



ABLV

Atvērtais ieguldījumu fonds
ABLV European Corporate EUR Bond Fund

neauditētais pārskats par periodu

no 2021. gada 1. janvāra līdz 2021. gada 30. jūnijam

Saturs

| | |
|--|----|
| Informācija par ieguldījumu fondu | 3 |
| Ieguldījumu pārvaldes sabiedrības ziņojums | 5 |
| Finanšu pārskati: | |
| Aktīvu un saistību pārskats | 7 |
| Ienākumu un izdevumu pārskats | 8 |
| Neto aktīvu kustības pārskats | 9 |
| Pielikumi | 10 |

Informācija par ieguldījumu fondu

| | |
|---|---|
| Fonda nosaukums | ABLV European Corporate EUR Bond Fund |
| Fonda veids: | Atvērtais ieguldījumu fonds |
| Fonda tips: | Obligāciju fonds |
| Fonda reģistrācijas datums: | 16.05.2013. |
| Fonda reģistrācijas numurs: | FL129-02.01.02.263/108 |
| Ieguldījumu pārvaldes sabiedrības nosaukums: | ABLV Asset Management, IPAS |
| Ieguldījumu pārvaldes sabiedrības juridiskā adrese: | Elizabetes iela 23, Rīga, LV-1010, Latvija |
| Ieguldījumu pārvaldes sabiedrības reģistrācijas numurs: | 40003814724 |
| Licences numurs ieguldījumu pārvaldes sabiedrības darbībai: | 06.03.07.263/458 |
| Licence izsniegta: | 04.08.2006., pārreģistrēta 03.06.2011. un 09.05.2017. |

Fonda līdzekļu turētājbanka līdz ieguldījuma fonda aktīvu pārvešanai uz jaunu turētājbanku

| | |
|--|--|
| Fonda līdzekļu turētājbankas nosaukums: | Likvidējamā ABLV Bank, AS |
| Fonda līdzekļu turētājbankas juridiskā adrese: | Skanstes iela 7, k-1, Rīga, LV-1013, Latvija |
| Fonda līdzekļu turētājbankas reģistrācijas numurs: | 50003149401 |

Fonda līdzekļu turētājbanka pēc ieguldījuma fonda aktīvu pārvešanas līdz 02.02.2021.

| | |
|--|--|
| Fonda līdzekļu turētājbankas nosaukums: | Baltic International Bank SE |
| Fonda līdzekļu turētājbankas juridiskā adrese: | Kalēju iela 43, Rīga, LV-1050, Latvija |
| Fonda līdzekļu turētājbankas reģistrācijas numurs: | 40003127883 |

Fonda līdzekļu turētājbanka pēc ieguldījuma fonda aktīvu pārvešanas no 03.02.2021.

| | |
|--|--|
| Fonda līdzekļu turētājbankas nosaukums: | Signet Bank AS |
| Fonda līdzekļu turētājbankas juridiskā adrese: | Antonijas iela 3, Rīga, LV-1010, Latvija |
| Fonda līdzekļu turētājbankas reģistrācijas numurs: | 40003076407 |

Ieguldījumu pārvaldes sabiedrības padomes locekļu, valdes locekļu un fonda pārvaldnieka vārds, uzvārds, ieņemamais amats:

Ieguldījumu pārvaldes akciju sabiedrības padome:

Līdz 03.03.2021.:

Padomes priekšsēdētājs – Ernests Bernis
Padomes priekšsēdētāja vietnieks – Edgars Pavlovičs
Padomes loceklis – Aldis Paegle
Padomes loceklis – Jānis Junkers

No 04.03.2021.:

Padomes priekšsēdētājs – Jānis Junkers
Padomes priekšsēdētāja vietnieks – Edgars Pavlovičs
Padomes loceklis – Aldis Paegle
Padomes loceklis – Ernests Bernis (amatu atstāja ar 10.03.2021.)

Ieguldījumu pārvaldes akciju sabiedrības valde:

Valdes priekšsēdētājs – Reinis Vība (ievēlēts atkārtoti ar 15.02.2021.)
Valdes priekšsēdētāja vietnieks - Jevgēnijs Kārklīšs (ievēlēts atkārtoti ar 15.02.2021.)
Valdes loceklis - Jevgenijs Gžibovskis (ievēlēts atkārtoti ar 15.02.2021.)
Valdes loceklis – Sandris Straume (ievēlēts ar 15.02.2021.)

Fonda pārvaldnieks – Sergejs Gačenko

Fonda pārvaldnieka pienākumi:

Fonda pārvaldnieks rīkojas ar fonda mantu saskaņā ar sabiedrības statūtiem un fonda pārvaldes nolikumu. Fonda pārvaldnieks drīkst strādāt tikai vienā ieguldījumu pārvaldes sabiedrībā un pārvaldīt vairākus vienas ieguldījumu pārvaldes sabiedrības pārvaldē esošus fondus.

