

## ДОСТАТОК

Інтервальний диверсифікований пайовий інвестиційний фонд «Достаток»

Початок діяльності – 11 вересня 2003 р.

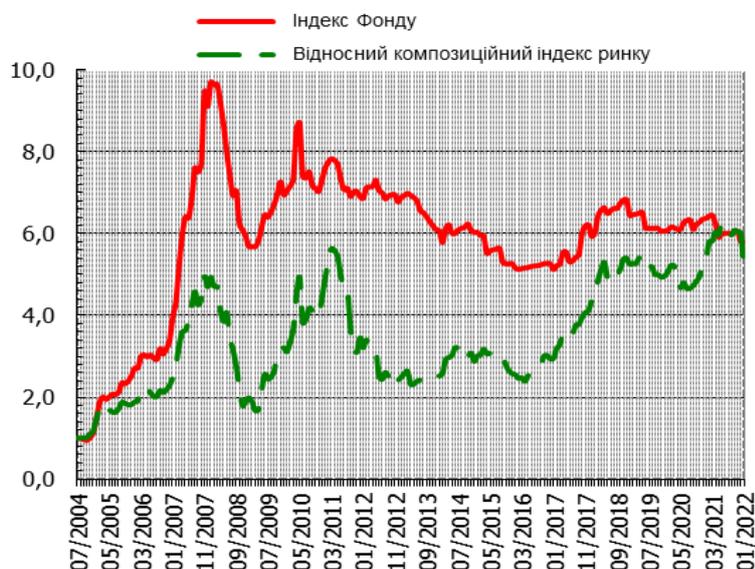
Динаміка	Фонд	Композиційний індекс ринку
Доходність за 4 квартал 2021 року*	-4,2%	-16,5%
Доходність за 2021 рік	-9,2%	-5,4%
Середньорічна доходність (з 1 липня 2004 року)	10,5%	9,7%
<b>Показники ризику**</b>		
Стандартне відхилення	8,4%	50,3%
Коефіцієнт Шарпа***	від'ємн.	1,9
Коефіцієнт Сортино***	від'ємн.	3,4
Альфа	-1,4%	
Бета	-0,1	
Коефіцієнт кореляції	-0,5	

\* - 3 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

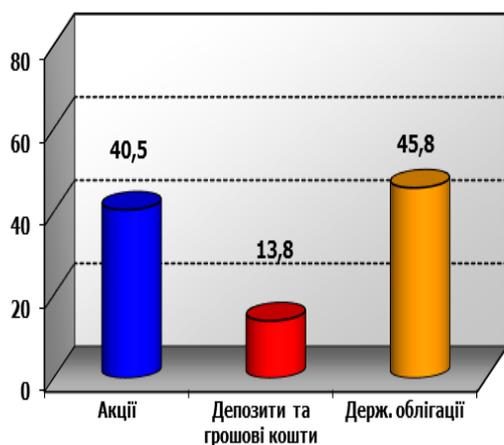
\*\* - Показники ризику та співвідношення доходностей до ризиків для фондів та індексів розраховуються за величинами щоденної вартості чистих активів у розрахунку на цінний папір та значеннями відповідних індексів за останні 12 місяців діяльності фонду.

\*\*\* - 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 11,4%. Мінімальний рівень доходності для розрахунків коефіцієнта Сортино приймається на рівні 10,0%.

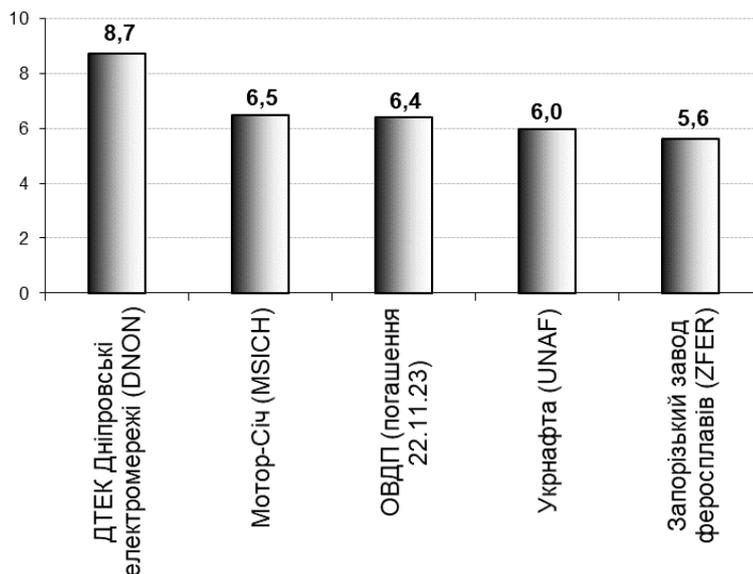
Динаміка ВЧА/інвестиційний сертифікат у порівнянні з еталоном



Вкладення за класами активів, %



Найбільші позиції портфеля, %



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

Що стосується ІФ «Достаток», то з 10 жовтня 2021 року по 10 січня 2022 року показники фонду скоротились на 4,2%: вартість інвестиційного сертифіката зменшилась з 7,24 грн до 6,93 грн, а загальна вартість чистих активів – на 561,8 тис. грн і склала 12,7 млн гривень. Результат виявився кращим у порівнянні з бенчмарком – відносним композиційним індексом ринку, який впав на 16,5% за звітний період.

Складовими зміни вартості чистих активів фонду були: вартісна переоцінка портфеля (–221,4 тис. грн), купонні виплати за облігаціями (+261,2 тис. грн), нараховані відсотки за депозитами (+3,8 тис. грн), отримані дивіденди по акціях «Запоріжжяобленерго» (+1,4 тис. грн), поточні витрати на фінансування діяльності фонду (–26,7 тис. гривень), а також списання збитків (–580,1 тис. гривень).

У переоцінці портфеля ІФ «Достаток» субпортфель акцій знецінився на –105,8 тис. грн, а субпортфель облігацій – на –115,6 тис. гривень. Серед акцій трішки збільшились в оцінці «Укрнафта» (+19,0 тис. грн) та «Українські енергетичні машини» (+0,7 тис. грн), ще два емітенти знецінились – «Райффайзен Банк» (–2,3 тис. грн) та «Центренерго» (–123,3 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 трьох облігацій, по яких купонний дохід продовжував накопичуватися у балансовій вартості, не змогли перекрити зниження курсової вартості тих семи випусків, по яких у звітному періоді було здійснено поточне перерахування купонних платежів власникам.

У звітному періоді ІФ «Достаток» інвестував вільні кошти в такі цінні папери на загальну суму 303,9 тис. гривень:

- купівля 40 акцій «Укрнафти» на суму 10,3 тис. гривень;
- купівля 8 400 акцій «Українських енергетичних машин» на суму 48,9 тис. гривень;
- купівля 7 000 акцій «Центренерго» на суму 50,6 тис. гривень;
- купівля 100 штук ОВДП з датою погашення 3 серпня 2022 р. на суму 107,9 тис. гривень;
- купівля 87 штук ОВДП з датою погашення 22 листопада 2023 р. на суму 86,2 тис. гривень.