

ДОСТАТОК

Інтервальний диверсифікований пайовий інвестиційний фонд «Достаток»

Початок діяльності – 11 вересня 2003 р.

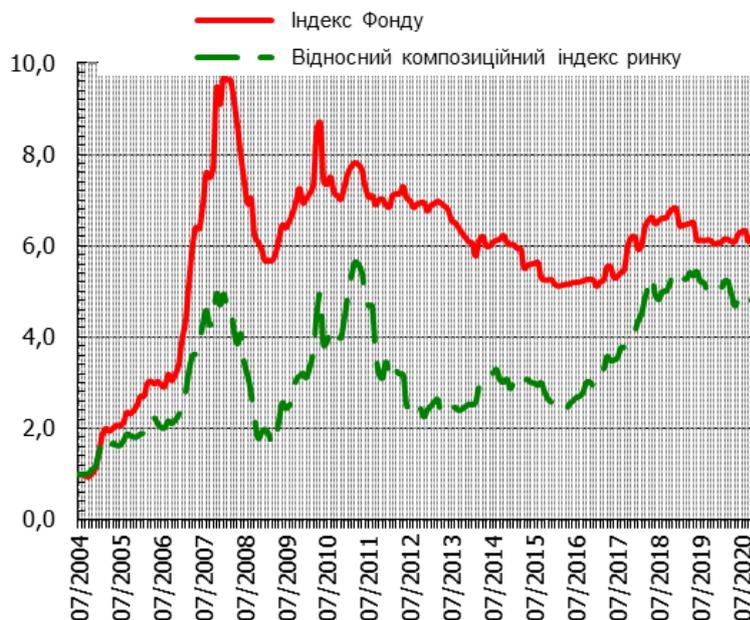
Динаміка	Фонд	Композиційний індекс ринку
Доходність за 3 квартал 2020 року*	-1,4%	3,6%
Доходність за 2019 рік	-5,7%	-3,8%
Середньорічна доходність (з 1 липня 2004 року)	11,9%	10,2%
Показники ризику**		
Стандартне відхилення	5,6%	14,5%
Коефіцієнт Шарпа***	0,002	від'ємн.
Коефіцієнт Сортіно***	від'ємн.	від'ємн.
Альфа	-0,2%	
Бета	-0,1	
Коефіцієнт кореляції	-0,3	

* - 3 жовтня 2012 року результати надаються на 10 число кожного місяця, тому звітний період охопив період, що не співпадає з 3 кварталом – з 10 липня по 10 жовтня 2020 року

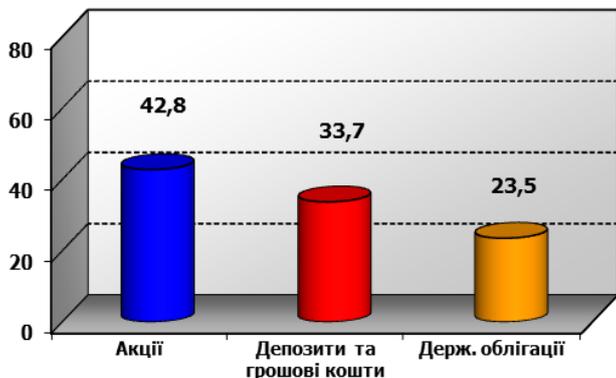
** - Показники ризику та співвідношення доходностей до ризиків для фондів та індексів розраховуються за величинами щоденної вартості чистих активів у розрахунку на цінний папір та значеннями відповідних індексів за останні 12 місяців діяльності фонду.

*** - Розрахунки коефіцієнтів Шарпа та Сортіно здійснюються відповідно до методики, рекомендованої у статті У. Шарпа «The Sharpe Ratio» (<http://www.stanford.edu/~wfscharpe/art/sr/sr.htm>). Безризикова доходність для визначення коефіцієнта Шарпа, розрахована на основі доходностей ОВДП на ринку, складає 8,4%. Мінімальний рівень доходності для розрахунків коефіцієнта Сортіно приймається на рівні 10,0%.

