

Початок діяльності – 10 травня 2005 р.

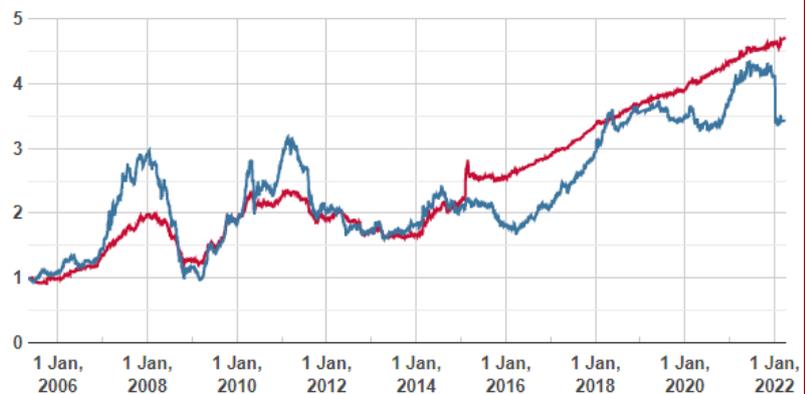
Динаміка	Фонд	Композиційний індекс (пенсійний)
Доходність за 1 квартал 2022 року	2,12%	
Доходність за 2021 рік	6,14%	9,80%
Середньорічна доходність	9,60%	
Показники ризику**		
Стандартне відхилення	3,78%	
Коефіцієнт Шарпа***	від'ємн.	
Коефіцієнт Сортіно***		
Альфа	-0,34%	
Бета	0,16	
Коефіцієнт кореляції	0,48	

** - 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/~wsharp/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 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 чистої вартості 1-ці пенсійних активів

— Індекс Фонду — Композиційний індекс ринку (пенсійний)

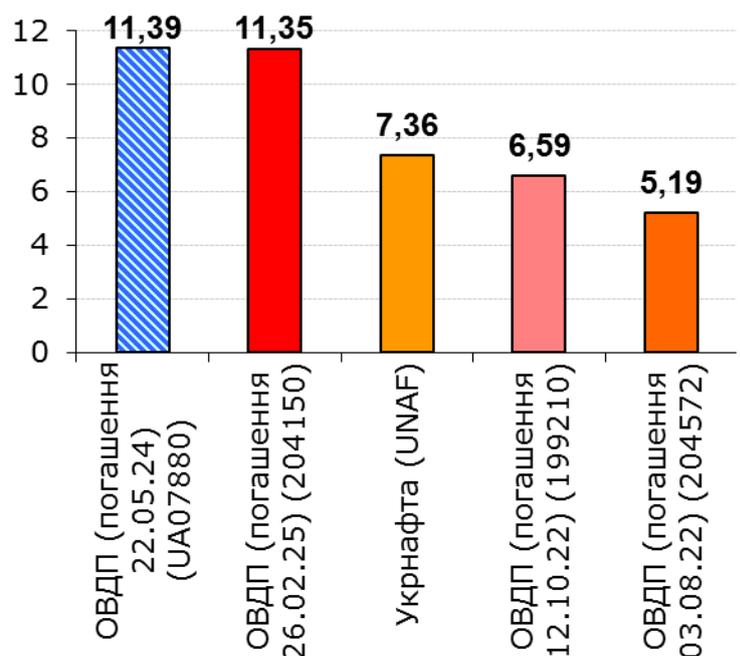


* - композиційний індекс ринку (пенсійний) розраховується на основі таких ваг: індекс акцій УБ - 40%; індекс облігацій KINBOND - 60%.

Вкладення за класами активів



Найбільші позиції портфеля, %



24 лютого путінська росія здійснила повномасштабне вторгнення в Україну. Розпочалася україно-російська війна. Найбільш кривава війна після другої світової. Завдяки хоробрості та мужності наших воїнів, підтримки та допомозі практично всього світу Україна дає гідну відсіч російським оркам. Перемога буде за нами. Слава ЗСУ! Слава Україні!

Але, навіть в умовах війни, життя продовжується, продовжується і діяльність пенсійного фонду «Соціальний Стандарт».

За перший квартал 2022 року доходність фонду «Соціальний Стандарт» склала 2,12%.

Вартість одиниці пенсійних активів на кінець першого кварталу дорівнювала 4,71 грн.

