

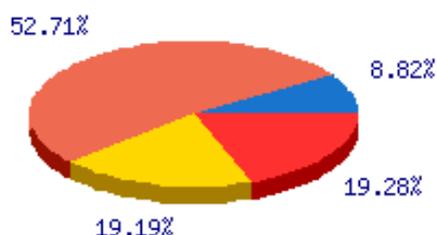
Початок діяльності – 10 травня 2005 р.

Динаміка	Фонд	Композиційний індекс
Доходність за III квартал 2018 року	3,11%	4,36%
Доходність за 2017 рік	15,73%	40,19%
Середньорічна доходність	10,03%	9,76%
Показники ризику*		
Стандартне відхилення	2,05%	86,54%
Коефіцієнт Шарпа**	від'ємн.	1,68
Коефіцієнт Сортіно**	5,28	0,94
Альфа	-0,55%	
Бета	0,04	
Коефіцієнт кореляції	0,20	

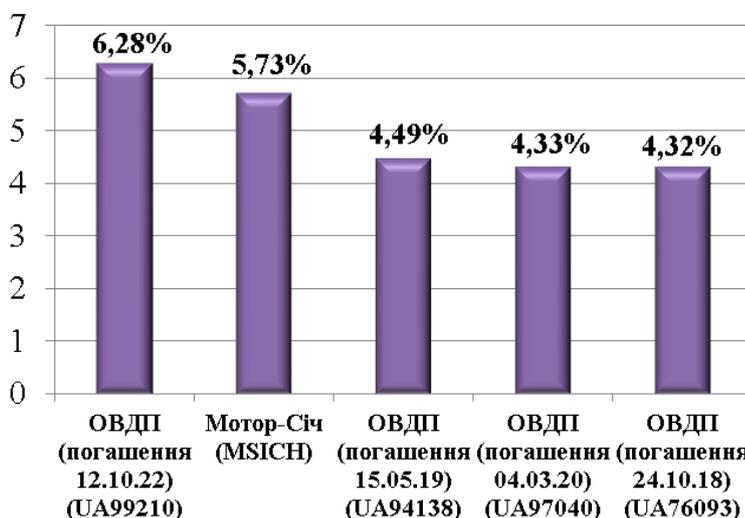
Динаміка ВЧА/акцію у порівнянні з еталоном



Вкладення за класами активів



Найбільші позиції портфеля



За звітний період доходність фонду «Соціальний стандарт» склала 3,11%. При цьому середньорічна доходність за третій квартал зросла на 6 б.п. і на кінець вересня склала 10,04%. До порівняння, композиційний індекс (пенсійний) протягом звітного кварталу зріс на 4,34%.

Вартість одиниці пенсійних активів на кінець звітного періоду склала 3,60 грн.

На кінець звітного кварталу вартість чистих активів фонду склала 39 310 367,11 грн., збільшившись за квартал на 1 256 142,83 грн., або на 3,30%. За той же час до фонду надійшло пенсійних внесків на суму 393 095,15 грн., пенсійних виплат було здійснено на суму 319 670,43 грн. Таким чином, чистий грошовий потік склав: 73 424,72 грн.

Протягом кварталу керуючий здійснив наступні дії з портфелем фонду:

1) 12 липня були придбані 64 ОВДП (15.05.2019) з доходністю 17,35% на суму 66 552,32 гривень за рахунок платежу від ОВДП (10.07.2019).

2) 24 липня керуючий придбав 591 ОВДП (15.05.2019) з доходністю 17,70% на суму 616 401,18 гривень за рахунок платежу від ОВДП (22.07.2019).

3) 26 липня керуючий придбав 70 000 акцій Райффайзен банку Аваль на суму 21 000,00 гривень за рахунок дивідендів, що були отримані від цього ж емітенту.

4) 27 липня були додатково придбані ще 70 000 акцій Райффайзен банку Аваль на суму 20 860,00 гривень.

5) 7 серпня в очікуванні значної девальвації гривні керуючий придбав 5 доларових ОВДП (15.01.2020) з доходністю 5,15% на суму 136 887,10 гривень.

6) 8 серпня були придбані 200 акцій Укрнафти на суму 21 900,00 гривень.

7) 16 серпня керуючий додатково придбав 9 доларових ОВДП (15.01.2020) з доходністю 5,15% на суму 252 894,15 гривень за рахунок платежів від ОВДП (14.08.2019) та (11.08.2021), а також 1 394 корпоративні облігації ТОВ «Руш» серії Є з доходністю 19,50% на суму 1 393 289,06 гривень. Крім того, в цей же день були придбані 80 000 акцій Райффайзен банку Аваль на суму 24 032,00 гривень.

8) 6 вересня керуючий придбав 82 ОВДП (09.01.2019) з доходністю 18,60% на суму 82 856,90 гривень. В цей же день на інформації про можливу найближчим часом приватизацію були придбані 3 500 акцій Центренерго на загальну суму 51 000,00 гривень.

9) 7 вересня керуючий придбав 132 ОВДП (02.01.2019) з доходністю 18,25% на суму 134 369,40 гривень за рахунок платежу від ОВДП (04.03.2020).

Протягом кварталу до фонду надійшло:

- платежів за облігаціями внутрішньої державної позики загальним обсягом 1 860 777,75 грн.
- відсотків за депозитами обсягом 339 777,49 грн.

З повагою,
керуючий інвестиційними і пенсійними фондами
КУА «КІНТО»

Птіцин Віталій Юрійович

ЗМІНА ВАРТОСТІ ОДИНИЦІ ПЕНСІЙНИХ ВНЕСКІВ

** Показники ризику для фонду та індексу розраховуються за величинами вартості одиниці пенсійних внесків та значеннями композиційного індексу за останні 12 місяців діяльності пенсійного фонду.

*** Розрахунки коефіцієнтів Шарпа та Сортіно здійснюються відповідно до методики, рекомендованої у статті У. Шарпа «The Sharpe Ratio» (<http://www.stanford.edu/~wfs Sharpe/art/sr/sr.htm>). Безризикова доходність для визначення коефіцієнта Шарпа, розрахована на основі доходностей ОВДП на ринку, складає 17.79%. Мінімальний рівень доходності для розрахунків коефіцієнта Сортіно приймається на рівні 0,0%.

Обчислення показників альфи, бети та кореляції здійснюється на основі щомісячних даних; всіх інших показників – на основі щоденних даних за останній рік діяльності фонду.

Стратегія	Назва фонду	Вартість чистих активів, грн.	Вартість одиниці пенсійних внесків, грн.	З початку діяльності	1 місяць	3 місяці	6 місяців	1 рік	2 роки	3 роки	Середньорічна доходність
Збалансована	«Соціальний стандарт»	39 310 367.11	3.60	260.2%	0.5%	3.1%	5.7%	12.1%	27.8%	43.3%	10.0%

(дані на кінець III кварталу 2018 року)

Приватне акціонерне товариство «КІНТО» здійснює професійну діяльність на ринку цінних паперів – діяльність з управління активами інститутів спільного інвестування та пенсійних фондів.