

INFORMACIJA APIE FONDĄ

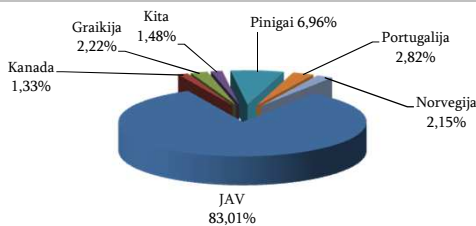
Veiklos pradžia	2015 m. sausio 15 d.
Valiuta	EUR
Fondo valdytojai	Gediminas Būda
ISIN	LTIF00000567
Bloomberg	
Minimali investicija (EUR)	3 000

GRĄŽA (EUR)*

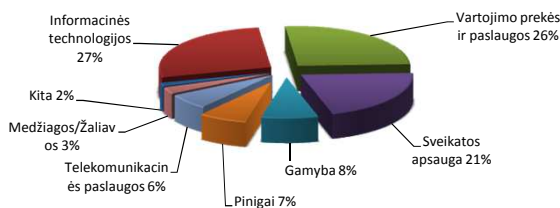
Grynųjų aktyvų vertė (GAV) **	483 318€
Vieneto vertė (NAV) **	93,77€
Pokytis per 3 mėn.	2,03%
Pokytis nuo metų pradžios	Nėra duomenų
Pokytis nuo įkūrimo	-6,23%

* Investicijų istorinis pajamingumas neparantuojama panašaus pajamingumo ateityje
** 2015.12.31 dienai

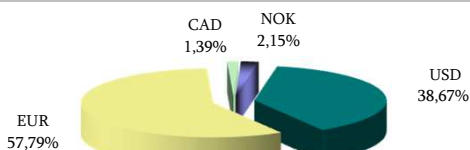
GEOGRAFINIS PASISKIRSTYMAS



SEKTORIŲ PASISKIRSTYMAS

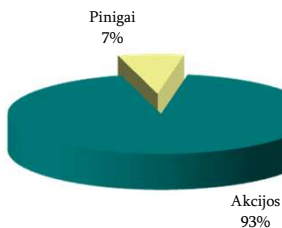


VALIUTŲ PASISKIRSTYMAS*

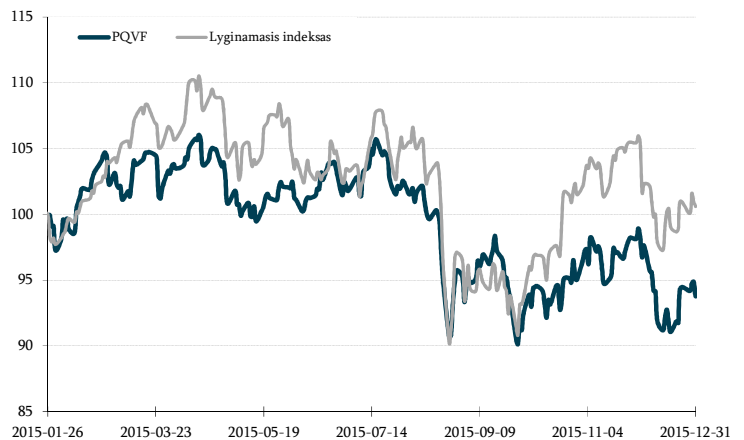


*Duomenys pateikti atsižvelgus į valiutų draudimo sandorių įtaką fondo valiutų krepšeliui

KLASIŲ PASISKIRSTYMAS



VERČIŲ POKYČIAI NUO ĮKŪRIMO (EUR)



FONDO VEIKLOS APŽVALGA

Paskutinį 2015m. ketvirtį fondo vieneto vertė pakilo 2,03%, tačiau pirmus savo gyvavimo metus Prudentis Quantitative Value Fund fondas baigė būdamas neigiamoje teritorijoje (-6,23%). Dar prasčiau fondo metų grąža atrodo palyginus su lyginamuoju indeksu, kuris per tą patį laikotarpį sugebėjo pakilti nors ir mažus, bet visgi teigiamus 0,61proc.

Vienareikšmiškai atsakyti, kodėl fondo grąža atsiliko nuo lyginamojo indekso, nėra paprasta. Dalį skirtumo sudarė draudimo nuo užsienio valiutos (tiksliau JAV dolerio) vertės kritimo rizikos kaštai (2,35%). Kita neigiamos grąžos dalis tenka pozicijų atrankai.

Informacinių technologijų ir telekomunikacinių paslaugų sektorių įmonės bendrai davė teigiamą grąžą, o štai vartojimo prekių ir paslaugų bei gamybos sektoriai labiausiai prisidėjo prie fondo neigiamo metų rezultato. Sveikatos apsaugos sektorius, kuris metų pradžioje pagal daugumą rodiklių buvo brangiausias tarp atrinktų į fondą įmonių, po labai permainingų metų baigė praktiškai nepakitęs.

Žvelgiant į individualių įmonių rezultatus, tai net 23 įmonių iš 33 arba 70proc. fondo pozicijų pardavimai per 2015m. kilo, 90proc. visų įmonių buvo pelningos per paskutinius 12 mėnesių. Gaila, kad šie geri įmonių rezultatai neatspindėjo šių įmonių akcijų kainose.

Individualių portfelio pozicijų, kurių šiuo metu portfelyje yra 32, skaičius per ketvirtąjį ketvirtį nepakitė.

Pateikiame statistinius fondo ir lyginamojo indekso duomenis, panaudojant mėnesio pabaigos fondo vieneto ir lyginamojo indekso verčių pokyčių duomenis:

	PQVF	Lyginamasis indeksas
Dispersija (Volatility)	12,32%	17,44%
Beta	0,64	
Alpha	-5,76%	
R2	0,81	
Koreliacija	90,13%	

TOP 5 POZICIJOS

Adamas Pharmaceuticals Inc.	JAV
Weight Watchers Intl Inc.	JAV
King Digital Entertainment PLC	JAV
Take-Two Interactive Softw.Inc	JAV
Starz A	JAV