klaipėdos nafta	52 587	2,18	61 638	2,77
AB Žemaitijos pienas	51 647	2,14	32 317	1,45
Latvijas kuģniecība	49 710	2,06	32 586	1,46
AB Līnas Agro Group	45 578	1,89	44 058	1,98
AB Rokiškio sūris	41 631	1,72	21 982	0,99
AB Pieno žvaigždės	36 839	1,53	35 007	1,57
Grindeks	33 030	1,37	19 079	0,86
AS Premia Foods AS	25 178	1,04	23 693	1,06
AS Nordecon	24 502	1,01	19 950	0,90
AS Baltika	16 218	0,67	14 860	0,67
AB AUGA group	14 268	0,59	6 050	0,27
Valmieras stikla šķiedra	10 496	0,43	9 952	0,45
SAF Technika	8 424	0,35	6 097	0,27
Latvijas Gāze	-	-	3 222	0,14
AB Ūkio bankas	-	-	-	0,00

## 12.2. Pagal sektorius.

	Investicijų pasiskirstymas	Rinkos vertė	Dalis aktyvuose (%)	Rinkos vertė ataskaitinio laikotarpio pradžioje	Dalis aktyvuose ataskaitinio laikotarpio pradžioje (%)
1.	Nuosavybės vertybiniai popieriai	2 390 831	99,01	2 199 153	98,81
1.1.	Rezidentai	690 361	28,60	593 740	26,67
1.1.1.	Nefinansų įmonės	480 544	19,91	441 088	19,81
1.1.2.	Finansų įmonės	209 817	8,69	152 652	6,86
1.1.2.1.	Bankai	209 817	8,69	152 652	6,86
1.1.2.2.	Draudimo įmonės	-	-	-	-
1.1.2.3.	Kitos finansų įmonės	-	-	-	-
1.2.	Nerezidentai	1 700 470	70,41	1 605 413	72,14
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	17 646	0,73	35 338	1,59
7.1.	Rezidentai	17 646	0,73	35 338	1,59
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	-----	-----	-----	-----
<b>Iš viso:</b>		<b>2 408 477</b>	<b>99,74</b>	<b>2 234 491</b>	<b>100,40</b>

### 12.3. Pagal valiutas ir geografinę zoną.

Investicijų pasiskirstymas	Rinkos vertė	Dalis aktyvuose (%)	Rinkos vertė ataskaitinio laikotarpio pradžioje	Dalis aktyvuose ataskaitinio laikotarpio pradžioje (%)
<b>Pagal valiutas:</b>				
EUR	2 408 477	99,74	2 234 491	100,40
<b>Iš viso</b>	<b>2 408 477</b>	<b>99,74</b>	<b>2 234 491</b>	<b>100,40</b>
<b>Pagal geografinę zoną:</b>				
Lietuva	708 007	29,33	629 078	28,26
Latvija	179 203	7,42	128 932	5,79
Estija	1 521 267	62,99	1 476 481	66,35
<b>Iš viso</b>	<b>2 408 477</b>	<b>99,74</b>	<b>2 234 491</b>	<b>100,40</b>

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. Finansuojamojo kolektyvinio investavimo subjekto pagal sandorius dėl išvestinių finansinių priemonių priimtą rizikos apimtį atžvilgiu nurodyti:

16.1. finansuojančiojo kolektyvinio investavimo subjekto tiesioginės galimos rizikos apimtį ir faktinės finansuojamojo kolektyvinio investavimo subjekto išvestinių finansinių priemonių rizikos apimtį, proporcingos finansuojančiojo kolektyvinio investavimo subjekto investicijoms į finansuojamąjį subjektą, suma;

16.2. finansuojančiojo kolektyvinio investavimo subjekto tiesioginės galimos rizikos apimtį ir galimos didžiausios finansuojamojo kolektyvinio investavimo subjekto pagal sandorius dėl išvestinių finansinių priemonių priimtą rizikos apimtį, nustatytos finansuojamojo kolektyvinio investavimo subjekto steigimo dokumentuose ir proporcingos finansuojančiojo kolektyvinio investavimo subjekto investicijoms į finansuojamąjį subjektą, suma.

**17. 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, koku jie įeina į indeksą).

Fondas investuoja į OMX Baltic Benchmark GI (toliau - Indeksas) akcijų indeksą sudarančias priemones. Indeksas yra skaičiuojamas Nasdaq, Inc. ir intelektinės nuosavybės teisės į Indeksą priklauso Nasdaq, 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 Vilnius, NASDAQ Tallinn ir NASDAQ 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 BALTIC tinklapyje <http://www.nasdaqbaltic.com/>.

**18. 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 didžiausią svorį OMX Baltic Benchmark indekse turintys komponentai: Tallink Grupp, Šiaulių bankas, Tallinna Kaubamaja. Fondo lyginamajam rezultatui įtakos turėjo atlikti OMX Baltic Benchmark Index sudėties pokyčiai bei fondo vienetų išpirkimai ir įsigijimai.

## **V. KOLEKTYVINO INVESTAVIMO SUBJEKTO INVESTICIJŲ GRAŽA IR RIZIKOS RODIKLIAI**

(Pateikiama tik su metine ataskaita)

## VI. KOLEKTYVINIO INVESTAVIMO SUBJEKTO FINANSINĖ BŪKLĖ

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

23.1. Investicinio fondo atveju – grynujų aktyvų ataskaitą, investicinės bendrovės atveju – balansą;

### BALANSAS, EUR PAGAL 2017 m. birželio 30 d. DUOMENIS

Eil. Nr.	Straipsniai	Pastabos Nr.	Finansiniai metai	Praėję finansiniai metai
	<b>TURTAS</b>			
A.	<b>ILGALAIKIS TURTAS</b>		-	-
1.	NEMATERIALUSIS TURTAS		-	-
2.	MATERIALUSIS TURTAS		-	-
2.1.	Investicinis turtas		-	-
2.1.1	Žemė		-	-
2.1.2	Pastatai		-	-
2.2.	Kitas materialusis turtas		-	-
3.	FINANSINIS TURTAS		-	-
3.1.	Investicijos į įmonių grupės įmones		-	-
3.2.	Investicijos į asocijuotąsias įmones		-	-
3.3.	Kiti nuosavybės vertybiniai popieriai		-	-
3.4.	Ne nuosavybės vertybiniai popieriai		-	-
3.5.	Kitų kolektyvinio investavimo subjektų investiciniai vienetai, akcijos, įnašai		-	-
3.6.	Išvestinės finansinės priemonės		-	-
3.7.	Terminuotieji indėliai		-	-
3.8.	Paskolos ir gautinos sumos		-	-
3.8.1.	Paskolos įmonių grupės įmonėms		-	-
3.8.2.	Iš įmonių grupės įmonių gautinos sumos		-	-
3.8.3.	Paskolos asocijuotosioms įmonėms		-	-
3.8.4.	Iš asocijuotųjų įmonių gautinos sumos		-	-
3.8.5.	Kitos po vienu metų gautinos sumos		-	-
3.9.	Kitas ilgalaikis finansinis turtas		-	-
4.	KITAS ILGALAIKIS TURTAS		-	-
4.1.	Atidėtojo mokesčio turtas		-	-
4.2.	Kitas turtas		-	-
B.	<b>TRUMPALAIKIS TURTAS</b>		2 422 852	2 033 345
1.	ATSARGOS		1 304	1 364
1.1.	Sumokėti avansai		1 304	1 364
1.2.	Atsargos bendrovės reikmėms		-	-
2.	PER VIENUS METUS GAUTINOS SUMOS		13 071	48 519
2.1.	Iš investicijų pardavimo sandorių gautinos sumos		-	-
2.2.	Įmonių grupės įmonių skolos		-	-
2.3.	Asocijuotųjų įmonių skolos		-	-

