

ДОСТАТОК

Інтервальний диверсифікований пайовий інвестиційний фонд «Достаток»

Початок діяльності – 11 вересня 2003 р.

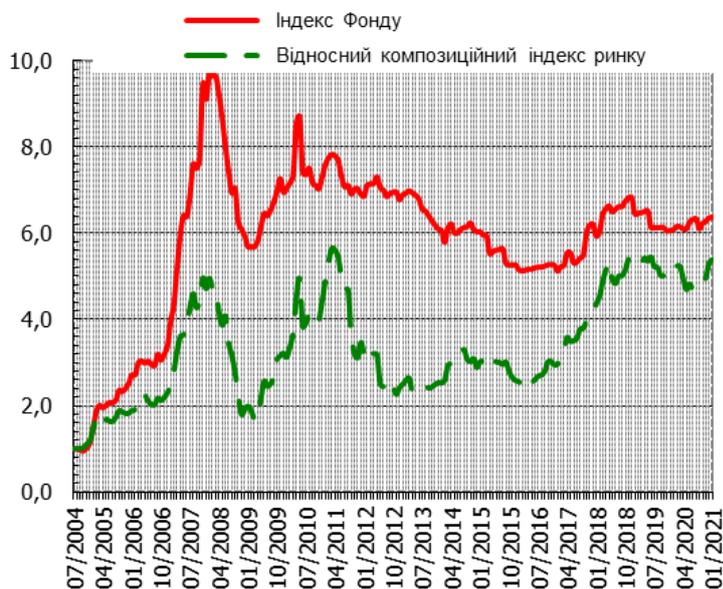
Динаміка	Фонд	Композиційний індекс ринку
Доходність за 4 квартал 2020 року*	2,3%	11,2%
Доходність за 2020 рік	4,7%	6,2%
Середньорічна доходність (з 1 липня 2004 року)	11,8%	10,7%
Показники ризику**		
Стандартне відхилення	5,3%	11,8%
Коефіцієнт Шарпа***	від'ємн.	від'ємн.
Коефіцієнт Сортіно***	від'ємн.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

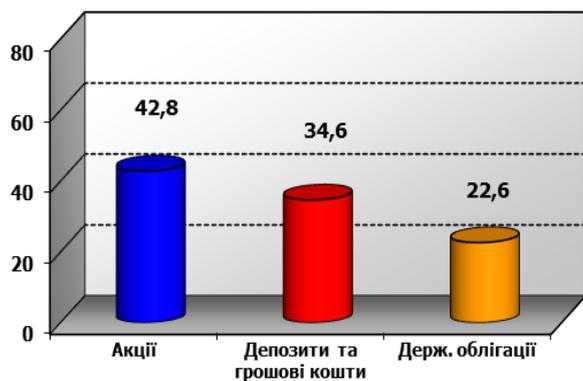
** - Показники ризику та співвідношення доходностей до ризиків для фондів та індексів розраховуються за величинами щоденної вартості чистих активів у розрахунку на цінний папір та значеннями відповідних індексів за останні 12 місяців діяльності фонду.

*** - 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 10,2%. Мінімальний рівень доходності для розрахунків коефіцієнта Сортіно приймається на рівні 10,0%.

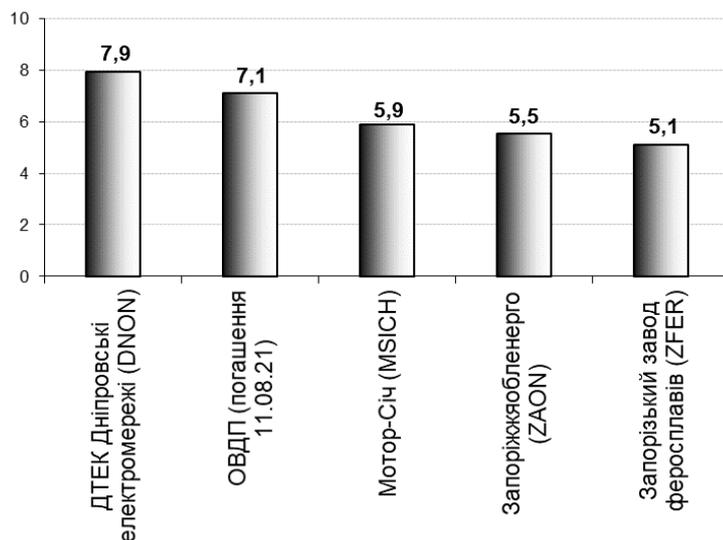
Динаміка ВЧА/інвестиційний сертифікат у порівнянні з еталоном



Вкладення за класами активів, %



Найбільші позиції портфеля, %



Інформація про загальну ситуацію на фондових ринках надана у [«Звіті про діяльність ІФ «КІНТО-Еквіті» за 4 квартал 2020 року»](#), що розповсюджується паралельно з цим.

Що стосується ІФ «Достаток», то з 10 жовтня 2020 року по 10 січня 2021 року показники фонду зросли на 2,3%: вартість інвестиційного сертифіката змінилася з 7,46 грн до 7,63 грн, а загальна вартість чистих активів зросла на 314,6 тис. грн і склала 14,0 млн гривень. Результат виявився гіршим у порівнянні з бенчмарком – відносним композиційним індексом ринку, який виріс на 11,2%.

Складовими зміни вартості чистих активів фонду були: вартісна переоцінка портфеля (+163,8 тис. грн), купонні виплати за облігаціями (+89,3 тис. грн), нараховані відсотки за депозитами (+58,6 тис. грн), отримані дивіденди по акціях «Райффайзен Банку Аваль» (+27,1 тис. грн), а також поточні витрати на фінансування діяльності фонду (-24,1 тис. гривень).

Переоцінка портфеля фонду склалася в результаті позитивної зміни вартості субпортфеля акцій (+216,5 тис. грн) та від'ємного результату по субпортфелю облігацій (-52,7 тис. гривень). Щодо акцій, то збільшились в оцінці два емітенти – «Центренерго» (+146,1 тис. грн) та «Укрнафта» (+136,8 тис. грн), а знецінилися акції «Кривбасвибхпрому» (-66,4 тис. гривень). Решта 15 позицій портфеля не змінили своєї оціночної вартості.

Щодо цінних паперів з фіксованим доходом, то мінус був обумовленим 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.

Активні операції у звітному періоді фонд не проводив.