



## Класичний

Початок діяльності – 01 липня 2004 р.

Динаміка	Фонд	Композиційний Індекс ринку
Доходність за III квартал 2021 року	0,93%	-2,21%
Доходність за 2020 рік	8,27%	5,83%
Середньорічна доходність	12,12%	10,98%
<b>Показники ризику**</b>		
Стандартне відхилення	8,78%	13,92%
Коефіцієнт Шарпа***	0,45	1,18
Коефіцієнт Сортино***	0,38	1,11
Альфа	-0,46%	
Бета	0,47	
Коефіцієнт кореляції	0,68	

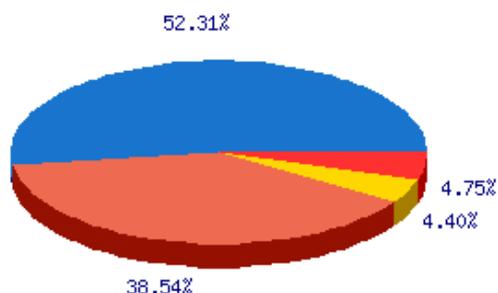
\*\* - Показники ризику та співвідношення доходностей до ризиків для фондів та індексів розраховуються за величинами вартості чистих активів у розрахунку на цінний папір та значеннями відповідних індексів за останні 12 місяців діяльності фонду.

\*\*\* - Розрахунки коефіцієнтів Шарпа та Сортино здійснюються відповідно до методики, рекомендованої у статті У. Шарпа «The Sharpe Ratio» (<http://www.stanford.edu/~wfsnarpe/art/sr/sr.htm>). Безризикова доходність для визначення коефіцієнта Шарпа, розрахована на основі доходностей ОВДП на ринку, складає 11,1%. Мінімальний рівень доходності для розрахунку 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

- Акції
- Державні облигації
- Корпоративні облигації
- Депозити та грошові кошти



### Відкритий диверсифікований пайовий інвестиційний фонд "КІНТО-Класичний"

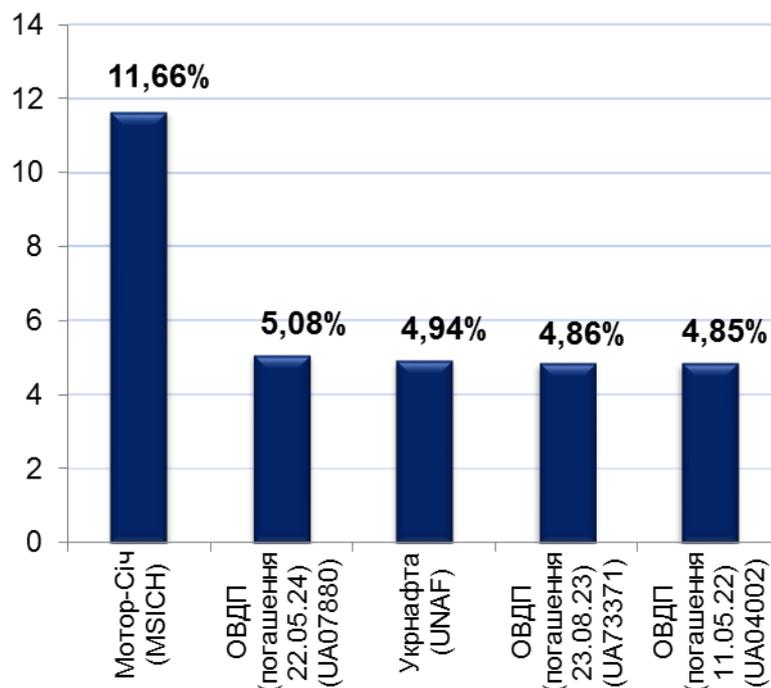
#### Динаміка ВЧА/інвестиційний сертифікат у порівнянні з бенчмарком



\* - 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 (1 липня 2004 р.), що дорівнювало 114,264.

### Найбільші позиції портфеля



Інформація про загальну ситуацію на фондових ринках надана у [Звіті про діяльність ІФ «КІНТО-Еквіті» за третій квартал 2021 року](#), що розповсюджується паралельно з цим.

