

Початок діяльності – 12 вересня 2005 р.

Динаміка	Фонд	Індекс ПФТС
Доходність за I квартал 2022 року	12,06%	-1,14%
Доходність за 2021 рік	14,80%	7,49%
Середньорічна доходність	-3,70%	2,79%
Показники ризику**		
Стандартне відхилення	40,98%	21,30%
Коефіцієнт Шарпа	0,65	від'ємн.
Коефіцієнт Сортіно	1,06	від'ємн.
Альфа	2,00%	
Бета	0,35	
Коефіцієнт кореляції	0,16	

** - 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/~wfs Sharpe/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 ВЧА/акцію у порівнянні з бенчмарком

Динаміка вартості чистих активів



* - для зручності порівняння за умовну одиницю прийняті, відповідно, значення ВЧА/акція Фонду на початок діяльності (10 000 грн.) та значення індексу ПФТС на цю ж дату (12 вересня 2005 р.), що дорівнювало 360,07; з 1 січня 2014 р. бенчмарком Фонду є індекс Української біржі.

За 1 квартал 2022 року індекс українських акцій Української біржі (Індекс UX) продемонстрував падіння на 1,14%. На проміжку від кінця 1 кварталу 2021 року до рівня кінця першого кварталу 2022 року індекс впав на 8,33%. На дату закриття торгової сесії 31 березня 2022 року його значення склало 1718,5 пунктів проти 1738,24 пунктів 30 грудня 2020 року. З початку року Індекс UX показує падіння на 1,14%.

Російська військова агресія проти України докорінно змінила нашу економіку. Зниження ВВП у першому кварталі 2022 року становить 16%, а загальнорічне падіння може досягти 40%. Найбільше постраждали ті галузі, де неможлива дистанційна робота, зокрема авіаційні, морські перевезення, сфера послуг, де бізнес працює безпосередньо зі споживачами. Регулятор фондового ринку НКЦПФР припинив усі операції з цінними паперами. Виняток – операції з військовими облигаціями.

ВЧА Фонду на одну акцію в обігу на кінець кварталу склала 5353,93 грн. Чисті активи фонду на 1 квітня склали 4524072,22 грн. Кількість акцій фонду в обігу 846 штук. Витрати Фонду в 1 кварталі 2022 році склали 25 тис. грн. Винагорода компанії з управління активами склала 34 тис. грн.

Процес реструктуризації активів фонду продовжується.