



Початок діяльності – 05 вересня 2006 р.

Динаміка	Фонд	Композиційний Індекс ринку
Доходність за II квартал 2020 року	0,03%	-2,56%
Доходність за 2019 рік	9,43%	-3,44%
Середньорічна доходність	2,08%	5,91%
Показники ризику**		
Стандартне відхилення	2,21%	9,56%
Коефіцієнт Шарпа***	від'ємн.	від'ємн.
Коефіцієнт Сортіно***	від'ємн.	від'ємн.
Альфа	-0,72%	
Бета	0,17	
Коефіцієнт кореляції	0,77	

** - Показники ризику та співвідношення доходностей до ризиків для фондів та індексів розраховуються за величинами вартості чистих активів у розрахунку на цінний папір та значеннями відповідних індексів за останні 12 місяців діяльності фонду.

*** - Розрахунки коефіцієнтів Шарпа та Сортіно здійснюються відповідно до методики, рекомендованої у статті У. Шарпа «The Sharpe Ratio» (<http://www.stanford.edu/~wfsSharpe/art/sr/sr.htm>). Безризикова доходність для визначення коефіцієнта Шарпа, розрахована на основі доходностей ОВДП на ринку, складає 13,1%. Мінімальний рівень доходності для розрахунків коефіцієнта Сортіно приймається на рівні 20,0%.

Вкладення за класами активів



Інтервальний диверсифікований пайовий інвестиційний фонд "КІНТО-Народний"

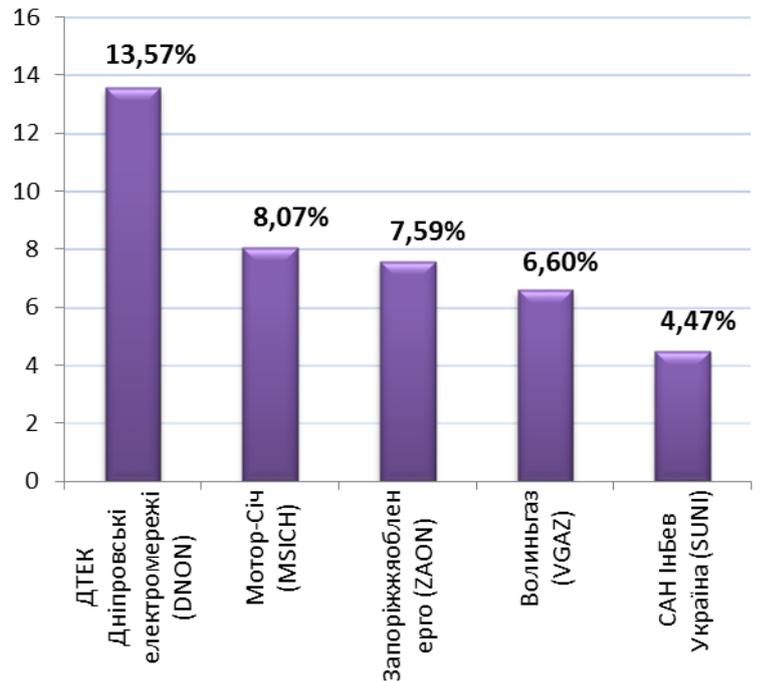
Динаміка ВЧА/інвестиційний сертифікат у порівнянні з бенчмарком



* - композиційний індекс ринку (інвестиційний) розраховується на основі таких ваг: з 1 липня 2004 р. до 31 грудня 2009 р.: індекс ПФТС - 40%; індекс KINBOND - 60%; з 1 січня 2010 р. до 31 грудня 2010 р.: індекс ПФТС - 50%; індекс KINBOND - 50%; з 1 січня 2011 р.: індекс ПФТС - 25%; індекс УБ - 25%; індекс KINBOND - 50%; з 1 січня 2016 р.: індекс УБ - 50%; індекс KINBOND - 50%;

- для зручності порівняння за умову одиницю прийняті, відповідно, значення ВЧА/інвестиційний сертифікат Фонду на початок діяльності (100 грн.) та значення композиційного індексу ринку на цю ж дату (6 вересня 2006 р.), що дорівнювало 245,202.

Найбільші позиції портфеля



Доходність фонду «КІНТО-Народний» за другий квартал 2020 року склала 0,03%, за той же час бенчмарк – композиційний індекс (інвестиційний) впав на 2,56%. Середньорічна доходність фонду на кінець другого кварталу склала 2,08%, зменшившись за звітний період на 3 б.п.

За звітний період фонд викупив 75 сертифікатів на суму 99 483,72 гривень. Розміщень сертифікатів не відбувалось.

Як наслідок, чисті активи фонду на кінець кварталу зменшились на 97 971,35 грн. і склали 6 080 500,04 грн.

Протягом звітного періоду керуючий здійснив наступні дії:

- 1) 26 травня були придбані 136 ОВДП (20.01.2021) з доходністю 13,27% на суму 147 203,68 гривень за рахунок коштів, що були отримані після завершення депозиту.
- 2) 2 червня керуючий купив 81 ОВДП (30.09.2020) з доходністю 10,97% на суму 85 026,51 гривень за рахунок коштів, що були отримані після завершення депозиту.
- 3) 11 червня були придбані 72 ОВДП (11.05.2022) з доходністю 10,25% на суму 81 604,80 гривень за рахунок коштів, отриманих після погашення ОВГЗ (10.06.2020).

Протягом кварталу до фонду надійшло:

- платежів за облігаціями внутрішньої державної позики загальним обсягом 111 069,45 грн.
- відсотків за депозитами обсягом 40 697,07 грн.