

## ДОСТАТОК

Інтервальний диверсифікований пайовий інвестиційний фонд «Достаток»

Початок діяльності – 11 вересня 2003 р.

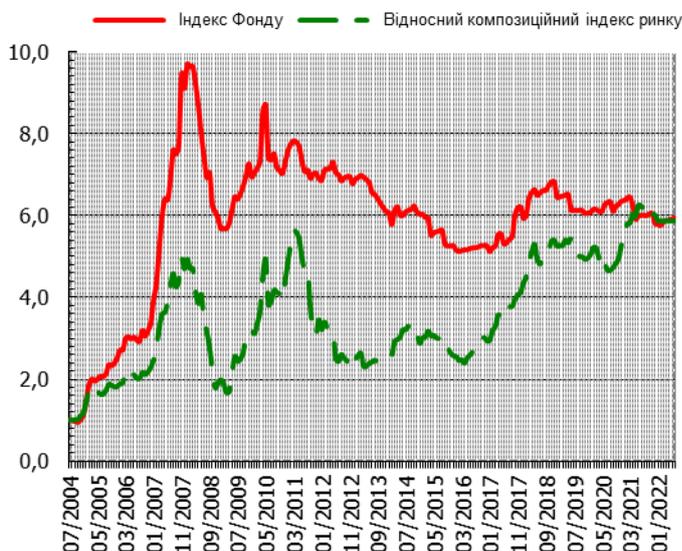
Динаміка	Фонд	Композиційний індекс ринку
Доходність за 2 квартал 2022 року*	1,2%	0,0%
Доходність за 2021 рік	-9,2%	9,5%
Середньорічна доходність (з 1 липня 2004 року)	10,4%	10,3%
<b>Показники ризику** (не розраховувались)</b>		
Стандартне відхилення		
Коефіцієнт Шарпа***		
Коефіцієнт Сортіно***		
Альфа		
Бета		
Коефіцієнт кореляції		

\* - З жовтня 2012 року результати надаються на 10 число кожного місяця, тому звітний період охопив період, що не співпадає з 2 кварталом – з 10 квітня по 10 липня 2022 року

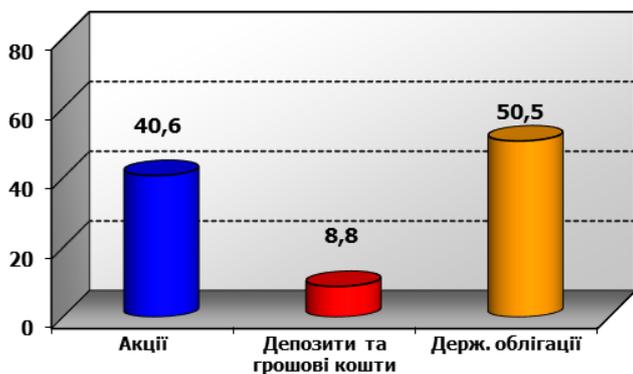
\*\* - Показники ризику та співвідношення доходностей до ризиків для фондів та індексів розраховуються за величинами щоденної вартості чистих активів у розрахунку на цінний папір та значеннями відповідних індексів за останні 12 місяців діяльності фонду.

\*\*\* - Розрахунки коефіцієнтів Шарпа та Сортіно здійснюються відповідно до методики, рекомендованої у статті У. Шарпа «The Sharpe Ratio» (<http://www.stanford.edu/~wfscharpe/art/sr/sr.htm>). Безризикова доходність для визначення коефіцієнта Шарпа, розрахована на основі доходностей ОВДП на ринку, складає 11,2%. Мінімальний рівень доходності для розрахунків коефіцієнта Сортіно приймається на рівні 10,0%.

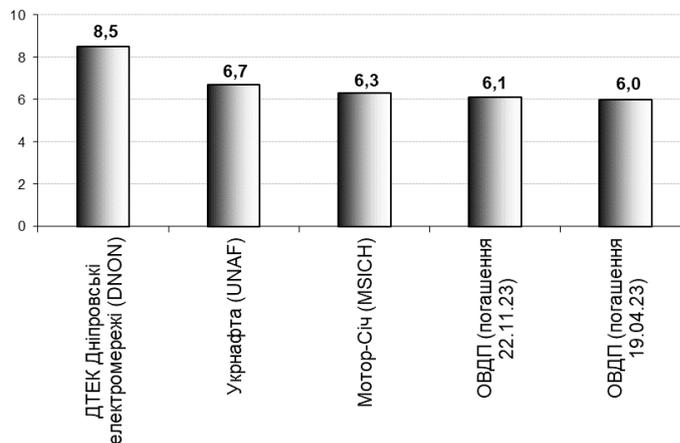
Динаміка ВЧА/інвестиційний сертифікат у порівнянні з еталоном



Вкладення за класами активів, %



Найбільші позиції портфеля, %



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

Що стосується ІФ «Достаток», то з 10 квітня по 10 липня 2022 року показники фонду зросли на 1,2%: вартість інвестиційного сертифіката зросла з 7,04 грн до 7,12 грн, а загальна вартість чистих активів – на 157,1 тис. грн і склала 13,1 млн гривень. Бенчмарк фонду – відносний композиційний індекс ринку – під час дії воєнного стану не змінювався.

Складовими зміни вартості чистих активів фонду були вартісна переоцінка портфеля за рахунок субпортфеля облігацій (-140,3 тис. грн), купонні виплати за облігаціями (+325,7 тис. грн), нараховані відсотки за депозитами (+1,4 тис. грн), а також поточні витрати на фінансування діяльності фонду (-29,7 тис. гривень).

Під час дії воєнного стану регулятором зупинено обіг цінних паперів, тому всі 16 позиції субпортфеля акцій не змінили своєї оціночної вартості. Щодо цінних паперів з фіксованим доходом, то мінус був обумовленим тим фактом, що випуски тих п'яти облігацій, по яких купонний дохід продовжував накопичуватися у балансовій вартості, не змогли перекрити зниження курсової вартості тих дев'яти випусків, по яких у звітному періоді було здійснено поточне перерахування купонних платежів власникам.

У звітному періоді ІФ «Достаток» проводив лише дозволені під час воєнного стану операції купівлі військових ОВДП на загальну суму 2,5 млн гривень:

- купівля 680 штук ОВДП з датою погашення 27 липня 2022 р. на суму 673,9 тис. гривень;
- купівля 500 штук ОВДП з датою погашення 21 червня 2023 р. на суму 519,8 тис. гривень;
- купівля 405 штук ОВДП з датою погашення 25 жовтня 2023 р. на суму 407,8 тис. гривень.

Від погашення ОВДП 11 травня 2022 року фонд отримав 572,0 тис. грн (реалізована доходність без урахування реінвестицій купонів за 588 днів перебування паперів в активах фонду склала +14,4%), а від погашення ОВДП 15 червня 2022 року – 624,0 тис. грн (реалізована доходність без урахування реінвестицій купонів за 313 днів перебування паперів в активах фонду склала +9,3%). Ці надходження інвестовано у військові ОВДП, що зазначено вище.