



Початок діяльності – 05 вересня 2006 р.

Динаміка	Фонд	Композиційний Індекс ринку
Доходність за II квартал 2021 року	-7,50%	1,93%
Доходність за 2020 рік	0,97%	5,83%
Середньорічна доходність	1,73%	7,39%
Показники ризику**		
Стандартне відхилення	9,63%	14,73%
Коефіцієнт Шарпа***	від'ємн.	1,28
Коефіцієнт Сортино***	від'ємн.	1,11
Альфа	-2,02%	
Бета	0,68	
Коефіцієнт кореляції	0,73	

** - 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.

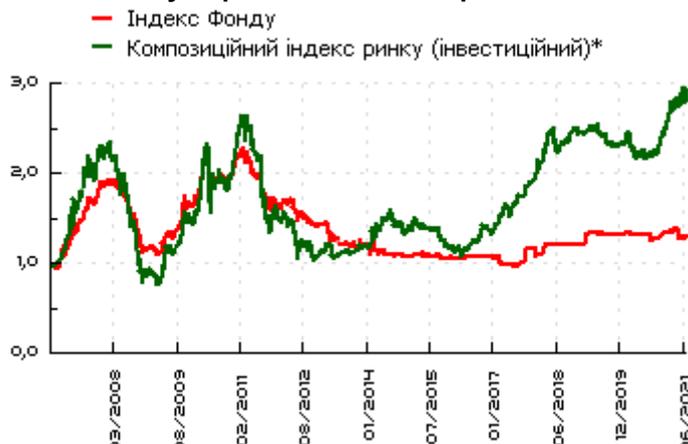
*** - Розрахунки коефіцієнтів Шарпа та Сортино здійснюються відповідно до методики, рекомендованої у статті У. Шарпа «The Sharpe Ratio» (<http://www.stanford.edu/~wfsSharpe/art/sr/sr.htm>). Безризикова доходність для визначення коефіцієнта Шарпа, розрахована на основі доходностей ОВДП на ринку, складає **10,5%**. Мінімальний рівень доходності для розрахунків коефіцієнта Сортино приймається на рівні **10,0%**. Обчислення показників альфи, бети та кореляції здійснюється на основі щомісячних даних; всіх інших показників – на основі щоденних даних за останній рік діяльності фонду.

Вкладення за класами активів



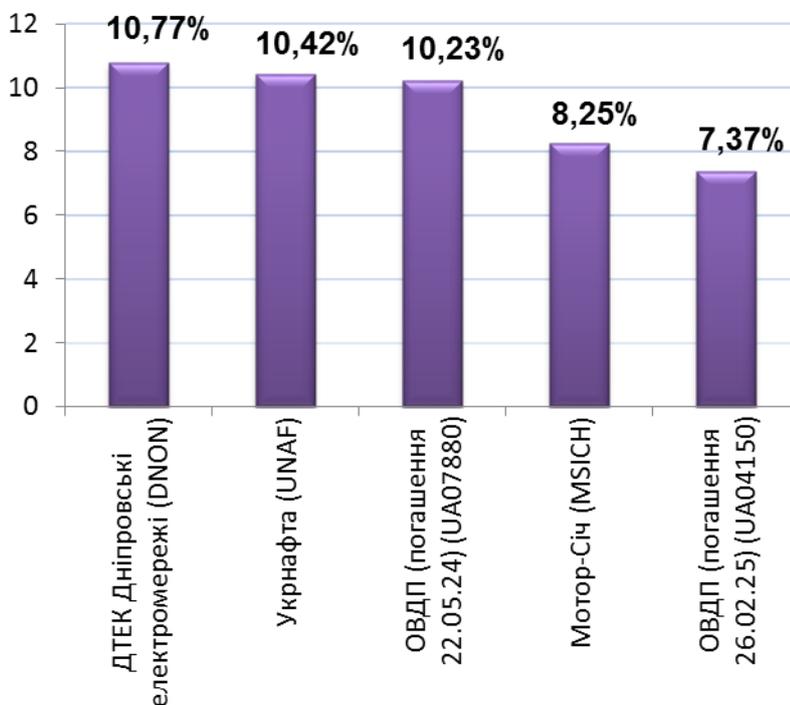
Інтервальний диверсифікований пайовий інвестиційний фонд "КІНТО-Народний"

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 умовну 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 2021 року склала -7,50%, за той же час бенчмарк – композиційний індекс (інвестиційний) зріс на 1,91%. Середньорічна доходність фонду на кінець другого кварталу склала 1,73%, зменшившись за звітний період на 58 б.п.

За звітний період фонд викупив 5 сертифікатів на суму 6 565,10 гривень. Розміщень сертифікатів не відбувалось.

Як наслідок, чисті активи фонду на кінець кварталу зменшились на 482 899,30 грн. і склали 5 869 315,28 грн.

Протягом звітного періоду керуючий здійснив наступні дії:

- 1) 30 квітня у зв'язку з заборною обертання акцій Запоріжжяобленерго та виведенням їх з біржового списку акції цього емітенту в портфелі фонду були переоцінені до нульової вартості.
- 2) 20 травня керуючий придбав 61 облігацію ТОВ «Руш» серії G з доходністю до повернення 12,50% на суму 63 866,39 гривень.
- 3) 7 червня були придбані 173 облігації «ЕСКА Капітал» (серія B) з доходністю 16,50% на суму 179 426,95 гривень за рахунок коштів, отриманих після закриття депозиту.

Протягом кварталу до фонду надійшло:

- платежів за облігаціями внутрішньої державної позики загальним обсягом 54 163,85 грн.
- платежів за корпоративними облігаціями загальним обсягом 4 393,82 грн.
- відсотків за депозитами обсягом 20 549,27 грн.