На кінець звітного кварталу вартість чистих активів фонду склала 59 915 944,56 грн., збільшившись за квартал на 2 529 529,38 грн., або на 4,41%. За той же час до фонду надійшло пенсійних внесків на суму 1 543 402,13 грн., пенсійних виплат було здійснено на суму 260 730,07 грн. Таким чином, чистий грошовий потік склав: 1 282 672,06 грн.

Протягом кварталу керуючий здійснив наступні дії з портфелем фонду:

- 1) На початку року індекси американського фондового ринку демонстрували історичні максимуми, що, безумовно, викликало побоювання можливої корекції, що, в свою чергу, змушувало інвесторів замислюватися про «безпечну гавань», у якості якої могло виступати золото. Масла в вогонь також доливало і зростання міжнародної напруги. Ці два фактори могли привести к значному зростанню ціни на золота. Враховуючи це, а також на очікуваннях девальвації гривні, керуючий прийняв рішення інвестувати вільні кошти фонду в золото. Крім того, заради зниження ризику об'єктом інвестування стало не саме золото, яке зберігається в українському банку, а акції американського ETF SPDR Gold Shares, в портфелі якого знаходиться виключно фізичне золото. Таким чином, 4 січня були придбані акції вищезгаданого ETF на суму 191 735,27 гривень.
- 2) 14 січня за рахунок пенсійних внесків керуючий купив 538 корпоративних облігацій Бест Лізинг (серія С) з доходністю до повернення 17,62% на суму 541 835,94 гривень.
- 3) 17 січня були придбані 267 облігацій ТОВ «Руш» серії G з доходністю до повернення 12,00% на суму 276 283,40 гривень, реінвестувавши кошти, що були отримані після закриття депозиту.
- 4) 19 січня керуючий придбав 900 ОВДП (14.02.2024) з доходністю 13,35% на суму 949 815,00 гривень, реінвестувавши кошти, що були отримані після закриття депозиту.
- 5) 1 лютого були придбані 345 ОВДП (26.02.2025) з доходністю 15,50% на суму

- 375 625,65 гривень за рахунок коштів, отриманих після закриття депозиту.
- 6) 2 лютого керуючий придбав 36,06 унцій золота за ціною 52 844,81 грн/унція за рахунок коштів, отриманих після закриття депозиту.
- 7) 3 лютого керуючий додатково придбав 78 ОВДП (26.02.2025) з доходністю 15,50% на суму 84 991,14 гривень за рахунок купонів, отриманих від ОВДП (03.08.2022).
- 8) 15 лютого за рахунок пенсійних внесків були придбані 261 облігація «ЕСКА Капітал» серії D з доходністю 16,46% на суму 265 643,19 гривень та 347 облігацій ТОВ «Руш» серії G з доходністю до повернення 12,00% на суму 362 313,11 гривень.
- 9) Після початку війни з путінською росією Комісія з цінних паперів заборонила будь-які операції з цінними паперами, крім купівлі державних військових облігацій. Таким чином, у керуючого залишилися тільки дві можливості щодо інвестування: або купувати військові облігації, або розміщувати кошти на банківських депозитах. Звичайно, керуючий обрав купівлю облігацій. І з 9 по 18 березня були придбані 2 299 військових ОВДП (01.03.2023) з простою доходністю 11,00% на загальну суму 2 076 293,92 гривень за рахунок купонів, отриманих від ОВДП (26.02.2025), а також коштів, отриманих після закриття депозиту.

Протягом кварталу до фонду надійшло:

- платежів за облігаціями внутрішньої державної позики загальним обсягом 900 510,30 грн.
- платежів за корпоративними облігаціями загальним обсягом 287 193,98 грн., а саме:
 - ЕСКА Капітал (серії B) - 71 973,44 грн.
 - Укрпошта (серії B) - 33 158,93 грн.
 - РУШ (серії G) - 67 121,11 грн.
 - Бест Лізинг (серії C) - 114 940,50 грн.
- відсотків за депозитами обсягом 191 578,23 грн.

ЗМІНА ВАРТОСТІ ОДИНИЦІ ПЕНСІЙНИХ ВНЕСКІВ

Стратегія	Назва фонду	Вартість чистих активів, грн.	Вартість одиниці пенсійних внесків, грн.	З початку діяльності	1 місяць	3 місяці	6 місяців	1 рік	2 роки	3 роки	Середньорічна доходність
Збалансована	«Соціальний стандарт»	59 915 944,55	4,71	370,8%	0,7%	2,1%	3,5%	5,3%	17,3%	24,0%	9,6%

(дані на кінець I кварталу 2022 року)