

## ДОСТАТОК

Інтервальний диверсифікований пайовий інвестиційний фонд «Достаток»

Початок діяльності – 11 вересня 2003 р.

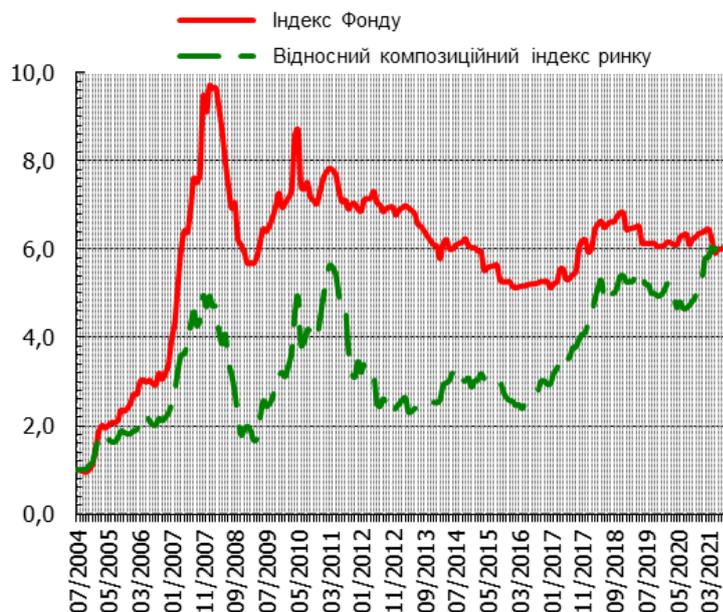
| Динаміка                                       | Фонд     | Композиційний індекс ринку |
|--|----------|----------------------------|
| Доходність за 3 квартал 2021 року*             | 0,6%     | -2,4%                      |
| Доходність за 2020 рік                         | 4,7%     | 6,2%                       |
| Середньорічна доходність (з 1 липня 2004 року) | 11,0%    | 11,0%                      |
| <b>Показники ризику**</b>                      |          |                            |
| Стандартне відхилення                          | 7,4%     | 38,0%                      |
| Коефіцієнт Шарпа***                            | від'ємн. | 2,6                        |
| Коефіцієнт Сортино***                          | від'ємн. | 11,0                       |
| Альфа  | -0,3%    |                            |
| Бета   | -0,1     |                            |
| Коефіцієнт кореляції                           | -0,6     |                            |

\* - З 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

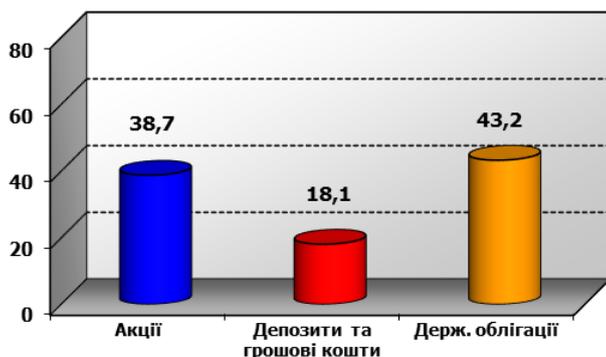
\*\* - Показники ризику та співвідношення доходностей до ризиків для фондів та індексів розраховуються за величинами щоденної вартості чистих активів у розрахунку на цінний папір та значеннями відповідних індексів за останні 12 місяців діяльності фонду.

\*\*\* - Розрахунки коефіцієнтів Шарпа та Сортино 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 Сортино приймається на рівні 10,0%.