2.4.	Kitos per vienus metus gautinos sumos		13 071	48 519
3.	TRUMPALAIKĖS INVESTICIJOS	3,4	2 390 831	1 937 749
3.1.	Terminuotieji indėliai		-	-
3.2.	Pinigų rinkos priemonės		-	-
3.3.	Perleidžiamieji vertybiniai popieriai	3,4	2 390 831	1 937 749
3.3.1.	Ne nuosavybės vertybiniai popieriai		-	-
3.3.2.	Įmonių grupės įmonių nuosavybės vertybiniai popieriai		-	-
3.3.3.	Kiti nuosavybės vertybiniai popieriai	3,4	2 390 831	1 937 749
3.3.4.	Kitų kolektyvinio investavimo subjektų investiciniai vienetai, akcijos, įnašai		-	-
3.4.	Išvestinės finansinės priemonės		-	-
4.	PINIGAI	3,4	17 646	45 713
C.	ATEINANČIŲ LAIKOTARPIŲ ŠAŪAUDOS IR SUKAUPTOS PAJAMOS			
	TURTO IŠ VISO	3,4	2 422 852	2 033 345
D.	NUOSAVAS KAPITALAS	1	2 414 566	2 025 631
1.	KAPITALAS		1 519 046	1 435 325
1.1.	Pasirašytasis kapitalas		1 519 046	1 435 325
1.2.	Pasirašytasis neapmokėtas kapitalas (-)		-	-
2.	AKCIJŲ PRIEDAI		-	-
3.	PERKAINOJIMO REZERVAS (REZULTATAI)		-	-
4.	REZERVAI		-	-
4.1.	Privalomasis		-	-
4.2.	Kiti rezervai		-	-
5.	NEPASKIRSTYTASIS PELNAS (NUOSTOLIAI)		895 520	590 306
5.1.	Ataskaitinių metų pelnas (nuostoliai)		198 872	158 624
5.2.	Ankstesnių metų pelnas (nuostoliai)		696 648	431 682
E.	ATIDĖJINIAI		-	-
1.	Pensijų ir panašių įsipareigojimų atidėjiniai		-	-
2.	Mokesčių atidėjiniai		-	-
3.	Kiti atidėjiniai		-	-
F.	MOKĖTINOS SUMOS IR KITI ĮSIPAREIGOJIMAI		8 286	7 714
1.	PO VIENŲ METŲ MOKĖTINOS SUMOS IR KITI ĮSIPAREIGOJIMAI		-	-
1.1.	Skoliniai įsipareigojimai		-	-
1.2.	Finansinės skolos kredito įstaigoms		-	-
1.3.	Gauti avansai		-	-
1.4.	Už finansinį ir investicinį turtą mokėtinos sumos		-	-
1.5.	Pagal vekselius ir čekius mokėtinos sumos		-	-
1.6.	Įmonių grupės įmonėms mokėtinos sumos		-	-
1.7.	Asocijuotosioms įmonėms mokėtinos sumos		-	-
1.8.	Įsipareigojimai pagal išvestinių finansinių priemonių sutartis		-	-
2.	PER VIENUS METUS MOKĖTINOS SUMOS IR KITI ĮSIPAREIGOJIMAI		8 286	7 714
2.1.	Skoliniai įsipareigojimai		-	-
2.2.	Finansinės skolos kredito įstaigoms		-	-

2.3.	Gauti avansai		-	-
2.4.	Už finansinį ir investicinį turtą mokėtinos sumos		-	-
2.5.	Pagal vekselius ir čekius mokėtinos sumos		-	-
2.6.	Įmonių grupės įmonėms mokėtinos sumos		-	-
2.7.	Asocijuotosioms įmonėms mokėtinos sumos		-	-
2.8.	Valdymo įmonei ir depozitoriumui mokėtinos sumos		2 827	2 464
2.9.	Kitos per vienus metus mokėtinos sumos		5 459	5 250
2.10.	Įsipareigojimai pagal išvestinių finansinių priemonių sutartis		-	-
2.11.	Pelno mokesčio įsipareigojimai		-	-
2.12.	Su darbo santykiais susiję įsipareigojimai		-	-
2.13.	Kiti trumpalaikiai įsipareigojimai		-	-
G.	SUKAUPOTOS SAŪNAUDOS IR ATEINANČIŲ LAIKOTARPIŲ PAJAMOS		-	-
	NUOSAVO KAPITALO IR ĮSIPAREIGOJIMŲ IŠ VISO		2 422 852	2 033 345

Generalinis direktorius  
(valdymo įmonės vadovo pareigų pavadinimas)

(parašas, data)

Ramūnas Baranauskas  
(vardas ir pavardė)

Vyr. finansininkas  
(vyriausiojo buhalterio (buhalterio) arba galinčio tvarkyti apskaitą kito asmens pareigų pavadinimas)

(parašas, data)

Dainius Minelga  
(vardas ir pavardė)

**23.2. Investicinio fondo atveju – grynujų aktyvų pokyčių ataskaitą, investicinės bendrovės atveju – pelno (nuostolių) ataskaitą, nuosavo kapitalo pokyčių ataskaitą ir pinigų srautų ataskaitą;**

**PELNO (NUOSTOLIŲ) ATASKAITA, EUR  
PAGAL 2017 m. birželio 30 d. DUOMENIS**

Eil. Nr.	STRAIPSNIAI	Pastabos Nr.	Finansiniai metai	Praėję finansiniai metai
1.	PAGRINDINĖS VEIKLOS PAJAMOS		314 213	279 823
1.1.	Palūkanų pajamos		-	-
1.2.	Dividendai		74 897	84 931
1.3.	Nuomos pajamos		-	-
1.4.	Pelnas dėl investicijų vertės pasikeitimo ir pardavimo		239 042	194 892
1.5.	Pelnas dėl užsienio valiutų kursų pokyčio		-	-
1.6.	Išvestinių finansinių priemonių sandorių pelnas		-	-
1.7.	Garantinės įmokos		-	-
1.8.	Su bendrovės akcijų pardavimu (išpirkimu) susijusių atskaitymų pajamos		-	-
1.9.	Kitos pagrindinės veiklos pajamos		274	-
2.	PAGRINDINĖS VEIKLOS SĄNAUDOS		90 596	99 608
2.1.	Nuostoliai dėl investicijų vertės pasikeitimo ir pardavimo		90 507	99 486
2.2.	Nuostoliai dėl užsienio valiutų kursų pokyčio		89	122
2.3.	Išvestinių finansinių priemonių sandorių nuostoliai		-	-
2.4.	Bendrovės akcijų pardavimo sąnaudos		-	-
2.5.	Kitos pagrindinės veiklos sąnaudos		-	-
3.	BENDRASIS PELNAS (NUOSTOLIAI)		223 617	180 215
4.	BENDROSIOS IR ADMINISTRACINĖS SĄNAUDOS	18	24 745	21 591
4.1.	Atlyginimas valdymo įmonei	18	11 782	9 883
4.2.	Atlyginimas depozitoriumui	18	1 495	1 470
4.3.	Atlyginimas tarpininkams	18	196	447
4.4.	Audito sąnaudos	18	1 829	1 800
4.5.	Kitos bendrosios ir administracinės sąnaudos	18	9 443	7 991
4.6.	Sąnaudų kompensavimas (-)		-	-
5.	KITOS VEIKLOS REZULTATAI		-	-
6.	PALŪKANŲ IR KITOS PANAŠIOS SĄNAUDOS		-	-
7.	PELNAS (NUOSTOLIAI) PRIEŠ APMOKESTINIMĄ		198 872	158 624
8.	PELNO MOKESTIS		-	-
9.	GRYNASIS PELNAS (NUOSTOLIAI)		198 872	158 624

Generalinis direktorius  
(valdymo įmonės vadovo pareigų pavadinimas)

(parašas, data)

Ramūnas Baranauskas  
(vardas ir pavardė)

Vyr. finansininkas  
(vyriausiojo buhalterio (buhalterio) arba galinčio tvarkyti apskaitą kito asmens pareigų pavadinimas)

(parašas, data)

Dainius Minelga  
(vardas ir pavardė)

