

ДОСТАТОК

Інтервальний диверсифікований пайовий інвестиційний фонд «Достаток»

Початок діяльності – 11 вересня 2003 р.

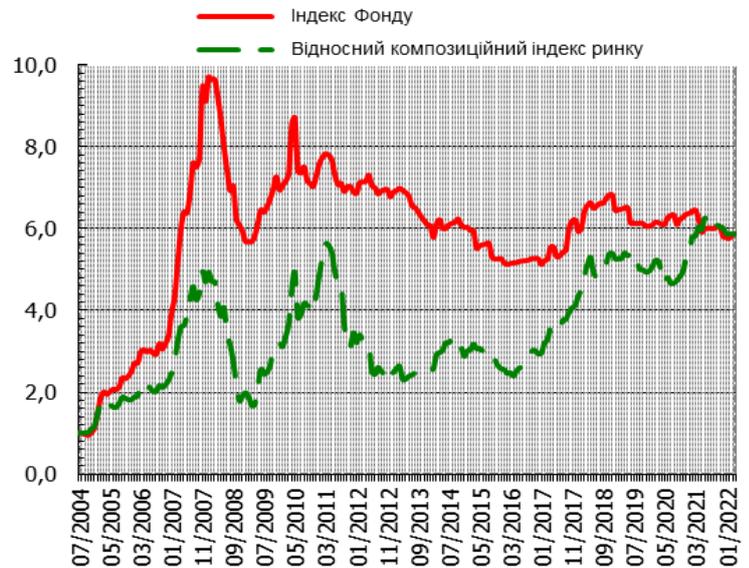
Динаміка	Фонд	Композиційний індекс ринку
Доходність за 1 квартал 2022 року*	1,5%	-0,2%
Доходність за 2021 рік	-9,2%	9,5%
Середньорічна доходність (з 1 липня 2004 року)	10,5%	10,5%
Показники ризику**		
Стандартне відхилення	10,5%	46,5%
Коефіцієнт Шарпа***	від'ємн.	2,3
Коефіцієнт Сортино***	від'ємн.	14,0
Альфа	-1,4%	
Бета	-0,1	
Коефіцієнт кореляції	-0,7	

* - З жовтня 2012 року результати надаються на 10 число кожного місяця, тому звітний період охопив період, що не співпадає з 1 кварталом – з 10 січня по 10 квітня 2022 року

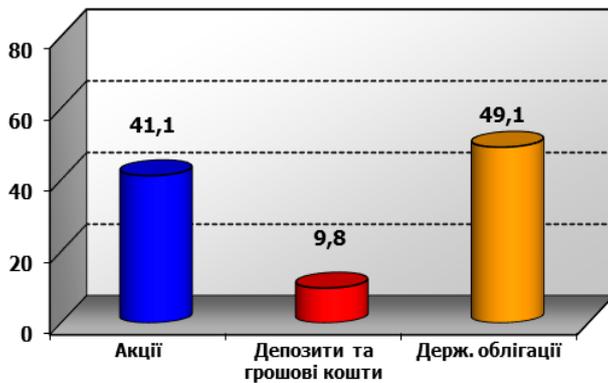
** - Показники ризику та співвідношення доходностей до ризиків для фондів та індексів розраховуються за величинами щоденної вартості чистих активів у розрахунку на цінний папір та значеннями відповідних індексів за останні 12 місяців діяльності фонду.

*** - 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 11,5%. Мінімальний рівень доходності для розрахунків коефіцієнта Сортино приймається на рівні 10,0%.

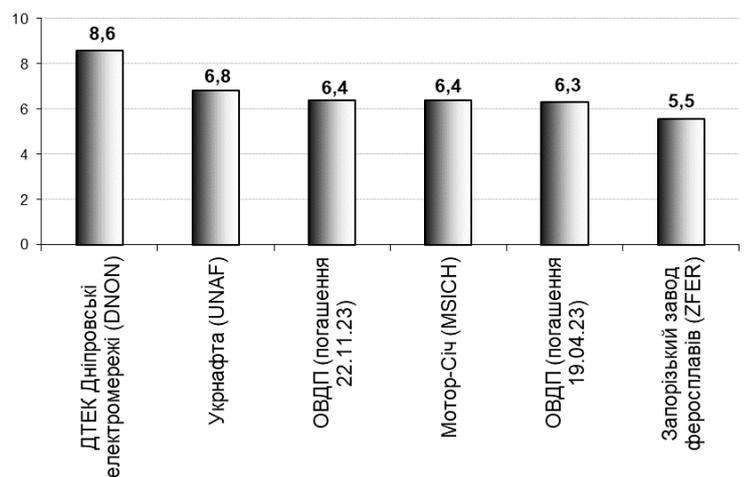
Динаміка ВЧА/інвестиційний сертифікат у порівнянні з еталоном



Вкладення за класами активів, %



Найбільші позиції портфеля, %



Інформація про загальну ситуацію на фондових ринках надана у [«Звіті про діяльність ІФ «КІНТО-Еквіті» за перший квартал 2022 року»](#), що розповсюджується паралельно з цим.

Що стосується ІФ «Достаток», то з 10 січня по 10 квітня 2022 року показники фонду зросли на 1,5%: вартість інвестиційного сертифіката зросла з 6,93 грн до 7,04 грн, а загальна вартість чистих активів – на 188,8 тис. грн і склала 12,9 млн гривень. Результат виявився кращим у порівнянні з бенчмарком – відносним композиційним індексом ринку, який впав на 0,2% за звітний період.

Складовими зміни вартості чистих активів фонду були вартісна переоцінка портфеля (+103,6 тис. грн), купонні виплати за облігаціями (+104,4 тис. грн), нараховані відсотки за депозитами (+4,7 тис. грн), а також поточні витрати на фінансування діяльності фонду (–23,9 тис. гривень).

У переоцінці портфеля ІФ «Достаток» субпортфель акцій зріс в оцінці на +111,1 тис. грн, а субпортфель облігацій знецінився на –7,5 тис. гривень. Серед акцій збільшилась в оцінці «Укрнафта» (+122,7 тис. грн), ще два емітенти знецінились – «Райффайзен Банк» (–2,7 тис. грн) та «Центренерго» (–8,9 тис. грн), решта 13 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 ІФ «Достаток» провів короткострокову операцію зворотного РЕПО з 700 акціями «Укрнафти» на суму закриття 106,1 тис. грн, а також інвестував вільні кошти в такі цінні папери на загальну суму 579,5 тис. гривень:

- купівля 7 500 акцій «Центренерго» на суму 53,9 тис. гривень;
- купівля 400 штук ОВДП з датою погашення 19 квітня 2023 р. на суму 434,9 тис. гривень;
- купівля 100 штук так званих військових ОВДП з датою погашення 1 березня 2023 р. на суму 90,7 тис. гривень.

Остання купівля військових облігацій була здійснена вже після нападу росії на Україну: фонд не пролонгував один із своїх депозитних договорів та інвестував кошти на підтримку Збройних сил України.