Протягом звітного періоду в ІФ «КІНТО-Класичний» вартість чистих активів в розрахунку на один сертифікат зросла на 0,9%: з 713,64 грн до 720,27 гривень. Загальна ВЧА збільшилась на 0,8%, або на 252,8 тис. грн: з 32,47 млн грн до 32,73 млн гривень. Чистий відтік коштів з активів фонду при пред'явленні інвесторами до викупу інвестиційних сертифікатів ІФ «КІНТО-Класичний» склав 48,2 тис. грн: фонд продав 2 своїх цінних папери на суму 1,4 тис. грн, а викупив 70 штук на суму 49,6 тис. гривень, що зменшило загальну вартість чистих активів фонду.

Позитивні накопичення принесли ІФ «КІНТО-Класичний» купонні виплати за облігаціями (+357,5 тис. грн), одержані дивіденди на акції «Центренерго», «Райффайзен Банку» за 2020 рік та «Харківобленерго» за 2018 рік (+125,2 тис. грн), чистий дохід від ф'ючерсних контрактів на курс долар США-українська гривня (+20,0 тис. грн) та нараховані відсотки за депозитами (+6,3 тис. гривень). Додала і переоцінка вартості портфеля – +80,1 тис. гривень. Складові останньої: субпортфель акцій збільшився на 65,5 тис. грн, а субпортфель облігацій – на 14,6 тис. гривень. Поточні витрати ІФ «КІНТО-Класичний» на забезпечення своєї діяльності зменшили вартість активів на –288,1 тис. гривень.

Переоцінка вартості субпортфеля акцій склалася в результаті таких змін. Виграш по двох нових відкритих позиціях «Kernel Holding S.A.» та «МНР SE» («Миронівський хлібопродукт») склав +85,9 тис. грн та +21,1 тис. грн і перекрив від'ємний результат, зафіксований в «Укрнафти» (–4,6 тис. грн), «Райффайзен Банку» (–8,6 тис. грн) та «Центренерго» (–28,4 тис. гривень). Інші 18 позицій субпортфеля акцій не змінили своєї оціночної вартості.

Щодо цінних паперів з фіксованим доходом, то плюс у сумарній переоцінці їх позицій був обумовлений тим фактом, що випуски тих восьми облігацій, по яких купонний дохід продовжував накопичуватися у балансовій вартості, перекрили зниження курсової вартості тих шести випусків, по яких у звітному періоді було здійснене поточне перерахування купонних платежів власникам.

У звітному періоді від погашення ОВДП 11 серпня 2021 року фонд отримав 1,092 млн грн (реалізована доходність без урахування реінвестицій купонів за 583 дні перебування паперів в активах фонду склала +23,6%). Ці кошти, а також інші вільні кошти, було проінвестовано в такі цінні папери на загальну суму 2,713 млн гривень:

- купівля 6 707 акцій «МНР SE» на суму 1,153 млн гривень;
- купівля 2 022 акції «Kernel Holding S.A.» на суму 783,8 тис. гривень;
- купівля 9 900 акцій АТ «Українські енергетичні машини» на суму 74,8 тис. гривень;
- купівля 970 акцій «Укрнафти» на суму 261,9 тис. гривень;
- купівля 421 корпоративної облігації ТОВ «Руш» (серія G) на суму 440,5 тис. гривень.

Фонд продовжував працювати з ф'ючерсними контрактами на курс долар США-українська гривня (результат вище).

У підсумку всіх цих змін і склався той результат, що продемонстрував ІФ «КІНТО-Класичний» у звітному кварталі – +0,9% доходності. Зафіксована величина виявилася кращою за бенчмарк – відносний композиційний індекс ринку, який впав на 2,2%.

ІФ «КІНТО-Класичний» продовжує демонструвати кращий результат на тривалому проміжку часу: середньорічна доходність фонду з початку його діяльності (1 липня 2004 року) станом на 1 жовтня 2021 року склала +12,1%, а аналогічний показник для індексу ринку становив +11,0%.