2017 08 29

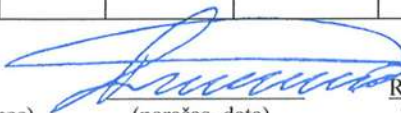


**2017 M. BIRŽELIO 30 D. NUOSAVO KAPITALO POKYČIŲ ATASKAITA, EUR**

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			
<b>1. Likutis už praėjusių finansinių metų pabaigoje</b>	<b>1 441 432</b>	-	-	-	-	-	<b>484 499</b>	<b>1 925 931</b>
2. Apskaitos politikos pakeitimo rezultatas	-	-	-	-	-	-	-	-
3. Esminių klaidų taisymo rezultatas	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>4. Perskaičiuotas likutis už praėjusių finansinių metų pabaigoje</b>	<b>1 441 432</b>	-	-	-	-	-	<b>484 499</b>	<b>1 925 931</b>
5. Ilgalaikio materialiojo ir finansinio turto vertės padidėjimas (sumažėjimas)	-	-	-	-	-	-	-	-
6. Pelno (nuostolių) ataskaitoje nepripažintas pelnas (nuostoliai)	-	-	-	-	-	-	-	-
7. Ataskaitinio laikotarpio grynas pelnas (nuostoliai)	-	-	-	-	-	-	343 241	343 241
8. Paskelbti dividendai ir kitos su pelno paskirstymu susijusios išmokos	-	-	-	-	-	-	-	-
9. Sudaryti rezervai	-	-	-	-	-	-	-	-
10. Panaudoti rezervai	-	-	-	-	-	-	-	-
11. Akcinio kapitalo padidėjimas pardavus bendrovės akcijas	106 417	-	-	-	-	-	-	106 417
12. Akcinio kapitalo sumažėjimas išpirkus bendrovės akcijas	(62 144)	-	-	-	-	-	(87 867)	(150 011)
13. Įnašai nuostoliams padengti	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>14. Likutis praėjusių finansinių metų pabaigoje</b>	<b>1 485 705</b>	-	-	-	-	-	<b>739 873</b>	<b>2 225 578</b>
15. Ilgalaikio materialiojo ir finansinio turto vertės padidėjimas (sumažėjimas)	-	-	-	-	-	-	-	-
16. Pelno (nuostolių) ataskaitoje nepripažintas pelnas (nuostoliai)	-	-	-	-	-	-	-	-
17. Ataskaitinio laikotarpio grynas pelnas (nuostoliai)	-	-	-	-	-	-	198 872	198 872
18. Dividendai ir kitos su pelno paskirstymu susijusios išmokos	-	-	-	-	-	-	-	-
19. Sudaryti rezervai	-	-	-	-	-	-	-	-
20. Panaudoti rezervai	-	-	-	-	-	-	-	-
21. Akcinio kapitalo padidėjimas pardavus bendrovės akcijas	58 264	-	-	-	-	-	-	58 264
22. Akcinio kapitalo sumažėjimas išpirkus bendrovės akcijas	( 24 923 )	-	-	-	-	-	( 43 225 )	( 68 148 )
23. Įnašai nuostoliams padengti	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>24. Likutis ataskaitinių finansinių metų pabaigoje</b>	<b>1 519 046</b>	-	-	-	-	-	<b>895 520</b>	<b>2 414 566</b>

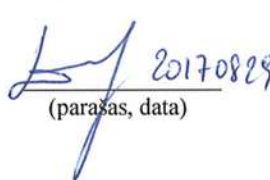
Generalinis direktorius \_\_\_\_\_  
(valdymo įmonės vadovo pareigų pavadinimas)

(parašas, data)

  
Ramūnas Baranauskas  
(vardas ir pavardė)

Vyr. finansininkas \_\_\_\_\_  
(vyriausiojo buhalterio (buhalterio) arba galinčio tvarkyti apskaitą kito asmens pareigų pavadinimas)

(parašas, data)

  
Dainius Minelga  
(vardas ir pavardė)

**2017 M. BIRŽELIO 30 D. PINIGŲ SRAUTŲ ATASKAITA, EUR**

Eil. Nr.	Straipsniai	Pastabos Nr.	Finansiniai metai	Praėję finansiniai metai
<b>1.</b>	<b>Pagrindinės veiklos pinigų srautai</b>			
1.1.	Ataskaitinio laikotarpio pinigų įplaukos		138 443	344 702
1.1.1.	Už parduotą finansinį ir investicinį turtą gauti pinigai		76 343	289 196
1.1.2.	Gautos palūkanos		-	-
1.1.3.	Gauti dividendai		61 826	54 830
1.1.4.	Gauti nuompinigiai		-	-
1.1.5.	Kitos veiklos įplaukos		274	676
1.2.	Ataskaitinio laikotarpio pinigų išmokos		( 146 162 )	( 177 669 )
1.2.1.	Išmokos už finansinio ir investicinio turto įsigijimą ir įvykdyti įsipareigojimai		( 108 160 )	( 150 067 )
1.2.2.	Išmokos, susijusios su administracinėmis ir bendrosiomis reikmėmis		( 24 532 )	( 11 855 )
1.2.3.	Kitos išmokos		( 13 470 )	( 15 747 )
	Grynieji pagrindinės veiklos pinigų srautai		( 7 719 )	167 033
<b>2.</b>	<b>Finansinės veiklos pinigų srautai</b>			
2.1.	Bendrovės akcijų pardavimas, įnašų gavimas	2	58 264	33 806
2.2.	Bendrovės akcijų išpirkimas, įnašų grąžinimas	2	( 68 148 )	( 160 942 )
2.3.	Išmokos iš pelno		-	-
2.4.	Gauta paskolų		-	-
2.5.	Grąžinta paskolų		-	-
2.6.	Sumokėta palūkanų		-	-
2.7.	Pinigų srautai, susiję su kitais finansavimo šaltiniais		-	-
2.8.	Kitas finansinės veiklos pinigų srautų padidėjimas		-	-
2.9.	Kitas finansinės veiklos pinigų srautų sumažėjimas		-	-
	Grynieji finansinės veiklos pinigų srautai		( 9 884 )	( 127 136 )
<b>3.</b>	<b>Valiutos kursų pokyčio įtaka grynujų pinigų likučiui</b>		( 89 )	( 122 )
<b>4.</b>	<b>Grynasis pinigų srautų padidėjimas (sumažėjimas)</b>		( 17 692 )	39 775
<b>5.</b>	<b>Pinigai ataskaitinio laikotarpio pradžioje</b>		35 338	5 938
<b>6.</b>	<b>Pinigai ataskaitinio laikotarpio pabaigoje</b>	<b>3,4</b>	17 646	45 713

Generalinis direktorius  
(valdymo įmonės vadovo pareigų pavadinimas)

(parašas, data)

Ramūnas Baranauskas  
(vardas ir pavardė)

Vyr. finansininkas  
(vyriausiojo buhalterio (buhalterio) arba galinčio tvarkyti apskaitą kito asmens pareigų pavadinimas)

(parašas, data)

Dainius Minelga  
(vardas ir pavardė)

### 23.3. Aiškinamąjį raštą.

#### I. Bendroji informacija

##### 1. Informacija apie fondą:

<b>Pavadinimas</b>	Investicinė kintamojo kapitalo bendrovė „OMX Baltic Benchmark Fund“ (toliau – Fondas). Iki 2011 m. vasario mėnesio Fondo pavadinimas buvo „NSEL 30 indekso fondas“
<b>Teisinė forma</b>	Investicinė kintamojo kapitalo bendrovė
<b>Lietuvos banko pritarimo sudarymo dokumentams data</b>	2000 m. rugsėjo 14 d.
<b>Dalyvių skaičius</b>	269
<b>Veiklos trukmė</b>	Neterminuota
<b>Kita</b>	Nuo 2011 m. vasario 1 d. fondo akcijos yra listinguojamos Baltijos fondų prekybos sąrašė

##### 2. Duomenys apie valdymo įmonę:

<b>Pavadinimas</b>	Uždaroji akcinė bendrovė „Orion Asset Management“ (buvusi UAB „Investicijų portfelio valdymas“)
<b>Kodas</b>	111707985
<b>Buveinė (adresas)</b>	A. Tumėno g. 4, Vilnius
<b>Telefono numeriai,</b> <b>fakso numeriai,</b> <b>el. pašto adresas,</b> <b>interneto svetainės adresas</b>	+370 5 231 38 33 +370 5 231 38 40 oam@orion.lt www.am.orion.lt
<b>Leidimo verstis valdymo įmonės veikla numeris</b>	VĮK - 011
<b>Įregistravimo Juridinių asmenų registre data, vieta, kodas</b>	2000 m. rugpjūčio 4 d. LR ūkio ministerijoje, UĮ 2000-205
<b>Kolektyvinio investavimo subjekto valdytojo vardas, pavardė, pareigos</b>	Donatas Frejus.

##### 3. Informacija apie depozitoriumą:

<b>Pavadinimas</b>	AB SEB bankas
<b>Kodas</b>	112021238
<b>Adresas</b>	Gedimino pr. 12, Vilnius
<b>Telefono ir fakso numeriai</b>	+370 5 268 2680, +370 5 268 2682 +370 5 268 2683

##### 4. Informacija apie auditorius:

<b>Auditoriaus pavadinimas</b>	„Ernst&Young Baltic“, UAB
<b>Adresas</b>	Subačiaus g. 7, Vilnius
<b>Telefono, fakso numeriai</b>	+370 5 274 2200, +370 5 274 2333

##### 5. Ataskaitinis laikotarpis:

<b>Ataskaitinis laikotarpis</b>	2017 m. sausio 1 d. – 2017 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 tikrąja verte.

Valdymo įmonė apskaitą tvarko ir šiose finansinėse ataskaitose visas sumas pateikia Lietuvos Respublikos valiuta – eurai.

Fondo finansiniai metai sutampa su kalendoriniais metais. Fondo pusmetinė finansinė ataskaita turi būti sudaroma per du mėnesius nuo ataskaitinio periodo pabaigos.