Ieguldījumu pārvaldes sabiedrības ziņojums

2013. gada 16. maijā tika reģistrēts atvērtais ieguldījumu fonds ABLV European Corporate EUR Bond Fund (turpmāk tekstā – fonds) kā korporatīvo obligāciju fonds ar pamatvalūtu EUR. Minimālā ieguldāmā līdzekļu summa fondā – 1,000 EUR.

Fonda līdzekļu pārvaldītājs ir ABLV Asset Management, IPAS (turpmāk tekstā – Sabiedrība), reģistrēta Latvijas Republikas (turpmāk tekstā – LR) Uzņēmumu reģistrā 2006. gada 4. augustā ar Nr. 40003814724, pārreģistrēta 2011. gada 3. jūnijā un 2017. gada 9. maijā ar licences Nr. 06.03.07.263/458 ieguldījumu pārvaldes sabiedrības darbībai, un juridisko adresi Rīgā, Elizabetes ielā 23.

Fonda ieguldīšanas mērķis ir panākt kapitāla pieaugumu ilgtermiņā. Mērķa realizācijai līdzekļi tiek ieguldīti Eiropas valstīs reģistrētu komercsabiedrību vai kredītiestāžu emitētos vai garantētos parāda vērtspapīros. Fonda ieguldījumu portfelis ir diversificēts starp ieguldījumiem dažādu emitentu parāda vērtspapīros, kas nodarbojas dažādās valstīs un ekonomikas nozarēs, tādējādi nodrošinot lielāku ieguldījumu drošību un aizsardzību pret fonda aktīvu vērtības svārstībām un saistību neizpildes risku. Pārskata periodā fonda pārvaldnieks neveica izmaiņas fonda ieguldījumu politikā un saglabāja esošu ieguldījumu struktūru.

Apraksts par aktīvu pārvaldīšanu un tirgus tendencēm

Pārskata perioda beigās fonda līdzekļi bija ieguldīti parāda vērtspapīros saskaņā ar ieguldījumu politiku. Naudas līdzekļi veidoja 24.77% no fonda aktīviem. Pārskata perioda beigās 4.71% no fonda aktīviem veidoja Likvidējamai ABLV Bank, AS pieteiktie kreditoru prasījumi, kas izriet no subordinētajām obligācijām. Plānots, ka šie naudas līdzekļi tiks izmaksāti fondam Likvidējamās ABLV Bank, AS vispārējos likvidācijas noteikumos noteiktajā kārtībā.

Pārskata perioda beigās fonda ieguldījumu portfeļa vidējais svērtais termiņš līdz dzēšanai bija 2.97 gadi, vidējais svērtais reitings bija BB, un ienesīgums līdz dzēšanai bija 2.33%.

Vispārējās tirgus situācijas dēļ pārskata periodā fonda apliecības vērtība pieauga no 11.825 EUR līdz 12.140 EUR, uzrādot pozitīvu ienesīgumu fonda pamatvalūtā 2.67% apmērā.

Pārskata periodā fonda neto aktīvi pieauga no 9,618,597 EUR līdz 9,875,004 EUR, savukārt, fonda kopējie aktīvi pieauga no 9,629,046 EUR līdz 9,884,196 EUR. Fonda aktīvu pieaugumu noteica fonda vērtības pozitīvais ienesīgums.

No fonda aktīviem pārskata periodā tika segta atlīdzība ieguldījumu pārvaldes sabiedrībai par fonda līdzekļu pārvaldīšanu - 48,489 EUR apmērā un citi izdevumi – 8,352 EUR apmērā. Fonda pastāvīgo maksu rādītājs pārskata periodā bija 1.19% no fonda vidējo neto aktīvu vērtības.

2021. gada pirmajā pusgadā akciju un preču tirgos turpinājās cenu kāpums. Pozitīvo noskaņojumu investoru vidū veicināja ASV Federālās Rezervju Sistēmas un Eiropas Centrālā Bankas veiktie ekonomikas stimulēšanas pasākumi, makroekonomisko datu pasaules lielākajās ekonomikās uzlabošanās un spēcīgie kompāniju finanšu rezultāti.

Pārskata periodā investori koncentrējās uz ziņām, kas saistītas ar inflācijas pieaugumu, jauniem virzieniem ASV Federālās Rezervju Sistēmas retorikā un vakcinācijas tempiem pasaules lielākajās ekonomikās. Kopumā, veiktie ekonomikas stimulēšanas pasākumi, vakcinācijas veikšana un ieviestie ierobežojumu pakāpeniska samazināšana vai atcelšana daudzās valstīs iedvesmo un dod cerību uz ātrāku pasaules ekonomikas atveseļošanu.

