

Початок діяльності – 10 травня 2005 р.

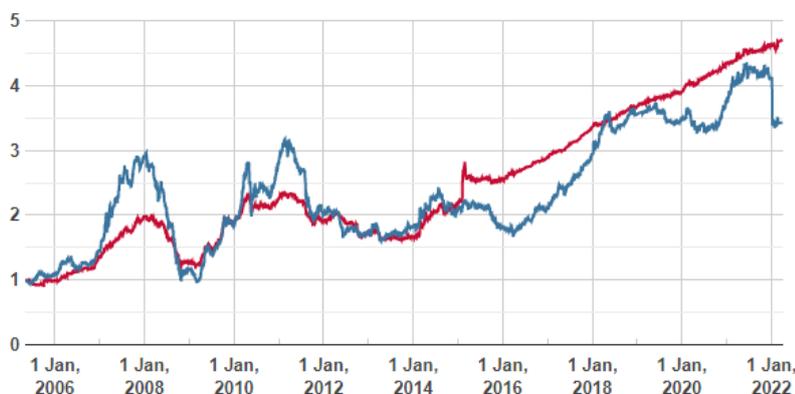
Динаміка	Фонд	Композиційний індекс (пенсійний)
Доходність за 3 квартал 2022 року	-2,20%	
Доходність за 2021 рік	6,14%	9,80%
Середньорічна доходність	9,20%	
<b>Показники ризику**</b>		
Стандартне відхилення	не розрах.	не розрах.
Коефіцієнт Шарпа***	не розрах.	не розрах.
Коефіцієнт Сортино***	не розрах.	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/~wfsarpe/art/sr/sr.htm>). Безризикова доходність для визначення коефіцієнта Шарпа, розрахована на основі доходностей ОВДП на ринку, складає 11,3%. Мінімальний рівень доходності для розрахунків 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.

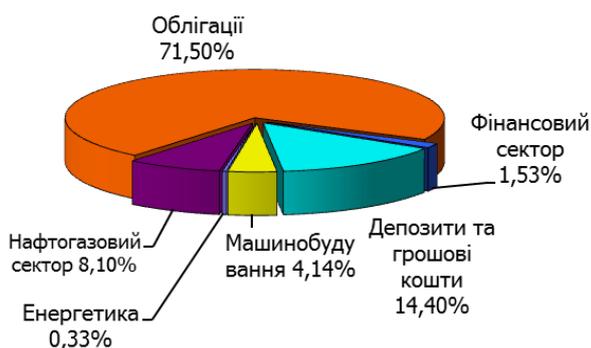
Динаміка чистої вартості 1-ці пенсійних активів

— Індекс Фонду — Композиційний індекс ринку (пенсійний)

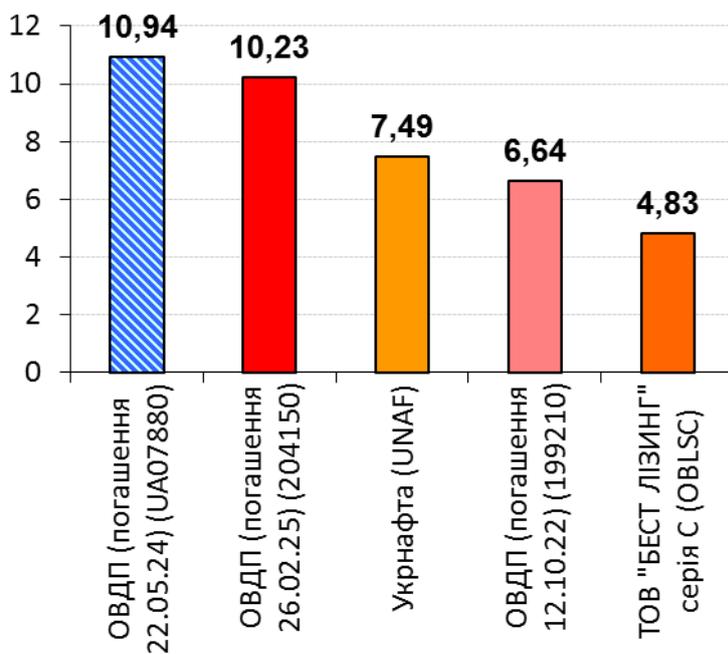


\* - композиційний індекс ринку (пенсійний) розраховується на основі таких ваг: індекс акцій УБ - 40%; індекс облігацій KINBOND - 60%.

### Вкладення за класами активів



### Найбільші позиції портфеля, %



За третій квартал 2022 року доходність фонду «Соціальний Стандарт» склала -2,18%.

Вартість одиниці пенсійних активів на кінець третього кварталу дорівнювала 4,64 грн.

На кінець звітного кварталу вартість чистих активів фонду склала 58 875 770,77 грн., зменшившись за квартал на 1 719 543,24 грн., або на 2,84%. Таке суттєве падіння активів фонду відбулося внаслідок зростання доходностей за державними облігаціями. Нагадаємо, що ще 3 червня Національний банк України збільшив облікову ставку з 10% до 25%. Проте, більше ніж 3 місяці НБУ на своєму сайті публікував доходності за ОВДП, на підставі яких обліковуються державні облігації в портфелі фонду, на рівні 13-14%. І тільки 13 вересня доходності були збільшені до 16-20% в залежності від терміну до погашення, що й призвело до зниження цін облігацій і, як наслідок, чистих активів фонду.

За звітний період до фонду надійшло пенсійних внесків на суму 316 472,26 грн., пенсійних виплат було здійснено на суму 726 331,03 грн. Таким чином, чистий грошовий потік склав: -409 858,77 грн.

Через заборону Комісії з цінних паперів проводити операції в системі депозитарного обліку діяльність на фондовому ринку була практично паралізована. Єдиним інструментом для інвестування залишились державні облігації. Тому діяльність керуючого протягом кварталу була обмежена. Були здійсненні лише наступні дії з портфелем фонду:

- 1) 5-6 липня були придбані 130 військових ОВДП (11.01.2023) з простою доходністю 10,00% на суму 123 579,65 гривень за рахунок коштів, отриманих після закриття депозиту.
- 2) 26 липня були придбані 1 500 ОВДП (24.05.2023) з доходністю 12,60% на суму 1 583 910,00 гривень за рахунок коштів, отриманих після закриття депозиту, а також продажу 89 військових ОВДП (02.11.2022) з простою доходністю 10,00% на суму 86 650,40 гривень.

Протягом кварталу до фонду надійшло:

- платежів за облігаціями внутрішньої державної позики загальним обсягом 3 911 964,30 грн.
- платежів за корпоративними облігаціями загальним обсягом 253 015,54 грн., а саме:
  - ЕСКА Капітал (серії В) - 64 776,06 грн.
  - ЕСКА Капітал (серії D) - 6 177,87 грн.
  - РУШ (серії G) - 67 121,11 грн.
  - Бест Лізинг (серії С) - 114 940,50 грн.
- відсотків за депозитами обсягом 173 007,23 грн.

#### ЗМІНА ВАРТОСТІ ОДИНИЦІ ПЕНСІЙНИХ ВНЕСКІВ

Стратегія	Назва фонду	Вартість чистих активів, грн.	Вартість одиниці пенсійних внесків, грн.	3 початку діяльності	1 місяць	3 місяці	6 місяців	1 рік	2 роки	3 роки	Середньорічна доходність
Збалансована	«Соціальний стандарт»	58 875 770,77	4,64	364,2%	-4,3%	-2,2%	-1,4%	2,1%	10,2%	21,2%	9,2%

(дані на кінець III кварталу 2022 року)