### **Investavimo politika**

Fondo investicinės veiklos tikslas yra investuojant ir reinvestuojant pinigines lėšas, gautas platinant išperkamuosius 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 Nasdaq, Inc. ir intelektinės nuosavybės teisės į Indeksą priklauso Nasdaq, 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 Vilnius, NASDAQ Tallinn ir NASDAQ 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 BALTIC tinklapyje <http://www.nasdaqbaltic.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 grynujų 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 grynujų aktyvų. Šiuo atveju Fondo sutrumpintame prospekte turi būti pateikiama tokias išskirtines sąlygas pagrindžianti informacija.

2013 metais Fondas kreipėsi į Lietuvos banką su prašymu leisti investuoti į vieną poziciją daugiau negu 20 proc. grynujų aktyvų vertės. 2013 m. gegužės 24 d. buvo gautas Lietuvos banko leidimas investuoti iki 35 proc. Fondo grynujų aktyvų vertės į vieną emitentą – AS Tallink Grupp.

## **2. 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 akcijas, kurios įtrauktos į OMX Baltic Benchmark indekso sudėtį.

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 sumažina indekso sudarymo metodika, kuri nustatydamas atskirų bendrovių svorį indekse atsižvelgia į laisvoje apyvartoje esančių akcijų skaičių. Vis dėlto, galimybę savo nuožiūra minimizuoti likvidumo riziką riboja galiojantys vertybinių popierių portfelio diversifikavimo reikalavimai bei fondo investavimo strategija (kaip galima tiksliau atspindėti indekso sudėtį). 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.

## **3. 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 jų 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 įsigyjant 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 – perkainota euro ir Lietuvos banko skelbiamo kurso suma.

Sumažėjimas fiksuojamas pardavus turtą ar pripažįstant turto vertės sumažėjimą.

#### 4. Atskaitymų valdymo įmonei, depozitoriumui bei kitos taisyklės

Iš Fondo lėšų galima apmokėti tik tas išlaidas, kurios yra susijusios su Fondo valdymu ir kurių baigtinis sąrašas yra nurodytas Fondo įstatuose. Visos nenumatytos arba nustatytas ribas viršijančios Fondo išlaidos turi būti dengiamos Valdymo įmonės sąskaita. Visų žemiau nurodytų išlaidų, mokamų iš Fondo aktyvų, suma per metus negali būti didesnė kaip 3% Fondo grynujų aktyvų vidutinės metinės vertės.

Fondas iš savo lėšų turi padengti šias su Fondo veikla susijusias išlaidas:

1. atlyginimą Valdymo įmonei už Fondo turto valdymą;
2. kitas išlaidas, susijusias su Fondo valdymu:
  - 2.1. atlyginimas auditoriui už audito paslaugas ir konsultacijas;
  - 2.2. atlyginimas teisiniams konsultantams už teises konsultacijas, teisinę pagalbą ir atstovavimą;
  - 2.3. išlaidos, susijusios su informacijos pateikimu Fondo akcininkams ir investuotojams bei jų aptarnavimo išlaidas;
  - 2.4. išlaidos, mokamos finansų tarpininkams, bankams, biržoms ir kitiems asmenims už atliktus turto perleidimo sandorius, įvairių tarpininkavimą, lėšų pervedimą, sąskaitos atidarymą ir tvarkymą, komisiniai mokesčiai ir kiti mokesčiai, susiję su Fondo turto valdymu;
  - 2.5. išlaidos, susijusios su viešu informacijos apie Fondą pateikimu, Fondo reklamos, rinkodaros (marketingo) ir investuotojų pritraukimo į Fondą išlaidos;
3. atlyginimą Depozitoriumui už depozitoriumo paslaugas;
4. atlyginimą viešosios apyvartos tarpininkams už finansų maklerio (viešosios apyvartos tarpininko) paslaugas;
5. OMX Baltic Benchmark GI indekso naudojimo licencijavimo mokestį;
6. Su Fondo akcijų kotiravimu biržoje susijusius mokesčius: mokesčius NASDAQ Vilnius biržai: a) finansinių priemonių įtraukimo į NASDAQ Vilnius prekybos sąrašus įmoką; b) metinę finansinių priemonių kotiravimo įmoką. Mokesčius AB „Lietuvos centrinis vertybinių popierių depozitoriumas“ (toliau - LCVPD): a) metinę įmoką; b) ketvirtinę sąskaitų tvarkymo įmoką; c) vertybinių popierių esminių įvykių aptarnavimo įmoką; d) vertybinių popierių savininkų sąrašo formavimo mokestį. Rinkos formuotojo, sąskaitų tvarkytojo ir emitento pagrįdinto įgaliotinio, akcininkų registro tvarkytojo mokesčius UAB FMĮ „Orion Securities“.

Kitoms su Fondo veikla susijusioms išlaidoms, kurios nėra mokamos periodiškai arba nustatyta tvarka, padengti skirtos lėšos kaupiamos Fondo sąskaitoje ir pervedamos tokioms išlaidoms atsiradus.

Fondas visuotinio akcininkų susirinkimo nutarimu gali mokėti tantjemas stebėtojų tarybos nariams.

Atlyginimas Valdymo įmonei už Fondo turto valdymą (investicijų konsultavimą, finansų apskaitą, metų ir pusmečio ataskaitas, GAV skaičiavimą ir pan.) yra lygus 1% Fondo grynujų aktyvų vidutinės metinės vertės. 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 (depozitoriumo paslaugas) negali būti didesnis už 0,3% Fondo grynujų aktyvų vidutinės metinės vertės. Iš Fondo lėšų Depozitoriumui papildomai mokamas fiksuotas ne didesnis kaip 8,69 eurai mokestis už kiekvieną vertybinių popierių ir pinigų operaciją Fondo pinigų ir vertybinių popierių sąskaitose. Atlyginimas depozitoriumui už Fondo akcijų apskaitą (depozitoriumo paslaugas) skaičiuojamas kiekvieną kartą, kai yra skaičiuojama Fondo GAV, ir 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.

OMX Baltic Benchmark GI indekso naudojimo licencijavimo mokestis yra mokamas NASDAQ Inc., už leidimą naudoti OMX Baltic Benchmark GI indeksą Fondo investicinio portfelio sudarymui ir „OMX Baltic Benchmark“ pavadinimo naudojimą. Mokestis priklauso nuo Fondo grynujų aktyvų vertės.

Jis yra apskaičiuojamas Valdymo įmonės kiekvienų kalendorinių metų pabaigoje ir, suderinus su NASDAQ Inc., pervedamas į NASDAQ Inc. sąskaitą. Indekso naudojimo licencijavimo mokestis yra 0,05% Fondo grynujų aktyvų vidutinės metinės vertės, bet ne mažiau kaip 3000 JAV dolerių.

Metinė Fondo akcijų kotiravimo NASDAQ Vilnius biržoje įmoka negali būti didesnė kaip 0,2% Fondo grynujų aktyvų vidutinės metinės vertės.



Fondas pagal darbo sutartis dirbančių darbuotojų neturi ir nemoka jiems atlyginimų. Fondo administracijos funkcijas atlieka Valdymo įmonė.

Atlyginimas auditoriui už audito paslaugas negali būti didesnis už 8688,60 EUR.

Atlyginimas akcijų platintojui už akcijų platinimą negali būti didesnis už 2% akcijos vertės. Platinimo mokestis, teisės aktų nustatyta tvarka, paimamas iš investuotojo, įsigyjančio Fondo akcijas, atitinkamai padidinant parduodamos akcijos kainą. Valdymo įmonės sprendimu akcijų platinimo mokestis gali būti netaikomas. Konkretūs platinimo mokesčiai nurodomi investavimo į Fondą sutartyje.

Atlyginimas viešosios apyvartos tarpininkams už finansų maklerio (viešosios apyvartos tarpininko) paslaugas nustatomas su juo pasirašomoje sutartyje.

Kitoms su Bendrovės veikla susijusioms išlaidoms, kurios nėra mokamos periodiškai arba nustatyta tvarka, padengti skirtos lėšos kaupiamos Bendrovės sąskaitoje ir pervedamos tokioms išlaidoms atsiradus.

## **5. Turto ir įsipareigojimų įvertinimo metodai ir periodiškumas**

Fondo turtas ir įsipareigojimai vertinami vadovaujantis Lietuvos Respublikos įstatymų, LR Vertybinių popierių komisijos (šiuo metu funkcijos perimtos Lietuvos banko) patvirtintos Grynųjų 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 grynųjų aktyvų vertę, už kurią labiausiai tikėtina šiuos aktyvus parduoti.

Skaičiuojant grynųjų aktyvų vertę, užsienio valiuta, įvertinto turto ir įsipareigojimų vertė nustatoma pagal vertinimo dieną apskaitoje taikomą euro ir užsienio valiutos santykį, nustatytą vadovaujantis Lietuvos buhalterinės apskaitos įstatymu.