Pasaules obligāciju tirgū situācija bija sarežģīta. Ekonomikas ātrās atgūšanās gaidīšana veicināja prognozes par inflācijas pieaugumu, kam sekoja ASV Federālās Rezervju Sistēmas pārstāvju paziņojumi, ka viņi seko inflācijas tempa izmaiņām un ir gatavi atbilstoši reaģēt. Tāda ASV regulatora reakcija nozīmēja, ka ekonomikas stimulēšanas pasākumu apjoms var samazināties ātrāk, nekā bija plānots, tajā skaitā bāzes procentu likmes paaugstinājums. Tas izprovocēja ASV ilgtermiņa valsts obligāciju ienesīguma likmju strauju kāpumu (attiecīgi, obligāciju cenu kritumu). ASV valsts 10-gadīgo obligāciju ienesīguma likme pirmajā ceturksnī pieauga no 0.91% līdz 1.75%, kas negatīvi ietekmēja ASV un citu valstu ilgtermiņa obligāciju cenas, kā arī korporatīvo obligāciju ar investīcijas līmeņa kredītreitingu (Investment Grade) cenas.

Tomēr, otrajā ceturksnī finanšu tirgus nomierināja finanšu regulatoru viedokļa izpaušana, ka inflācijas uzkāpumam ir laicīgs raksturs, un to izraisīja zemo cenu 2020. gada pirmajā pusē efekts, kā arī nevienmērīgā dažādu nozaru un reģionu atveseļošanās. Eksperti uzskata, ka ASV ražošanas apjoms uz līmeni, kāds tas bija pirms Covid-19, atgriezīsies 2022. gada vidū. Savukārt, citās valstīs šis process varētu aizņemt vairāk laika, un līdz tas notiks, plašs inflācijas spiediens ir mazticams. Attiecīgi, ASV valsts 10-gadīgo obligāciju ienesīguma likme otrajā ceturksnī samazinājās no 1.75% līdz 1.47%, kam sekoja ilgtermiņa obligāciju ar investīcijas līmeņa kredītreitingu cenu kāpums. Tādējādi, pārskata periodā ilgtermiņa obligāciju ar investīcijas līmeņa kredītreitingu segmentā bija vērojams augsts svārstīgums, kā rezultātā obligāciju tirgus dažādi segmenti uzrādīja dažādu ienesīgumu.

Savukārt, augstā ienesīguma (High Yield) obligāciju cenu dinamika nav tieši atkarīga no ASV obligāciju ienesīguma likmju dinamikas, bet lielā mērā – no ekonomikas attīstības prognozēm. Attiecīgi, pozitīvais noskaņojums pasaules akciju tirgos (pasaules akciju indekss MSCI World pieauga par 12.16%) atbalstīja augstā ienesīguma obligāciju cenu stabilitāti, kā rezultātā Eiropas korporatīvo emitentu obligāciju indekss Markit iBoxx EUR Liquid High Yield Index TRI pārskata periodā pieauga par 2.74%.

Sabiedrība nepārtraukti izvērtē situāciju finanšu tirgos, tomēr, nav paredzams, kā situācija ar Covid-19 varētu attīstīties nākotnē, un līdz ar to, pastāv ekonomikas attīstības nenoteiktība, kas varētu negatīvi ietekmēt fonda aktīvu apjomu un fonda apliecības vērtības ienesīgumu 2021. gadā.

Lai regulāri informētu ieguldītājus par fonda darbību, tīmekļa vietnē www.ablv.com katru mēnesi tiek publicēti fonda darbības rezultāti, kā arī katru ceturksni tiek publicēti fonda pārskats ar tā galvenajiem rādītājiem un ieguldījumu struktūru, un fonda pārvaldnieka komentārs par situāciju finanšu tirgos.

Lai nodrošinātu diversifikāciju un mazinātu riskus, Sabiedrība nepārtraukti pievērš lielu uzmanību risku pārvaldīšanai. Sabiedrība pastāvīgi analizē esošo politisko un ekonomisko situāciju, veic dažādu veidu analīzi par finanšu tirgiem, kā arī seko līdzi pasaules vadošo brokeru un analītisko kompāniju vērtējumiem par dažādiem finanšu tirgiem.

