

Початок діяльності – 10 травня 2005 р.

Динаміка	Фонд	Композиційний індекс (пенсійний)
Доходність за 2 квартал 2021 року	0,51%	1,98%
Доходність за 2020 рік	11,22%	6,87%
Середньорічна доходність	9,75%	9,44%
Показники ризику**		
Стандартне відхилення	3,59%	12,27%
Коефіцієнт Шарпа***	0,48	1,31
Коефіцієнт Сортіно***	від'ємн.	1,08
Альфа	-0,39%	
Бета	0,18	
Коефіцієнт кореляції	0,69	

** - 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.

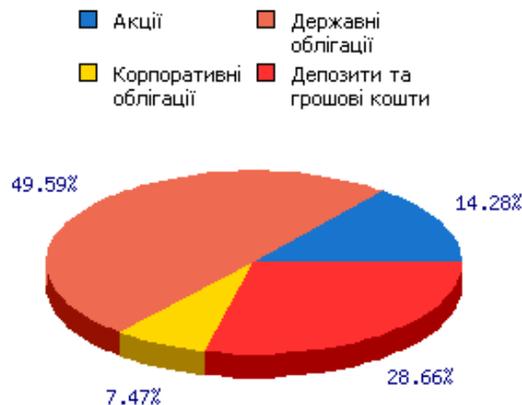
*** - Розрахунки коефіцієнтів Шарпа та Сортіно здійснюються відповідно до методики, рекомендованої у статті У. Шарпа «The Sharpe Ratio» (<http://www.stanford.edu/~wsharp/art/sr/sr.htm>). Безризикова доходність для визначення коефіцієнта Шарпа, розрахована на основі доходностей ОВДП на ринку, складає **10,5%**. Мінімальний рівень доходності для розрахунків коефіцієнта Сортіно 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.

Динаміка зміни вартості одиниці пенсійних активів і композиційного індексу ринку (в відносних одиницях)

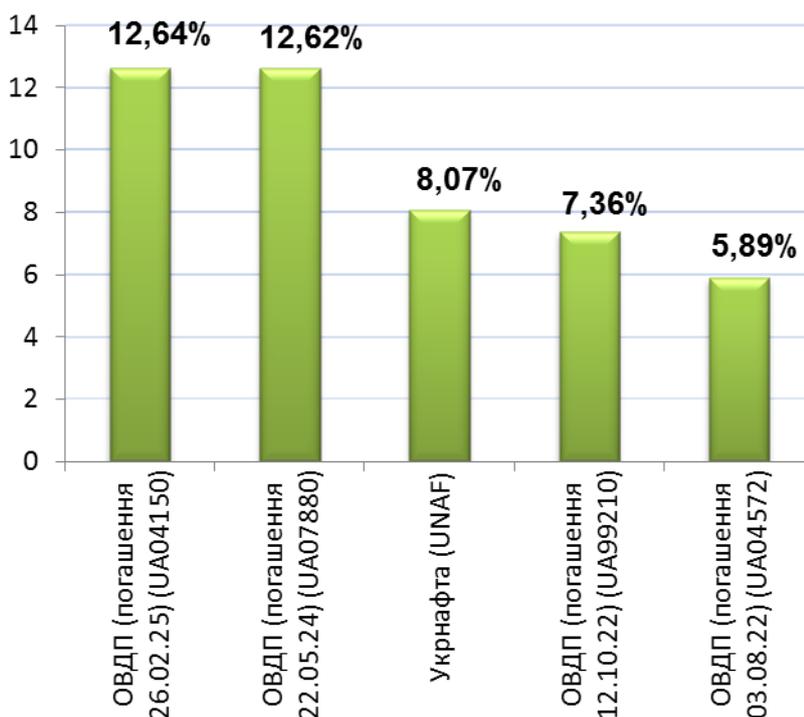


* - композиційний індекс ринку (пенсійний) розраховується на основі таких ваг: індекс акцій УБ - 40%; індекс облігацій KINBOND - 60%.

Вкладення за класами активів



Найбільші позиції портфеля



За звітний квартал 2021 року доходність фонду «Соціальний Стандарт» склала 0,51%. До порівняння, композиційний індекс (пенсійний) протягом звітного кварталу зріс на 1,97%.

- Вартість одиниці пенсійних активів на кінець другого кварталу склала 4,49 грн. На малюнку представлено динаміку зміни вартості одиниці пенсійних активів ВПФ «Соціальний стандарт» та композиційного індексу ринку (у відносних одиницях) з початку діяльності фонду.

На кінець звітного кварталу вартість чистих активів фонду склала 52 856 008,56 грн., збільшившись за квартал на 1 882 708,97 грн., або на 3,69%. За той же час до фонду надійшло пенсійних внесків на суму 1 973 831,01 грн., пенсійних виплат було здійснено на суму 348 295,29 грн. Таким чином, чистий грошовий потік склав: 1 625 535,72 грн.

Протягом кварталу керуючий здійснив наступні дії з портфелем фонду:

- 2) 15 квітня були придбані 513 ОВДП (19.04.2023) з доходністю 12,35% на суму 588 523,86 гривень, за рахунок купонів, отриманих від ОВДП (12.10.2022).
- 3) 20 травня за рахунок пенсійних внесків були придбані 560 облігацій ТОВ «Руш» серії G з доходністю до повернення 12,50% на суму 586 314,40 гривень.
- 4) 27 травня керуючий купив 324 ОВДП (23.08.2023) з доходністю 12,10% на суму 321 327,00 гривень, реінвестувавши купони, отримані від ОВДП (22.05.2024).
- 5) 4 червня були придбані 82 ОВДП (23.08.2023) з доходністю 12,10% на суму 81 527,68 гривень.
- 6) 7 червня керуючий придбав 2 324 корпоративних облігацій «ЕСКА Капітал» (серія В) з доходністю 16,50% на суму 2 410 336,60 гривень за рахунок коштів, отриманих після закриття депозиту.
- 7) 14 червня за рахунок пенсійних внесків були додатково придбані 252 облігації «ЕСКА Капітал» (серія В) з доходністю 16,50% на суму 262 127,88 гривень, 224 ОВДП (13.05.2026) з доходністю 12,45% на суму 229 774,72 гривень, а також 70 ОВДП (26.05.2027) з доходністю 12,40% на суму 63 749,00 гривень.
- 8) 16 червня керуючий купив 187 ОВДП (13.05.2026) з доходністю 12,45% на суму 191 944,28 гривень за рахунок коштів, отриманих після закриття депозиту.

Протягом кварталу до фонду надійшло:

- платежів за облігаціями внутрішньої державної позики загальним обсягом 664 392,75 грн.
- платежів за корпоративними облігаціями загальним обсягом 87 295,25 грн. відсотків за депозитами обсягом 313 941,47 грн.

ЗМІНА ВАРТОСТІ ОДИНИЦІ ПЕНСІЙНИХ ВНЕСКІВ

Стратегія	Назва фонду	Вартість чистих активів, грн.	Вартість одиниці пенсійних внесків, грн.	3 початку діяльності	1 місяць	3 місяці	6 місяців	1 рік	2 роки	3 роки	Середньорічна доходність
Збалансована	«Соціальний стандарт»	52 856 008,56	4,49	349,5%	-1,0%	0,5%	3,5%	9,2%	17,7%	28,6%	9,8%

(дані на кінець II кварталу 2021 року)