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 kaina.

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 ir apskaitomas pelno (nuostolių) ataskaitoje.

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 pagal vertinimo dieną apskaitoje taikomą euro ir užsienio valiutos santykį, nustatytą vadovaujantis Lietuvos Respublikos buhalterinės apskaitos įstatymu.

## **6. 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 grąžinti investuotojui su patvirtinimu, kad ją gavo.

1.3. Jei paraiškos pateikiamos po 16.00 val. Lietuvos laiku, skaičiuojant X darbo dienos GAV į šias paraiškas 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. [vykdžius 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 Fondo tinklalapiuose [www.am.orion.lt](http://www.am.orion.lt).

4. Fondo vieneto vertė turi sutapti su vienam vienetui 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 vienetus, vieneto išpirkimo kaina mažinama vienam vienetui tenkančių išpirkimo sąnaudų suma. Išpirkimo sąnaudų dydį apskaičiuoja Fondo valdymo įmonė. Vienam vienetui tenkančių išpirkimo sąnaudų suma skelbiama Fondo prospekte.

## **7. Investicijų portfelio struktūra.**

Fondas investuoja į OMX Baltic Benchmark GI (toliau - Indeksas) akcijų indeksą sudarančias priemones. Indeksas yra skaičiuojamas Nasdaq, Inc. ir intelektinės nuosavybės teisės į Indeksą priklauso Nasdaq, 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 Vilnius, NASDAQ Tallinn ir NASDAQ 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 BALTIC tinklapyje <http://www.nasdaqbaltic.com/>.

Indeksas yra performuojamas kartą per pusmetį.

Investicinio portfelio struktūra 2016 m. gruodžio 31 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 (2017 01 01)	Ataskaitinio laikotarpio pabaigoje (2017 06 30)	Prieš metus (2016 06 30)	Prieš dvejus metus (2015 06 30)
Grynujų aktyvų vertė, EUR	2 225 578	2 414 566	2 025 631	2 032 509
Vieneto vertė, EUR	9,2588	10,0795	8,4877	7,6635
Vienetų, esančių apyvartoje, skaičius	240 375	239 553	238 656	265 218

**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 2017 m. I pusmetis		Ankstesnis ataskaitinis laikotarpis 2016 m. I pusmetis	
	Apskaitos vienetų skaičius	Vertė, EUR	Apskaitos vienetų skaičius	Vertė, EUR
Išplatintų apskaitos vienetų skaičius (konvertuojant pinigus į vienetus)	6 091	58 264	4 239	33 806
Išpirktų apskaitos vienetų skaičius (konvertuojant vienetus į pinigus)	( 6 913 )	( 68 148 )	( 11 247 )	( 92 730 )
Skirtumas tarp išplatintų ir išpirktų vienetų skaičiaus ir vertės	( 822 )	( 9 884 )	( 7 008 )	( 58 924 )

**3. Investicijų paskirstymas**

Investicijų pasiskirstymas	Ataskaitinio laikotarpio pabaigoje		Ataskaitinio laikotarpio pradžioje	
	Rinkos vertė, EUR	Dalis GA, %	Rinkos vertė, EUR	Dalis GA, %
<b>Pagal investavimo objektus</b>				
Nuosavybės vertybiniai popieriai	2 390 831	99,01	2 199 153	98,81
Pinigai	17 646	0,73	35 338	1,59
<b>Iš viso:</b>	<b>2 408 477</b>	<b>99,74</b>	<b>2 234 491</b>	<b>100,40</b>
<b>Pagal valiutas</b>				
EUR	2 408 477	99,74	2 234 491	100,40
<b>Iš viso:</b>	<b>2 408 477</b>	<b>99,74</b>	<b>2 234 491</b>	<b>100,40</b>
<b>Pagal geografinę zoną</b>				
Lietuva	708 007	29,33	629 078	28,26
Latvija	179 203	7,42	128 932	5,79
Estija	1 521 267	62,99	1 476 481	66,35
<b>Iš viso:</b>	<b>2 408 477</b>	<b>99,74</b>	<b>2 234 491</b>	<b>100,40</b>

#### 4. Investicijų portfelio struktūra EUR

2017 m. birželio 30 d.:

Emitento pavadinimas	Šalis	ISIN kodas	Kiekis, vnt.	Bendra nominali vertė	Bendra įsigijimo vertė	Bendra rinkos vertė	Rinka, pagal kurios duomenis nustatyta rinkos vertė (interneto svetainės adresas)	Balsų dalis emitente %	Dalis GA, %
Nuosavybės vertybiniai popieriai, įtraukti į Oficialųjį ar įj atitinkantį prekybos sąrašą:									
Tallinna Kaubamaja	EE	EE0000001105	23 004	9 202	149 312	211 637	<a href="http://www.nasdaqomxbaltic.com">www.nasdaqomxbaltic.com</a>	0,0565	8,77
AS Silvano Fashion Group	EE	EE3100001751	34 075	10 223	99 107	95 069	<a href="http://www.nasdaqomxbaltic.com">www.nasdaqomxbaltic.com</a>	0,0921	3,94
AS Baltika	EE	EE3100003609	56 510	11 302	35 381	16 218	<a href="http://www.nasdaqomxbaltic.com">www.nasdaqomxbaltic.com</a>	0,1385	0,67
Harju Elekter	EE	EE3100004250	18 466	-	57 695	76 634	<a href="http://www.nasdaqomxbaltic.com">www.nasdaqomxbaltic.com</a>	0,1041	3,17
AS Tallink Grupp	EE	EE3100004466	435 692	261 415	351 979	396 480	<a href="http://www.nasdaqomxbaltic.com">www.nasdaqomxbaltic.com</a>	0,0650	16,42
Pro Kapital Grupp, AS (PKG)	EE	EE3100006040	32 678	6 536	68 043	68 624	<a href="http://www.nasdaqomxbaltic.com">www.nasdaqomxbaltic.com</a>	0,0602	2,84
Tallina Vesi	EE	EE3100026436	10 156	6 016	100 914	126 950	<a href="http://www.nasdaqomxbaltic.com">www.nasdaqomxbaltic.com</a>	0,0508	5,26
Nordecon	EE	EE3100039496	19 446	-	23 826	24 502	<a href="http://www.nasdaqomxbaltic.com">www.nasdaqomxbaltic.com</a>	0,0601	1,01
LHV Group	EE	EE3100073644	24 298	24 298	186 399	242 980	<a href="http://www.nasdaqomxbaltic.com">www.nasdaqomxbaltic.com</a>	0,0958	10,06
Olympic Entertainment Group	EE	EE3100084021	92 736	-	146 237	160 433	<a href="http://www.nasdaqomxbaltic.com">www.nasdaqomxbaltic.com</a>	0,0611	6,64
Merko Ehitus	EE	EE3100098328	8 322	-	76 921	76 562	<a href="http://www.nasdaqomxbaltic.com">www.nasdaqomxbaltic.com</a>	0,0470	3,17
AS Premia Foods AS	EE	EE3100101031	64 560	12 912	53 695	25 178	<a href="http://www.nasdaqomxbaltic.com">www.nasdaqomxbaltic.com</a>	0,1669	1,04
AB Rokiškio sūris	LT	LT0000100372	17 419	5 052	20 692	41 631	<a href="http://www.nasdaqomxbaltic.com">www.nasdaqomxbaltic.com</a>	0,0540	1,72
Grigeo Grigiškės	LT	LT0000102030	48 484	14 060	30 621	54 787	<a href="http://www.nasdaqomxbaltic.com">www.nasdaqomxbaltic.com</a>	0,0738	2,27
AB Šiaulių bankas	LT	LT0000102253	426 458	123 673	110 756	209 817	<a href="http://www.nasdaqomxbaltic.com">www.nasdaqomxbaltic.com</a>	0,1130	8,69
AB Apranga	LT	LT0000102337	30 312	8 790	48 489	77 296	<a href="http://www.nasdaqomxbaltic.com">www.nasdaqomxbaltic.com</a>	0,0548	3,2
AB Klaipėdos nafta	LT	LT0000111650	114 568	33 225	49 459	52 587	<a href="http://www.nasdaqomxbaltic.com">www.nasdaqomxbaltic.com</a>	0,0301	2,18
AB Pieno žvaigždės	LT	LT0000111676	25 943	7 523	46 769	36 839	<a href="http://www.nasdaqomxbaltic.com">www.nasdaqomxbaltic.com</a>	0,0575	1,53
AB Telia Lietuva	LT	LT0000123911	118 601	34 394	87 325	105 911	<a href="http://www.nasdaqomxbaltic.com">www.nasdaqomxbaltic.com</a>	0,0204	4,39
AB Linas Agro Group	LT	LT0000128092	69 057	200 027	35 531	45 578	<a href="http://www.nasdaqomxbaltic.com">www.nasdaqomxbaltic.com</a>	0,0434	1,89
Olainfarm	LV	LV0000100501	7 114	9 960	35 779	77 543	<a href="http://www.nasdaqomxbaltic.com">www.nasdaqomxbaltic.com</a>	0,0505	3,21
Grimdeks	LV	LV0000100659	4 346	6 084	36 037	33 030	<a href="http://www.nasdaqomxbaltic.com">www.nasdaqomxbaltic.com</a>	0,0453	1,37
Latvijas kuģniecība	LV	LV0000101103	69 331	20 799	34 098	49 710	<a href="http://www.nasdaqomxbaltic.com">www.nasdaqomxbaltic.com</a>	0,0347	2,06
SAF Technika	LV	LV0000101129	1 737	2 432	7 052	8 424	<a href="http://www.nasdaqomxbaltic.com">www.nasdaqomxbaltic.com</a>	0,0585	0,35
<b>Iš viso</b>	-	-	<b>1 753 313</b>	-	<b>1 892 117</b>	<b>2 314 420</b>	-	-	<b>95,85</b>
Nuosavybės vertybiniai popieriai, įtraukti į Papildomąjį ar įj atitinkantį prekybos sąrašą:									
AB Žemaitijos pienas	LT	LT0000121865	34 800	8 759	8 114	14 268	<a href="http://www.nasdaqomxbaltic.com">www.nasdaqomxbaltic.com</a>	0,0719	0,59
AB AUGA group	LT	LT0000127466	30 203	10 092	16 453	51 647	<a href="http://www.nasdaqomxbaltic.com">www.nasdaqomxbaltic.com</a>	0,0161	2,14
Valmieras stikla šķiedra	LV	LV0000100485	3 200	4 480	10 675	10 496	<a href="http://www.nasdaqomxbaltic.com">www.nasdaqomxbaltic.com</a>	0,0134	0,43
<b>Iš viso</b>	-	-	<b>68 203</b>	-	<b>35 242</b>	<b>76 411</b>	-	-	<b>3,16</b>
<b>Iš viso nuosavybės vertybinių popierių</b>	-	-	<b>1 821 516</b>	-	<b>1 927 359</b>	<b>2 390 831</b>	-	-	<b>99,01</b>