Apraksts par Turētājbankas maiņu un darījumu atjaunošanu ar apliecībām

2018. gada 19. februārī Sabiedrība apturēja tās pārvaldīto ieguldījumu fondu ieguldījumu apliecību emisiju un atpakaļpirkšanu. Lai atjaunotu iespēju ieguldītājiem pirkt un pārdot fondu ieguldījumu apliecības, 2018. gada 22. maijā Sabiedrība noslēdza turētājbankas līgumu ar Baltic International Bank SE, kam bija jāstājas spēkā pilnā apmērā pēc visu ieguldījumu fondu aktīvu pārveduma uz fonda kontiem šajā kredītiestādē. Aktīvu pārvešana pārskata periodā netika pabeigta un turētājbankas līgums nebija stājies spēkā pilnā apmērā. Sekojoši, 2020. gada 13. novembrī Sabiedrība noslēdza jaunu turētājbankas līgumu ar Signet Bank AS un uzsāka aktīvu pārvešanu uz Signet Bank AS.

Ieguldījumu fondu aktīvu pārvešana uz Signet Bank AS vēl nav pabeigta un joprojām pastāv nenoteiktība par ieguldījumu fondu darbības turpināšanu, jo darījumu atjaunošana ar ieguldījumu apliecībām ir iespējama tikai pēc ieguldījumu fondu aktīvu pārvešanas, kas atkarīga no iesaistīto trešo pušu, tajā skaitā starptautisko depozitāriju, prasībām un darbietilpīgiem saskaņošanas procesiem. Vienlaicīgi Sabiedrība savas kompetences ietvaros turpina veikt nepieciešamos pasākumus, lai veicinātu aktīvu pārvešanu un turētājbankas maiņas pabeigšanu.

2021. gada 29. janvārī tika uzsāktas Sabiedrības pārvaldīto ieguldījumu fondu ieguldītāju pārbaudes. Ieguldītāju pārbaudes process tiek veikts regulatora, Finanšu un kapitāla tirgus komisijas, pārraudzībā saskaņā ar izstrādātu ieguldītāju pārbaudes metodoloģiju. Minētos ieguldītāju pārbaudes pasākumus īsteno neatkarīgs ārvalsts pakalpojuma sniedzējs. Ieguldījumu fondu apliecību pārdošanas un atpakaļpirkšanas kārtība pēc ieguldītāju pārbaudes un turētājbankas maiņas ir attiecīgi precizēta ieguldījumu fondu normatīvajos dokumentos.

Reinis Vība
ABLV Asset Management, IPAS
Valdes priekšsēdētājs

Sergejs Gačenko
ABLV Asset Management, IPAS
Fonda pārvaldnieks

Rīgā, 2021. gada 29. jūlijā

Aktīvu un saistību pārskats

| | | | | EUR |
|--|-----------|------------------|------------------|-----|
| Aktīvi | Pielikums | 30.06.2021. | 31.12.2020. | |
| Prasības uz pieprasījumu pret kredītiestādēm | | 2,447,577 | 889,098 | |
| Finanšu aktīvi, kas novērtēti patiesajā vērtībā ar atspoguļojumu peļņas vai zaudējumu aprēķinā | 2 | 6,970,711 | 8,247,471 | |
| Parāda instrumenti | | 6,970,711 | 8,247,471 | |
| Pārējie aktīvi | | 465,908 | 492,477 | |
| Kopā aktīvi | | 9,884,196 | 9,629,046 | |
| Saistības | | | | |
| Uzkrātie izdevumi | | (9,192) | (10,449) | |
| Kopā saistības | | (9,192) | (10,449) | |
| Neto aktīvi | | 9,875,004 | 9,618,597 | |

Reinis Vība
ABLV Asset Management, IPAS
Valdes priekšsēdētājs

Sergejs Gačenko
ABLV Asset Management, IPAS
Fonda pārvaldnieks

Rīgā, 2021. gada 29. jūlijā

ŠIS DOKUMENTS IR ELEKTRONISKI PARAKSTĪTS AR DROŠU ELEKTRONISKO PARAKSTU UN SATUR LAIKA ZĪMOGU

Ienākumu un izdevumu pārskats

| | EUR | |
|---|------------------------------|------------------------------|
| | 01.01.2021. - 30.06.2021. | 01.01.2020. - 30.06.2020. |
| Ienākumi | | |
| Procentu ienākumi | 121,590 | 134,023 |
| Pārējie ienākumi | 1,245 | 250 |
| Kopā | 122,835 | 134,273 |
| Izdevumi | | |
| Atfīdzība ieguldījumu pārvaldes sabiedrībai | (48,489) | (45,877) |
| Pārējie fonda pārvaldes izdevumi | (1,080) | (1,083) |
| Procentu izdevumi | (2,642) | (4,315) |
| Pārējie izdevumi | (4,630) | (3,034) |
| Kopā | (56,841) | (54,309) |
| Ieguldījumu vērtības pieaugums / (samazinājums) | | |
| Realizētais ieguldījumu vērtības pieaugums/ (samazinājums) | (135,901) | 7,123 |
| Nerealizētais ieguldījumu vērtības pieaugums / (samazinājums) | 326,736 | (646,640) |
| Kopā | 190,835 | (639,517) |
| Nodokļi un nodevas | (422) | (1,657) |
| Ieguldījumu rezultātā gūtais neto aktīvu pieaugums/ (samazinājums) | 256,407 | (561,210) |