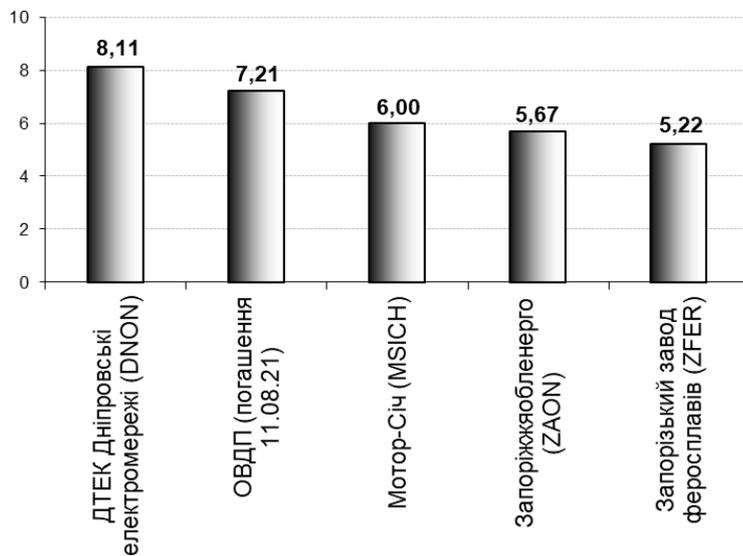
Динаміка ВЧА/інвестиційний сертифікат у порівнянні з бенчмарком



Вкладення за класами активів, %



Найбільші позиції портфеля, %



Інформація про загальну ситуацію на фондових ринках надана у [«Звіті про діяльність ІФ «КІНТО-Еквіті» за 3 квартал 2020 року»](#), що розповсюджується паралельно з цим.

Що стосується ІФ «Достаток», то з 10 липня по 10 жовтня 2020 року показники фонду знизились на 1,4%: вартість інвестиційного сертифіката змінилася з 7,57 грн до 7,46 грн, а загальна вартість чистих активів зменшилася на 199,3 тис. грн і склала 13,69 млн гривень. Результат виявився трохи гіршим у порівнянні з бенчмарком – відносним композиційним індексом ринку, який виріс на 3,6%.

Складовими зміни вартості чистих активів фонду були: вартісна переоцінка портфеля (-512,3 тис. грн), купонні виплати за облігаціями (+191,7 тис. грн), нараховані відсотки за депозитами (+74,4 тис. грн), отримані дивіденди по акціях «Кривбасвибухпрому» (+74,4 тис. грн), а також поточні витрати на фінансування діяльності фонду (-27,4 тис. гривень).

Від'ємна переоцінка портфеля фонду склалася в результаті негативних змін вартості субпортфеля акцій (-395,2 тис. грн) та субпортфеля облігацій (-117,1 тис. гривень). Щодо акцій, то збільшився в оцінці лише один емітент – «Райффайзен Банк Аваль» (+39,6 тис. грн), а знецінилися акції трьох емітентів: «ДТЕК Дніпровські електромережі» (-319,1 тис. грн), «Центренерго» (-93,5 тис. грн) та «Укрнафти» (-22,3 тис. гривень). Решта позицій портфеля не змінили своєї оціночної вартості.

Щодо цінних паперів з фіксованим доходом, то мінус був обумовлений тим фактом, що випуски облігацій, по яким купонний дохід продовжував накопичуватися у балансовій вартості, не змогли перекрити зниження курсової вартості тих випусків, по яким у звітному періоді було здійснено поточне перерахування купонних платежів власникам.

З портфеля фонду вибули погашені ОВДП (19 серпня 2020 р) на суму 159,0 тис. грн, та ОВДП (30 вересня 2020 р) на суму 500,0 тис. гривень. Отримані кошти ІФ «Достаток» інвестував, придбавши ОВДП (погашення 11 травня 2022 р) на суму 670,0 тис. грн та ОВДП (погашення 26 лютого 2025 р) на суму 398,4 тис. гривень.