

Початок діяльності – 10 травня 2005 р.

| Динаміка | Фонд | Композиційний індекс (пенсійний) |
|-----------------------------------|----------|----------------------------------|
| Доходність за 3 квартал 2021 року | 1,21% | -1,53% |
| Доходність за 2020 рік | 11,22% | 6,87% |
| Середньорічна доходність | 9,67% | 9,18% |
| Показники ризику** | | |
| Стандартне відхилення | 3,82% | 11,69% |
| Коефіцієнт Шарпа*** | 0,03 | 1,18 |
| Коефіцієнт Сортіно*** | від'ємн. | 1,06 |
| Альфа | -0,47% | |
| Бета | 0,18 | |
| Коефіцієнт кореляції | 0,72 | |

** - 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/~wfsarpe/art/sr/sr.htm>). Безризикова доходність для визначення коефіцієнта Шарпа, розрахована на основі доходностей ОВДП на ринку, складає 11,1%. 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)

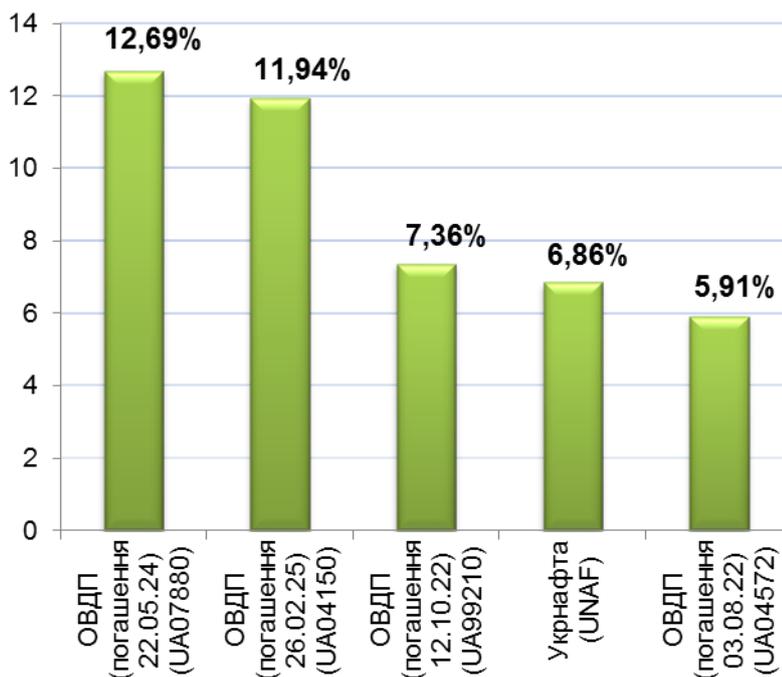


* - композиційний індекс ринку (пенсійний) розраховується на основі таких ваг: індекс акцій УБ - 40%; індекс облігацій KINBOND - 60%.

Вкладення за класами активів



Найбільші позиції портфеля



За III квартал 2021 року доходність фонду «Соціальний Стандарт» склала 1,21%. До порівняння, композиційний індекс (пенсійний) протягом звітного кварталу зменшився на 1,51%. Вартість одиниці пенсійних активів на кінець третього кварталу склала 4,55 грн.

На кінець звітного кварталу вартість чистих активів фонду склала 54 809 709,30 грн., збільшившись за квартал на 1 953 700,74 грн., або на 3,70%. За той же час до фонду надійшло пенсійних внесків на суму 1 679 213,84 грн., пенсійних виплат було здійснено на суму 370 278,57 грн. Таким чином, чистий грошовий потік склав: 1 308 935,27 грн.

Протягом кварталу керуючий здійснив наступні дії з портфелем фонду:

- 1) 8 липня були придбані 54 ОВДП (26.02.2025) з доходністю 12,40% на суму 62 940,24 гривень за рахунок дивідендів, отриманих за акціями Райффайзен банку Аваль.
- 2) 13 липня за рахунок пенсійних внесків були придбані 226 ОВДП (03.08.2022) з доходністю 11,40% на суму 252 921,12 гривень.
- 3) 21 липня також за рахунок пенсійних внесків керуючий купив 4,66 унцій золота за ціною 49 459,65 грн/унція.
- 4) 5 серпня були придбані 433 облігацій ТОВ «Руш» серії G з доходністю до повернення 12,20% на суму 452 069,32 гривень частково за рахунок купонів, отриманих від ОВДП (03.08.2022), та частков за рахунок коштів, отриманих після закриття депозиту.
- 5) 12 серпня за рахунок пенсійних внесків, а також коштів, отриманих при погашенні ОВДП (11.08.2021) керуючий придбав 1518 ОВДП (13.05.2026) з доходністю 13,00% на суму 1 559 137,80 гривень, а також 315 ОВДП (19.04.2023) з доходністю 12,50% на суму 348 591,60 гривень.
- 6) 13 серпня були придбані 20,87 унцій золота за ціною 47 915,67 грн/унція за рахунок коштів, отриманих при погашенні ОВДП (11.08.2021). Керуючий прийняв рішення про купівлю золота через його значне зниження на світових ринках.
- 7) 19 серпня керуючий купив 243 ОВДП (13.05.2026) з доходністю 13,00% на суму 250 170,93 гривень за рахунок коштів, отриманих після закриття депозиту. Ця транзакція була обумовлена низькими депозитними ставками.
- 8) 26 серпня були придбані 436 ОВДП (13.05.2026) з доходністю 13,00% на суму 449 921,48 гривень за рахунок: (а) коштів, отриманих після закриття депозитів; (б) купонів, отриманих від ОВДП (23.08.2023); (в) купонів, отриманих від облігацій Укрпошти (серія В).
- 9) 27 серпня керуючий придбав 94 ОВДП (26.05.2027) з доходністю 12,85% на суму 86 151,00 гривень частково за рахунок пенсійних внесків, частков за рахунок купонів, отриманих по облігаціям ТОВ «Руш» серії G.

Протягом кварталу до фонду надійшло:

- платежів за облігаціями внутрішньої державної позики загальним обсягом 3 272 085,90 грн.
- платежів за корпоративними облігаціями обсягом 173 302,22 грн.
- дивідендів за акціями Райффайзен банку Аваль – 61 106,40 грн. та акціями Центренерго – 2 143,77 грн.
- відсотків за депозитами обсягом 278 520,07 грн.

ЗМІНА ВАРТІСТІ 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» | 54 809 709,30 | 4,55 | 354,9% | 0,5% | 1,2% | 1,7% | 8,0% | 18,8% | 26,4% | 9,7% |

(дані на кінець III кварталу 2021 року)