Reinis Vība
ABLV Asset Management, IPAS
Valdes priekšsēdētājs

Sergejs Gačenko
ABLV Asset Management, IPAS
Fonda pārvaldnieks

Rīgā, 2021. gada 29. jūlijā

ŠIS DOKUMENTS IR ELEKTRONISKI PARAKSTĪTS AR DROŠU ELEKTRONISKO PARAKSTU UN SATUR LAIKA ZĪMOGU

Neto aktīvu kustības pārskats

| | EUR | |
|--|------------------------------|------------------------------|
| Pozīcijas nosaukums | 01.01.2021. - 30.06.2021. | 01.01.2020. - 30.06.2020. |
| Neto aktīvi pārskata perioda sākumā | 9,618,597 | 9,625,562 |
| ieguldījumu rezultātā gūtais neto aktīvu pieaugums/ (samazinājums) | 256,407 | (561,210) |
| Darījumi ar ieguldījumu apliecībām | | |
| ienākumi no ieguldījumu apliecību pārdošanas | - | - |
| ieguldījumu apliecību atpakaļpirkšanas izdevumi | - | - |
| Neto aktīvu pieaugums/ (samazinājums) no darījumiem ar ieguldījumu apliecībām | - | - |
| Neto aktīvu pieaugums/ (samazinājums) pārskata periodā | 256,407 | (561,210) |
| Neto aktīvi pārskata perioda beigās | 9,875,004 | 9,064,352 |
| Emitēto ieguldījumu apliecību skaits pārskata perioda sākumā | 813,397 | 813,397 |
| Emitēto ieguldījumu apliecību skaits pārskata perioda beigās | 813,397 | 813,397 |
| Neto aktīvi uz vienu ieguldījumu apliecību pārskata perioda sākumā | 11.83 | 11.83 |
| Neto aktīvi uz vienu ieguldījumu apliecību pārskata perioda beigās | 12.14 | 11.14 |

Reinis Vība
 ABLV Asset Management, IPAS
 Valdes priekšsēdētājs

Sergejs Gačenko
 ABLV Asset Management, IPAS
 Fonda pārvaldnieks

Rīgā, 2021. gada 29. jūlijā

ŠIS DOKUMENTS IR ELEKTRONISKI PARAKSTĪTS AR DROŠU ELEKTRONISKO PARAKSTU UN SATUR LAIKA ZĪMOGU

Finanšu pārskatu pielikumi

1. Pielikums

Pamatinformācija

Atvērtais ieguldījumu fonds ABLV European Corporate EUR Bond Fund ir obligāciju fonds, kas reģistrēts 2013. gada 16. maijā, tā ieguldījumu pārvaldes sabiedrības ABLV Asset Management, IPAS juridiskā adrese ir Elizabetes iela 23, Rīga, LV-1010, Latvija.

Finanšu pārskati ir sagatavoti saskaņā ar sākotnējās vērtības uzskaites principu, izņemot tos finanšu aktīvus, kas tiek uzskaitīti to patiesajā vērtībā.

Fonda funkcionālā valūta un finanšu pārskatu uzrādīšanas valūta ir EUR. Iekavās norādītā informācija atbilst salīdzinošiem datiem par iepriekšējo pārskata periodu, ja vien nav norādīts citādi.

Ar informāciju par piemērotajām svarīgākajām grāmatvedības metodēm un uzskaites principiem, kā arī riska vadību var iepazīties fonda 2020. gada pārskatā, tīmekļa vietnē <http://www.ablv.com/lv/about/financial-reports/funds>. Salīdzinājumā ar grāmatvedības uzskaites metodēm, kuras tika izmantotas, sagatavojot iepriekšējo periodu finanšu pārskatus, 2021. gada finanšu pārskatu sagatavošanā izmantotās grāmatvedības uzskaites metodes nav mainītas. Kopš 2020. gada 31. decembra nav bijušas būtiskas izmaiņas risku vadībā.

Finanšu pārskatu pielikumos piemēroti šādi saīsinājumi – Eiropas Centrālā Banka (ECB).

2. Pielikums

Finanšu aktīvi, kas novērtēti patiesajā vērtībā ar atspoguļojumu peļņas vai zaudējumu

Visi parāda instrumenti ir klasificēti kā finanšu aktīvi, kas novērtēti patiesajā vērtībā ar atspoguļojumu peļņas vai zaudējumu aprēķinā.