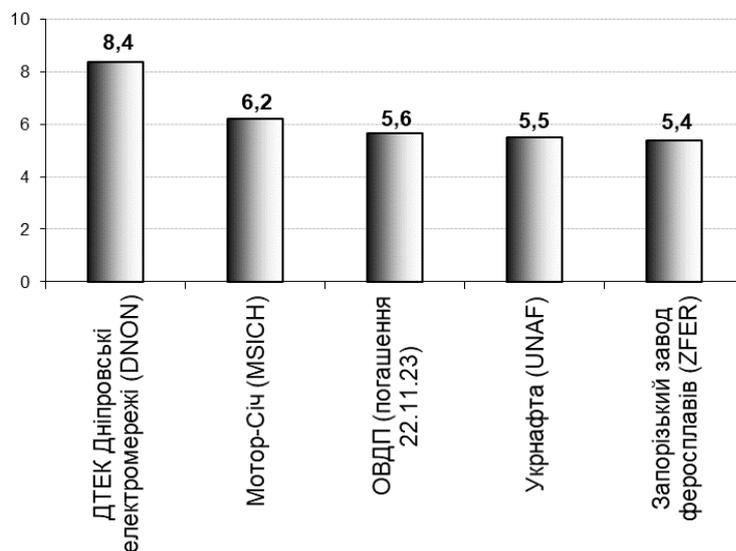
Динаміка ВЧА/інвестиційний сертифікат у порівнянні з еталоном



Вкладення за класами активів, %



Найбільші позиції портфеля, %



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

Що стосується ІФ «Достаток», то з 10 липня по 10 жовтня 2021 року показники фонду зросли на 0,6%: вартість інвестиційного сертифіката збільшилась з 7,20 грн до 7,24 грн, а загальна вартість чистих активів – на 77,6 тис. грн і склала 13,3 млн гривень. Результат виявився кращим у порівнянні з бенчмарком – відносним композиційним індексом ринку, який впав на 2,4% за звітний період.

Складовими зміни вартості чистих активів фонду були: вартісна переоцінка портфеля (–87,9 тис. грн), купонні виплати за облігаціями (+169,5 тис. грн), нараховані відсотки за депозитами (+16,4 тис. грн), отримані дивіденди по акціях «Харківобленерго», «Харківенергозбут» та «Центренерго» (+12,8 тис. грн), а також поточні витрати на фінансування діяльності фонду (–33,2 тис. гривень).

У переоцінці портфеля ІФ «Достаток» субпортфель акцій знецінився на –62,8 тис. грн, а субпортфель облігацій – на –25,1 тис. гривень. Серед акцій трішки збільшився в оцінці лише «Райффайзен Банк» (+2,0 тис. грн), ще два емітенти знецінились – «Укрнафта» (–30,3 тис. грн) та «Центренерго» (–34,5 тис. грн), решта 12 позицій портфеля не змінили своєї оціночної вартості.

Щодо цінних паперів з фіксованим доходом, то мінус був обумовлений тим фактом, що випуски тих семи облігацій, по яких купонний дохід продовжував накопичуватися у балансовій вартості, не змогли перекрити зниження курсової вартості тих чотирьох випусків, по яких у звітному періоді було здійснено поточне перерахування купонних платежів власникам.

У звітному періоді від погашення ОВДП 11 серпня 2021 року фонд отримав 914,0 тис. грн (реалізована доходність без урахування реінвестицій купонів за 627 днів перебування паперів в активах фонду склала +25,0%). Ці кошти, а також інші вільні кошти, було проінвестовано в такі цінні папери на загальну суму 2,699 млн гривень:

- купівля 318 штук ОВДП з датою погашення 23 серпня 2023 р. на суму 321,7 тис. гривень;
- купівля 624 штук ОВДП з датою погашення 15 червня 2022 р. на суму 638,2 тис. гривень;
- купівля 271 штук ОВДП з датою погашення 22 травня 2024 р. на суму 264,3 тис. гривень;
- купівля 720 штук ОВДП з датою погашення 22 листопада 2023 р. на суму 735,1 тис. гривень;
- купівля 529 штук ОВДП з датою погашення 13 травня 2026 р. на суму 544,8 тис. гривень;
- купівля 730 акцій «Укрнафти» на суму 195,0 тис. гривень.