Banko pavadinimas	Šalis	Valiuta	Bendra rinkos vertė, EUR	Dalis GA, %
Pinigai:				
AB SEB bankas	LT	EUR	17 646	0,73
<b>Iš viso pinigų:</b>	-	-	<b>17 646</b>	<b>0,73</b>

2016 m. birželio 30 d.:

Emitento pavadinimas	Šalis	ISIN kodas	Kiekis, vnt.	Bendra nominali vertė	Bendra įsigijimo vertė	Bendra rinkos vertė	Rinka, pagal kurios duomenis nustatyta rinkos vertė (interneto svetainės adresas)	Balsų dalis emitente %	Dalis GA, %
Nuosavybės vertybiniai popieriai, įtraukti į Oficialųjį ar jį atitinkantį prekybos sąrašą:									
Tallinna Kaubamaja	EE	EE0000001105	19 754	7 902	122 247	134 130	<a href="http://www.nasdaqomxbaltic.com">www.nasdaqomxbaltic.com</a>	0,0194	6,62
AS Silvano Fashion Group	EE	EE3100001751	29 075	8 723	84 457	58 150	<a href="http://www.nasdaqomxbaltic.com">www.nasdaqomxbaltic.com</a>	0,0230	2,87
AS Baltika	EE	EE3100003609	52 510	10 502	34 241	13 390	<a href="http://www.nasdaqomxbaltic.com">www.nasdaqomxbaltic.com</a>	0,0257	0,66
Harju Elekter	EE	EE3100004250	15 247	0	48 521	37 965	<a href="http://www.nasdaqomxbaltic.com">www.nasdaqomxbaltic.com</a>	0,0000	1,87
Tallink Grupp	EE	EE3100004466	606 492	363 895	496 645	554 334	<a href="http://www.nasdaqomxbaltic.com">www.nasdaqomxbaltic.com</a>	0,0540	27,37
Pro Kapital Grupp, AS (PKG)	EE	EE3100006040	26 178	5 236	55 122	57 330	<a href="http://www.nasdaqomxbaltic.com">www.nasdaqomxbaltic.com</a>	0,0097	2,83
Tallinna Vesi	EE	EE3100026436	8 326	4 996	75 490	114 066	<a href="http://www.nasdaqomxbaltic.com">www.nasdaqomxbaltic.com</a>	0,0250	5,63
Nordecon International AS	EE	EE3100039496	6 000	0	6 420	6 600	<a href="http://www.nasdaqomxbaltic.com">www.nasdaqomxbaltic.com</a>	0,0000	0,33
LHV Group	EE	EE3100073644	14 000	14 000	101 000	100 800	<a href="http://www.nasdaqomxbaltic.com">www.nasdaqomxbaltic.com</a>	0,0552	4,98
Olympic Entertainment Group	EE	EE3100084021	84 236	0	131 086	163 418	<a href="http://www.nasdaqomxbaltic.com">www.nasdaqomxbaltic.com</a>	0,0000	8,07
Merko Ehitus	EE	EE3100098328	7 442	0	68 927	58 866	<a href="http://www.nasdaqomxbaltic.com">www.nasdaqomxbaltic.com</a>	0,0000	2,91
AS Premia Foods	EE	EE3100101031	53 560	10 712	49 625	20 299	<a href="http://www.nasdaqomxbaltic.com">www.nasdaqomxbaltic.com</a>	0,0277	1,00
Rokiškio sūris	LT	LT0000100372	12 419	3 602	12 092	17 262	<a href="http://www.nasdaqomxbaltic.com">www.nasdaqomxbaltic.com</a>	0,0100	0,85
Grigeo Grigiškės	LT	LT0000102030	40 984	11 885	22 071	47 132	<a href="http://www.nasdaqomxbaltic.com">www.nasdaqomxbaltic.com</a>	0,0181	2,33
Šiaulių bankas	LT	LT0000102253	339 982	98 595	82 329	111 514	<a href="http://www.nasdaqomxbaltic.com">www.nasdaqomxbaltic.com</a>	0,0261	5,51
Apranga	LT	LT0000102337	26 842	7 784	39 429	67 105	<a href="http://www.nasdaqomxbaltic.com">www.nasdaqomxbaltic.com</a>	0,0141	3,31
AB Ūkio bankas	LT	LT0000102352	222 286	0	0	0	<a href="http://www.nasdaqomxbaltic.com">www.nasdaqomxbaltic.com</a>	0,0000	0,00
Klaipėdos nafta	LT	LT0000111650	105 568	30 615	44 869	54 684	<a href="http://www.nasdaqomxbaltic.com">www.nasdaqomxbaltic.com</a>	0,0080	2,70
Pieno žvaigždės	LT	LT0000111676	22 181	6 432	41 219	28 835	<a href="http://www.nasdaqomxbaltic.com">www.nasdaqomxbaltic.com</a>	0,0130	1,42
TFO LT	LT	LT0000123911	88 901	25 781	59 798	79 122	<a href="http://www.nasdaqomxbaltic.com">www.nasdaqomxbaltic.com</a>	0,0044	3,91
Vilkyškių pieninė	LT	LT0000127508	8 239	2 389	15 349	12 111	<a href="http://www.nasdaqomxbaltic.com">www.nasdaqomxbaltic.com</a>	0,0200	0,60
Linus agro group	LT	LT0000128092	55 057	15 967	26 571	36 613	<a href="http://www.nasdaqomxbaltic.com">www.nasdaqomxbaltic.com</a>	0,0100	1,81
Olainfarm	LV	LV0000100501	6 815	9 541	33 208	50 090	<a href="http://www.nasdaqomxbaltic.com">www.nasdaqomxbaltic.com</a>	0,0677	2,47
Grindeks	LV	LV0000100659	6 636	9 290	57 580	27 540	<a href="http://www.nasdaqomxbaltic.com">www.nasdaqomxbaltic.com</a>	0,0969	1,36
Latvijas kugniecība	LV	LV0000101103	69 331	20 799	34 098	31 684	<a href="http://www.nasdaqomxbaltic.com">www.nasdaqomxbaltic.com</a>	0,0104	1,56
SAF Technika	LV	LV0000101129	1 737	2 432	7 052	5 350	<a href="http://www.nasdaqomxbaltic.com">www.nasdaqomxbaltic.com</a>	0,0819	0,26
<b>Iš viso</b>	-	-	<b>1 929 798</b>	-	<b>1 749 446</b>	<b>1 888 390</b>	-	-	<b>93,23</b>
Nuosavybės vertybiniai popieriai, įtraukti į Papildomąjį ar jį atitinkantį prekybos sąrašą:									
Žemaitijos pienas	LT	LT0000121865	30 203	8 759	8 114	24 102	<a href="http://www.nasdaqomxbaltic.com">www.nasdaqomxbaltic.com</a>	0,0181	1,19
AB INVL Technology	LT	LT0000128860	1 038	301	1 920	1 858	<a href="http://www.nasdaqomxbaltic.com">www.nasdaqomxbaltic.com</a>	0,0025	0,09
Valmieras stikla šķiedra	LV	LV0000100485	2 200	3 080	7 526	7 370	<a href="http://www.nasdaqomxbaltic.com">www.nasdaqomxbaltic.com</a>	0,0129	0,36
Latvijas Gāze	LV	LV0000100899	1 498	2 097	14 806	16 029	<a href="http://www.nasdaqomxbaltic.com">www.nasdaqomxbaltic.com</a>	0,0053	0,79
<b>Iš viso</b>	-	-	<b>34 939</b>	-	<b>32 366</b>	<b>49 359</b>	-	-	<b>2,43</b>
<b>Iš viso nuosavybės vertybinių popierių</b>	-	-	<b>1 964 737</b>	-	<b>1 781 812</b>	<b>1 937 749</b>	-	-	<b>95,66</b>