Regulētajos tirgos tirgto parāda instrumentu sadalījums pa emitenta valstīm un emitentiem 2021. gada 30. jūnijā:

| Emitents | ISIN kods | Skaitis | legādes | Uzskaites | Uzskaites |
|------------------------------------|--------------|------------------|------------------|------------------|--|
| | | | vērtība | vērtība | vērtības attiecība pret fonda aktīviem (%) |
| | | | EUR | EUR | |
| Amerikas Savienotās Valstis | | 200,000 | 201,980 | 206,838 | 2.09 |
| KRONOS INTERNATIONAL INC | XS1680281133 | 100,000 | 101,375 | 103,057 | 1.04 |
| OWENS - ILLINOIS GROUP INC | XS1405765907 | 100,000 | 100,605 | 103,781 | 1.05 |
| Beļģija | | 100,000 | 99,850 | 105,384 | 1.07 |
| TELENET GROUP BVBA | BE6300371273 | 100,000 | 99,850 | 105,384 | 1.07 |
| Bulgārija | | 200,000 | 201,000 | 209,599 | 2.12 |
| BULGARIAN ENERGY HOLDING EAD | XS1405778041 | 200,000 | 201,000 | 209,599 | 2.12 |
| Čehija | | 100,000 | 103,000 | 101,300 | 1.02 |
| ENERGO-PRO AS | XS1731657141 | 100,000 | 103,000 | 101,300 | 1.02 |
| Džērsija | | 250,000 | 262,695 | 267,666 | 2.71 |
| GLENCORE FINANCE (EUROPE) LTD | XS1202849086 | 150,000 | 158,475 | 158,040 | 1.60 |
| KENNEDY WILSON EUROPE REAL EST | XS1321149434 | 100,000 | 104,220 | 109,626 | 1.11 |
| Francija | | 1,450,000 | 1,448,790 | 1,450,822 | 14.68 |
| CASINO GUICHARD PERRACHON | FR0012074284 | 200,000 | 217,600 | 202,286 | 2.05 |
| CROWN INTERNATIONAL HOLDINGS | XS1758723883 | 100,000 | 99,970 | 107,481 | 1.09 |
| ELIS SA | FR0013318102 | 100,000 | 99,650 | 107,733 | 1.09 |
| LA FINANCIERE ATALIAN SAS | XS1605600532 | 100,000 | 101,500 | 99,733 | 1.01 |
| LOUVRE BIDCO SAS | XS1685582105 | 100,000 | 100,300 | 101,002 | 1.02 |
| LOXAM SAS | XS1590066624 | 100,000 | 101,000 | 102,838 | 1.04 |
| NEXANS SA | FR0013248713 | 100,000 | 99,670 | 105,756 | 1.07 |
| PARTS EUROPE S.A. | XS1517169972 | 100,000 | 60,210 | 59,399 | 0.60 |
| RCIBANQUE SA | FR0013218153 | 150,000 | 151,890 | 150,714 | 1.52 |
| SCHNEIDER ELECTRIC SE | FR0011561000 | 100,000 | 103,000 | 102,571 | 1.04 |
| TEREOS UCA | FR0013183571 | 200,000 | 205,750 | 202,257 | 2.05 |
| VALEO SA | FR0011689033 | 100,000 | 108,250 | 109,052 | 1.10 |
| Grieķija | | 200,000 | 199,500 | 207,092 | 2.10 |
| TITAN CEMENT CO SA | XS1716212243 | 200,000 | 199,500 | 207,092 | 2.10 |

Tabulas turpinājums:

| Emitents | ISIN kods | Skaitis | legādes | Uzskaites | Uzskaites |
|----------------------------------|--------------|----------------|------------------|------------------|--|
| | | | vērtība | vērtība | vērtības attiecība pret fonda aktīviem (%) |
| Igaunija | | 100,000 | 100,000 | 104,067 | 1.05 |
| ADMIRAL MARKETS AS | EE3300111251 | 100,000 | 100,000 | 104,067 | 1.05 |
| Indija | | 100,000 | 104,000 | 108,531 | 1.10 |
| NTPC LTD | XS1551677260 | 100,000 | 104,000 | 108,531 | 1.10 |
| Islande | | 150,000 | 150,900 | 150,794 | 1.53 |
| LANDSBANKINN HF | XS2121467497 | 150,000 | 150,900 | 150,794 | 1.53 |
| Itālija | | 600,000 | 596,322 | 620,011 | 6.27 |
| INTER MEDIA COMMUNICATION SRL | XS1739592142 | 100,000 | 95,068 | 96,539 | 0.98 |
| PRO-GEST SPA | XS1733958927 | 100,000 | 100,250 | 95,660 | 0.97 |
| SAIPEM SPA | XS1591523755 | 100,000 | 100,000 | 102,269 | 1.03 |
| SAIPEM SPA | XS1711584430 | 100,000 | 100,000 | 105,008 | 1.06 |
| TELECOM ITALIA SPA | XS1698218523 | 100,000 | 100,468 | 105,721 | 1.07 |
| UNIPOL GRUPPO SPA | XS1725580622 | 100,000 | 100,536 | 114,814 | 1.16 |
| Īrija | | 300,000 | 309,535 | 323,697 | 3.27 |
| ADIENT PLC | XS1468662801 | 100,000 | 101,095 | 104,097 | 1.05 |
| SMURFIT KAPPA CORP LTD | XS1117298759 | 200,000 | 208,440 | 219,600 | 2.22 |
| Krievija | | 300,000 | 299,000 | 316,816 | 3.21 |
| GAZPROM PJSC | XS1721463500 | 200,000 | 200,000 | 210,387 | 2.13 |
| VNESHECONOMBANK | XS0893212398 | 100,000 | 99,000 | 106,429 | 1.08 |
| Latvija | | 200,000 | 200,000 | 200,842 | 2.03 |
| CITADELE BANKA, AS | LV0000802221 | 200,000 | 200,000 | 200,842 | 2.03 |
| Lielbritānija | | 600,000 | 602,740 | 402,506 | 4.08 |
| INEOS HOLDINGS LTD | XS1577947440 | 200,000 | 200,040 | 200,569 | 2.03 |
| JAGUAR LAND ROVER AUTOMOTIVE PLC | XS1551347393 | 200,000 | 201,100 | 201,417 | 2.04 |
| THOMAS COOK GROUP PLC | XS1531306717 | 100,000 | 101,000 | 20 | 0.00 |
| THOMAS COOK GROUP PLC | XS1733231663 | 100,000 | 100,600 | 500 | 0.01 |
| Lietuva | | 100,000 | 105,550 | 106,042 | 1.07 |
| MAXIMA GROUP UAB | XS1878323499 | 100,000 | 105,550 | 106,042 | 1.07 |
| Luksemburga | | 81,000 | 85,649 | 83,739 | 0.85 |
| LSF9 BALTA ISSUER SA | XS2312156115 | 81,000 | 85,649 | 83,739 | 0.85 |
| Meksika | | 100,000 | 100,900 | 102,386 | 1.04 |
| NEMAK SAB DE CV | XS1533916299 | 100,000 | 100,900 | 102,386 | 1.04 |
| Nīderlande | | 100,000 | 97,750 | 102,114 | 1.03 |
| SAMVARDHANA MOTHERSON AUTOMOTI | XS1635870923 | 100,000 | 97,750 | 102,114 | 1.03 |
| Norvēģija | | 100,000 | 102,500 | 103,832 | 1.05 |
| NASSA TOPCO AS | XS1589980330 | 100,000 | 102,500 | 103,832 | 1.05 |
| Polija | | 200,000 | 202,160 | 203,202 | 2.06 |
| PKO BANK POLSKI | XS1650147660 | 100,000 | 100,500 | 100,702 | 1.02 |
| POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN S | XS1082660744 | 100,000 | 101,660 | 102,500 | 1.04 |
| Somija | | 100,000 | 101,125 | 115,210 | 1.17 |
| METSA BOARD OYJ | FX4000282629 | 100,000 | 101,125 | 115,210 | 1.17 |
| Spānija | | 300,000 | 312,830 | 317,626 | 3.22 |
| CELLNEX TELECOM SAU | XS1551726810 | 200,000 | 211,090 | 217,196 | 2.20 |
| TENDAM BRANDS S.A.U | XS1681770464 | 100,000 | 101,740 | 100,430 | 1.02 |
| Šveice | | 100,000 | 100,490 | 99,956 | 1.01 |
| DUFY AG | XS1699848914 | 100,000 | 100,490 | 99,956 | 1.01 |
| Turcija | | 100,000 | 102,400 | 103,542 | 1.05 |
| ARCELIK AS | XS1109959467 | 100,000 | 102,400 | 103,542 | 1.05 |
| Vācija | | 600,000 | 599,930 | 393,326 | 3.98 |
| ADLER PELZER HOLDING GMBH | XS1533914591 | 100,000 | 100,500 | 98,697 | 1.00 |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG | DE000A1Z6M12 | 100,000 | 101,000 | 101,221 | 1.02 |
| DEUTSCHE TELEKOM AG | XS1557095459 | 100,000 | 100,400 | 100,499 | 1.02 |
| SENVION MIDCO GMBH | XS1608040090 | 200,000 | 197,540 | 1,010 | 0.01 |
| TAKKO FASHION SARL | XS1710653137 | 100,000 | 100,490 | 91,899 | 0.93 |
| Zviedrija | | 400,000 | 403,576 | 415,146 | 4.20 |
| INTRUM AB | XS1634532748 | 200,000 | 203,355 | 203,662 | 2.06 |
| VOLVO CAR AB | XS1724626699 | 200,000 | 200,221 | 211,484 | 2.14 |
| Kopā | | | 7,194,172 | 6,922,086 | 70.06 |

