



## Класичний

Початок діяльності – 01 липня 2004 р.

Динаміка	Фонд	Композиційний Індекс ринку
Доходність за 2 квартал 2022 року	0,51%	0%
Доходність за 2021 рік	4,42%	9,91%
Середньорічна доходність	11,43%	10,33%
<b>Показники ризику**</b>		
Стандартне відхилення	не розрах.	не розрах.
Коефіцієнт Шарпа***	не розрах.	не розрах.
Коефіцієнт Сортино***	не розрах.	не розрах.
Альфа	не розрах.	
Бета	не розрах.	
Коефіцієнт кореляції	не розрах.	

\*\* - 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 Сортино 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 **11,2%**. Мінімальний рівень доходності для розрахунку коефіцієнта Сортино 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.

## Відкритий диверсифікований пайовий інвестиційний фонд "КІНТО-Класичний"

### Динаміка ВЧА/інвестиційний сертифікат у порівнянні з бенчмарком

Динаміка вартості чистих активів



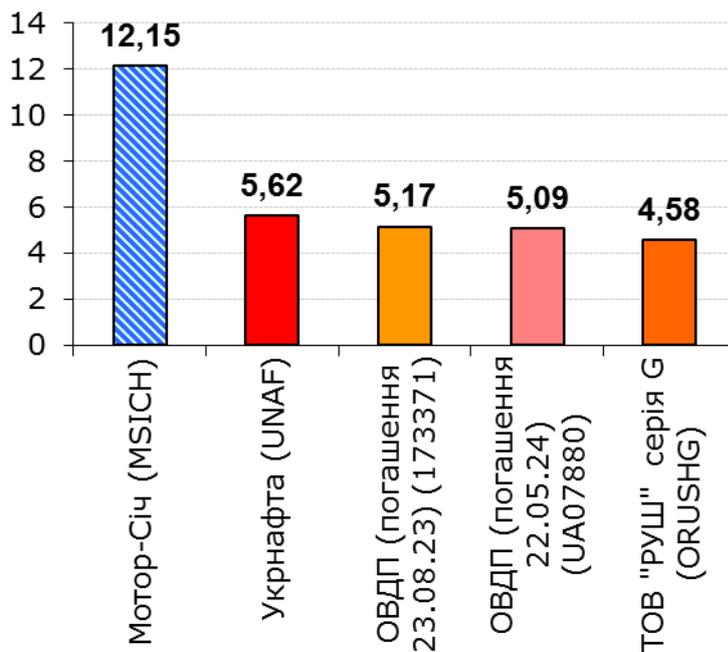
\* - композиційний індекс ринку (інвестиційний) розраховується на основі таких ваг: з 1 липня 2004 р. до 31 грудня 2009 р.: індекс ПФТС - 40%; індекс KINBOND - 60%; з 1 січня 2010 р. до 31 грудня 2010 р.: індекс ПФТС - 50%; індекс KINBOND - 50%; з 1 січня 2011 р.: індекс ПФТС - 25%; індекс УБ - 25%; індекс KINBOND - 50%; з 1 січня 2016 р.: індекс УБ - 50%; індекс KINBOND - 50%;

- для зручності порівняння за умовну одиницю прийняті, відповідно, значення ВЧА/інвестиційний сертифікат Фонду на початок діяльності (100 грн.) та значення композиційного індексу ринку на цю ж дату (1 липня 2004 р.), що дорівнювало 114,264.

### Вкладення акцій за галузями



### 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.

Протягом звітного періоду в ІФ «КІНТО-Класичний» вартість чистих активів в розрахунку на один сертифікат зросла на 0,5%: з 698,35 грн до 701,91 гривень. Загальна ВЧА зросла також на 0,5%, або на 159,1 тис. грн: з 31,26 млн грн до 31,42 млн гривень. Бенчмарк фонду – відносний композиційний індекс ринку – під час дії воєнного стану не змінювався.

Позитивні накопичення принесли ІФ «КІНТО-Класичний» купонні виплати за облігаціями (+637,7 тис. грн) та нараховані відсотки за депозитами (+1,9 тис. гривень). Переоцінка вартості портфеля за рахунок субпортфеля облігацій відняла 226,3 тис. гривень. Поточні витрати ІФ «КІНТО-Класичний» на забезпечення своєї діяльності зменшили вартість активів на 254,2 тис. гривень.

Під час дії воєнного стану регулятором зупинено обіг цінних паперів, тому всі 22 позиції субпортфеля акцій не змінили своєї оціночної вартості. Щодо цінних паперів з фіксованим доходом, то мінус у сумарній переоцінці їх позицій був обумовлений тим фактом, що випуски тих шести облігацій, по яких купонний дохід продовжував накопичуватися у балансовій вартості, не змогли перекрити зниження курсової вартості тих десяти випусків, по яких у звітному періоді було здійснене поточне перерахування купонних платежів власникам.

У звітному періоді ІФ «КІНТО-Класичний» проводив лише дозволені під час воєнного стану операції з військовими ОВДП:

- купівля 1 000 штук ОВДП з датою погашення 21 червня 2023 р. на суму 1 041,0 тис. гривень;
- купівля 890 штук ОВДП з датою погашення 25 жовтня 2023 р. на суму 896,0 тис. гривень;
- купівля 915 штук ОВДП з датою погашення 27 липня 2022 р. на суму 906,8 тис. гривень;
- продаж 890 штук ОВДП з датою погашення 25 жовтня 2023 р. на суму 902,1 тис. гривень (реалізована доходність за 22 дні перебування паперів в активах фонду склала +0,7%).

Від погашення ОВДП 11 травня 2022 року фонд отримав 1,4 млн грн (реалізована доходність без урахування реінвестицій купонів за 639 днів перебування паперів в активах фонду склала +17,4%). Це надходження фонд інвестував у військові облігації.

Середньорічна доходність фонду з початку його діяльності (1 липня 2004 року) станом на 1 липня 2022 року склала +11,4%, а аналогічний показник для індексу ринку становив +10,3%.