Banko pavadinimas	Šalis	Valiuta	Bendra rinkos vertė, EUR		Dalis GA, %
Pinigai:					
AB SEB bankas	LT	EUR	45 713		2,26
<b>Iš viso pinigų:</b>	-	-	<b>45 713</b>		<b>2,26</b>

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

EUR

Investicijos	Pokytis					
	Praėjusio ataskaitinio laikotarpio pabaigoje 2016-12-31	Įsigyta	Parduota (išpirkta)*	Vertės padidėjimas	Vertės sumažėjimas*	Ataskaitinio laikotarpio pabaigoje 2017-06-30
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	2 199 153	119 486	76 262	238 932	90 478	2 390 831
Kitų kolektyvinio investavimo subjektų investiciniai vienetai ir akcijos	-	-	-	-	-	-
Išvestinės finansinės priemonės	-	-	-	-	-	-
Nekilnojamo turto objektai	-	-	-	-	-	-
Kitos investicijos	-	-	-	-	-	-
Iš viso:	<b>2 199 153</b>	<b>119 486</b>	<b>76 262</b>	<b>238 932</b>	<b>90 478</b>	<b>2 390 831</b>

\* Investicijų pardavimo pelnas (110 EUR) ir investicijų pardavimo nuostoliai (29 EUR) per 2017 m. I pusmetį įtraukti į parduotų (išpirktų) investicijų vertės eilutę.

EUR

Investicijos	Pokytis					
	Praėjusio ataskaitinio laikotarpio pabaigoje 2015-12-31	Įsigyta	Parduota (išpirkta)*	Vertės padidėjimas	Vertės sumažėjimas*	Ataskaitinio laikotarpio pabaigoje 2016-06-30
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	1 981 471	150 067	290 565	187 909	91 133	1 937 749
Kitų kolektyvinio investavimo subjektų investiciniai vienetai ir akcijos	-	-	-	-	-	-
Išvestinės finansinės priemonės	-	-	-	-	-	-
Nekilnojamo turto objektai	-	-	-	-	-	-
Kitos investicijos	-	-	-	-	-	-
Iš viso:	<b>1 981 471</b>	<b>150 067</b>	<b>290 565</b>	<b>187 909</b>	<b>91 133</b>	<b>1 937 749</b>

\* Investicijų pardavimo pelnas (6 983 EUR) ir investicijų pardavimo nuostoliai (8 353 EUR) per 2016 m. I pusmetį įtraukti į parduotų (išpirktų) investicijų vertės eilutę.

## 6. Investicijų pardavimo rezultatai (pelnas ir nuostoliai).

EUR

Grynųjų aktyvų ataskaitos straipsniai	Ataskaitinis laikotarpis 2017 01 01–2017 06 30	Praėję finansiniai metai 2016 01 01–2016 06 30
Vyriausybių ir centrinių bankų arba jų garantuoti ne nuosavybės vertybiniai popieriai	-	-
Nuosavybės vertybiniai popieriai	81	(1 370)
Kitų kolektyvinio investavimo subjektų investiciniai vienetai ir akcijos	-	-
<b>Iš viso:</b>	<b>81</b>	<b>(1 370)</b>

Investicijų pardavimo pelnas 2017 m. I pusmetį sudarė 110 EUR, o investicijų pardavimo nuostoliai – 29 Eur.

Investicijų pardavimo pelnas 2016 m. I pusmetį sudarė 6 983 EUR, o investicijų pardavimo nuostoliai – 8 353 Eur.

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

Išankstinis valiutų sandoris	Keitimo terminas	Keitimo kursas	Sandorio tikroji vertė	Užstatinių indėlių tikroji vertė	Tikroji vertė 2017-06-30
-	-	-	-	-	-
<b>Iš viso:</b>	-	-	-	-	-

## 8. Atlyginimo tarpininkams sąnaudos

EUR

Tarpininkas	Suteiktų paslaugų pobūdis	Atlygis už paslaugą (EUR) 2017-06-30	Atlygis už paslaugą (EUR) 2016-06-30	Ryšys su subjekto valdymo įmone
UAB FM  „Orion Securities“	Finansinių priemonių pirkimo/pardavimo komisiniai	196	447	Priklauso vienai įmonių grupei.
<b>Iš viso:</b>	-	<b>196</b>	<b>447</b>	-

## 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 laikotarpio sumos, suskirstytos į grupes, kitą reikšminga informacija pagal 30-ąjį verslo apskaitos standartą „Susiję asmenys“.**

2017 m. I pusmetį valdymo įmonei buvo priskaičiuota 11 782 EUR valdymo mokesčio (2016 m. I pusmetį 9 883 EUR).

2017 m. I pusmetį UAB FMĮ „Orion securities“ buvo priskaičiuota 6 897 EUR mokesčio už apskaitos paslaugas (2016 m. I pusmetį – atitinkamai 5 445 EUR).

**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 grynujų aktyvų skaičiavimo datos įvykę reikšmingi turto ir įsipareigojimų pokyčiai, neįtraukti į grynujų 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**

(Pateikiama tik su metine ataskaita)

## 18. Atskaitymai

Atskaitymai	Atskaitymų dydis, taikytas ataskaitiniu laikotarpiu	Per ataskaitinį laikotarpį priskaičiuotų atskaitymų suma (EUR)	Procentinė dalis nuo ataskaitinio laikotarpio vidutinės grynujų aktyvų vertės
2017 01 01–2017 06 30			
<b>Už valdymą:</b>	<b>1 %</b>	<b>11 782</b>	<b>0,50</b>
<i>nekintamas dydis</i>		11 782	0,50
<i>sėkmės mokestis</i>		-	-
Depozitoriumui	0,3 %	1 495	0,06
<i>mokestis nuo aktyvų</i>		1 414	0,06
<i>už sandorių sudarymą</i>		81	0,00
Už sandorių sudarymą		196	0,01
Už auditą		1 829	0,08
Kitos veiklos išlaidos		9 443	0,41
<b>Išlaidų, įskaičiuojamų į BIK, suma</b>		<b>24 549</b>	<b>1,05</b>
<b>BIK % nuo vidutinės GAV*</b>		<b>1,05 %</b>	
<b>Visų išlaidų suma</b>	<b>3 %</b>	<b>24 745</b>	<b>1,06</b>
<b>PAR (jei skaičiuojamas)*</b>		-	
2016 01 01–2016 06 30			
<b>Už valdymą:</b>		<b>9 883</b>	<b>0,50</b>
<i>nekintamas dydis</i>	1 %	9 883	0,50
<i>sėkmės mokestis</i>		-	-
Depozitoriumui		1 470	0,07
<i>mokestis nuo aktyvų</i>	0,12 %	1 186	0,06
<i>už sandorių sudarymą</i>		284	0,01
Už sandorių sudarymą		447	0,02
Už auditą		1 800	0,09
Kitos veiklos išlaidos		7 991	0,40
<b>Išlaidų, įskaičiuojamų į BIK, suma</b>		<b>21 144</b>	<b>1,06</b>
<b>BIK % nuo vidutinės GAV*</b>		<b>1,06 %</b>	
<b>Visų išlaidų suma</b>	<b>3 %</b>	<b>21 591</b>	<b>1,08</b>
<b>PAR (jei skaičiuojamas)*</b>		-	

\* 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.