Pārējie parāda instrumenti:

| Emitents | ISIN kods | Skaitis | legādes | Uzskaites | Uzskaites |
|---|--------------|----------------|------------------|------------------|----------------|
| | | | vērtība | vērtība | vērtības |
| | | | EUR | EUR | attiecība pret |
| | | | | | fonda aktīviem |
| | | | | | (%) |
| Nīderlande | | 100,000 | 100,615 | 48,625 | 0.49 |
| SELECTA GROUP B.V. | XS2250522476 | 100,000 | 100,615 | 48,625 | 0.49 |
| Kopā | | | 100,615 | 48,625 | 0.49 |
| Kopā regulētajos tirgos tirgotie un pārējie parāda instrumenti | | | 7,294,787 | 6,970,711 | 70.52 |

3. Pielikums

Darbības rādītāju dinamika

| Pozīcijas nosaukums | 30.06.2021. | 31.12.2020. | 31.12.2019. |
|--|---------------|---------------|--------------|
| Neto aktīvi (EUR) | 9,875,004 | 9,618,597 | 9,625,562 |
| Ieguldījumu apliecību skaits | 813,397 | 813,397 | 813,397 |
| Ieguldījumu fonda daļas vērtība (EUR) | 12.14 | 11.83 | 11.83 |
| | 01.01.2021. - | 01.01.2020.- | 01.01.2019.- |
| | 30.06.2021. | 31.12.2020. | 31.12.2019. |
| Ieguldījumu fonda ienesīgums* (EUR) | 5.45% | -0.07% | 4.20% |

* - ienesīgums aprēķināts kā fonda daļas vērtības pārskata perioda beigās attiecība pret tās vērtību pārskata perioda sākumā. Šī attiecība ir izteikta gada procentos, kāpinot pakāpē, kur dalāmais ir 365, bet dalītājs – dienu skaits pārskata periodā.

4. Pielikums

Darbības turpināšana un aktīvu atsavināšanas ierobežojumi

2018. gada 19. februārī Sabiedrība apturēja tās pārvaldīto ieguldījumu fondu ieguldījumu apliecību emisiju un atpakaļpirkšanu. Lai atjaunotu iespēju ieguldītājiem pirkt un pārdot fondu ieguldījumu apliecības, 2018. gada 22. maijā Sabiedrība noslēdza turētājbankas līgumu ar Baltic International Bank SE, kam bija jāstājas spēkā pilnā apmērā pēc visu ieguldījumu fondu aktīvu pārveduma uz fonda kontiem šajā kredītiestādē. Aktīvu pārvešana pārskata periodā netika pabeigta un turētājbankas līgums nebija stājies spēkā pilnā apmērā. Sekojoši, 2020. gada 13. novembrī Sabiedrība noslēdza jaunu turētājbankas līgumu ar Signet Bank AS un uzsāka aktīvu pārvešanu uz Signet Bank AS.

Ieguldījumu fondu aktīvu pārvešana uz Signet Bank AS vēl nav pabeigta un joprojām pastāv nenoteiktība par ieguldījumu fondu darbības turpināšanu, jo darījumu atjaunošana ar ieguldījumu apliecībām ir iespējama tikai pēc ieguldījumu fondu aktīvu pārvešanas, kas atkarīga no iesaistīto trešo pušu, tajā skaitā starptautisko depozitāriju, prasībām un darbietilpīgiem saskaņošanas procesiem. Vienlaicīgi Sabiedrība savas kompetences ietvaros turpina veikt nepieciešamos pasākumus, lai veicinātu aktīvu pārvešanu un turētājbankas maiņas pabeigšanu. Pārskata periodā Sabiedrība panāca būtisku progresu aktīvu pārvešanā uz Signet Bank AS.

Pārskata periodā pastāvēja ierobežojumi atsavināt fonda aktīvus, kuri tiek turēti Euroclear Bank S.A. kontos, kā arī ierobežojumi rīkoties ar pārējos aktīvos atzītiem naudas līdzekļiem 465,908 (452,350) EUR apmērā, kas ir kreditoru prasījumi pret Likvidējamo ABLV Bank, AS, kas izriet no subordinētajām obligācijām.

5. Pielikums

Notikumi pēc bilances datuma

Laika periodā no pārskata perioda beigām līdz pārskata apstiprināšanas dienai nav bijuši nekādi notikumi, kuru rezultātā šajā fonda finanšu pārskatā būtu jāveic korekcijas vai kuri būtu jāpaskaidro šajā fonda finanšu pārskatā.