Generalinis direktorius  
(valdymo įmonės vadovo pareigų pavadinimas)

(parašas, data)

Ramūnas Baranauskas  
(vardas ir pavardė)

Vyr. finansininkas  
(vyriausiojo buhalterio (buhalterio) arba galinčio tvarkyti apskaitą kito asmens pareigų pavadinimas)

(parašas, data)

Dainius Minelga  
(vardas ir pavardė)

## 19. Esminiai įvykiai.

Nebuvo.

**24. Visas audito išvados tekstas.**

(Informacija pusmečio ataskaitoje neteikiama).

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

I.	Pajamos iš investicinės veiklos	
1.	<i>Palūkanų pajamos</i>	-
2.	<i>Realizuotas pelnas (nuostolis) iš investicijų į:</i>	74 978
2.1.	nuosavybės vertybinius popierius	74 978
2.2.	ne nuosavybės vertybinius popierius	-
2.3.	pinigų rinkos priemonės	-
2.4.	išvestines finansines priemones	-
2.5.	kitų kolektyvinio investavimo subjektų vienetus	-
2.6.	Nekilnojamo turto objektus	-
2.7.	kitas investicines priemones	-
3.	<i>Nerealizuotas pelnas (nuostolis) iš:</i>	148 454
3.1.	nuosavybės vertybinių popierių	148 454
3.2.	ne nuosavybės vertybinių popierių	-
3.3.	pinigų rinkos priemonių	-
3.4.	išvestinių finansinių priemonių	-
3.5.	kitų kolektyvinio investavimo subjektų vienetai	-
3.6.	nekilnojamojo turto objektų	-
3.7.	kitų investicinių priemonių	-
4.	<i>Kitos pajamos:</i>	274
4.1.	nekilnojamojo turto nuomos pajamos	-
4.2.	teigiamas rezultatas iš valiutų kursų skirtumo	-
4.3.	kitos	274
	Pajamų iš viso	223 706
II.	Sąnaudos	
1.	<i>Veiklos sąnaudos:</i>	24 745
1.1.	atskaitymai už valdymą	11 782
1.2.	atskaitymai depozitoriumui	1 495
1.3.	mokėjimai tarpininkams	196
1.4.	išlaidos už auditą	1 829
1.5.	<i>kiti mokėjimai ir išlaidos (išvardyti)</i>	9 443
1.5.1.	VP kotiravimo sąnaudos	304
1.5.2.	Nasdaq OMX licencijos mokestis	1 544
1.5.3.	Apskaitos mokestis	6 897
1.5.4.	Kiti mokesčiai	698
2.	<i>Kitos išlaidos:</i>	89
2.1.	palūkanų išlaidos	-
2.2.	išlaidos, susijusios su valdomais nekilnojamojo turto objektais	-
2.3.	neigiamas rezultatas iš valiutų kursų skirtumo	89
2.4.	kitos	-
	Sąnaudų iš viso	24 834
III.	Grynosios pajamos	198 872
IV.	Išmokos (dividendai) vienetai savininkams	-
V.	Reinvestuotos pajamos	198 872

**26. 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**

**27. 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**

**28. Kolektyvinio investavimo subjekto reikmėms pasiskolintos lėšos ataskaitinio laikotarpio pabaigoje:**

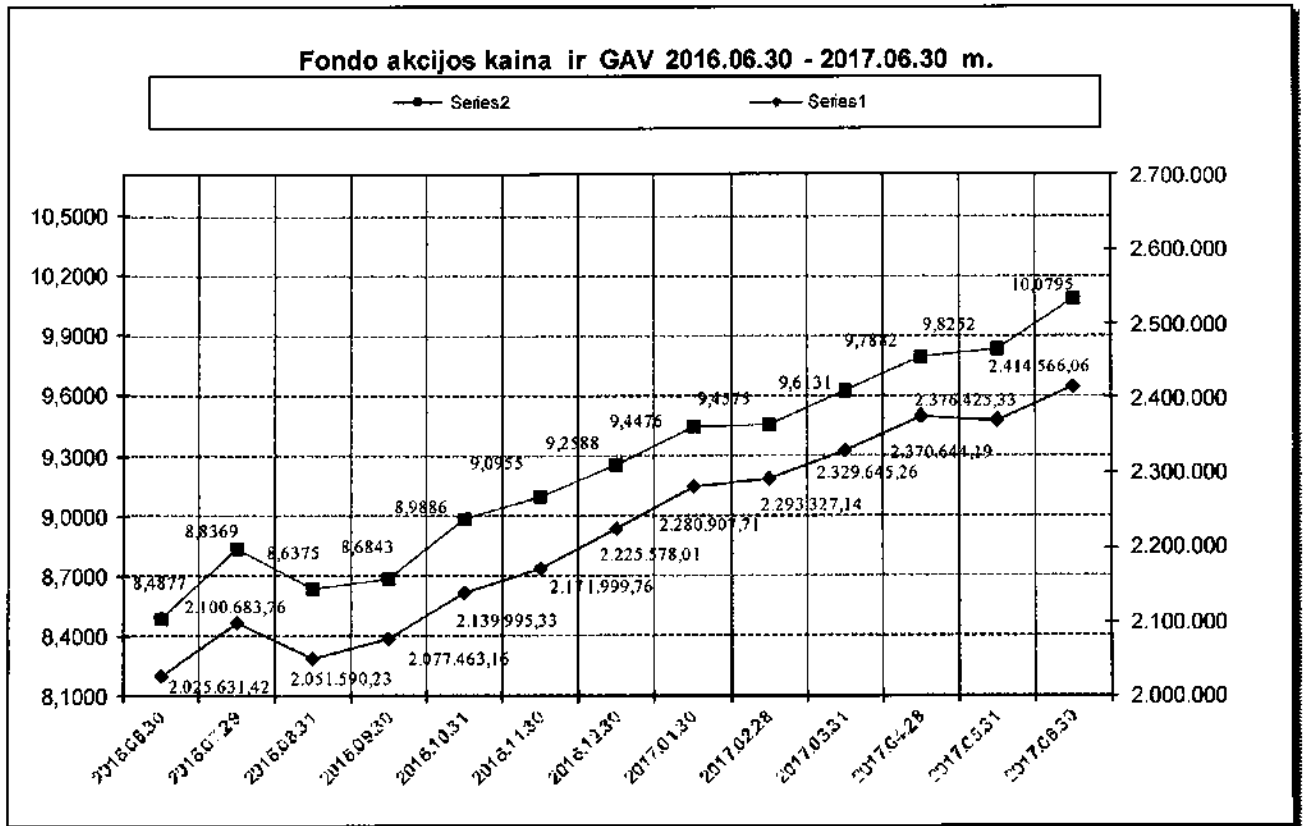
-----

## IX. KITA INFORMACIJA

29. 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:

Fondo akcijos kaina ir fondo aktyvai 2016.06.30. - 2017.06.30. eurai:



## X. ATSAKINGI ASMENYS

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

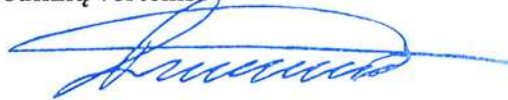
-----

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

UAB 'Orion Asset management' generalinis direktorius Ramūnas Baranauskas.  
UAB 'Orion Asset management' vyr.finansininkas Dainius Minelga.

32. 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 teikiamų rodiklių vertėms.

UAB 'Orion Asset management'  
Generalinis direktorius Ramūnas Baranauskas



UAB 'Orion Asset management'  
Vyr.finansininkas Dainius Minelga



33. Asmenys, atsakingi už ataskaitoje pateiktą informaciją.

33.1 už ataskaitą atsakingi įmonės valdymo organų nariai, darbuotojai ir administracijos vadovas(nurodyti vardus, pavardes, telefonų ir faksų numerius, elektroninio pašto adresus);

UAB 'Orion Asset management' Generalinis direktorius Ramūnas Baranauskas. Tel./fax. 2313833. El. pašto adresas rb@orion.lt.

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

33.2. jeigu ataskaitą rengia konsultantai arba ją rengti padeda konsultantai, nurodyti konsultantų vardus, pavardes, telefonų ir faksų numerius, elektroninio pašto adresus (jeigu konsultantas yra juridinis asmuo, nurodyti jo pavadinimą, telefonų ir faksų numerius, elektroninio pašto adresą bei konsultanto atstovo(-ų) vardą, pavardę); pažymėti, kokias konkrečias dalis rengė konsultantai arba kokios dalys parengtos jiems padedant, bei nurodyti konsultantų atsakomybės ribas.

-----