

Початок діяльності – 11 вересня 2003 р.

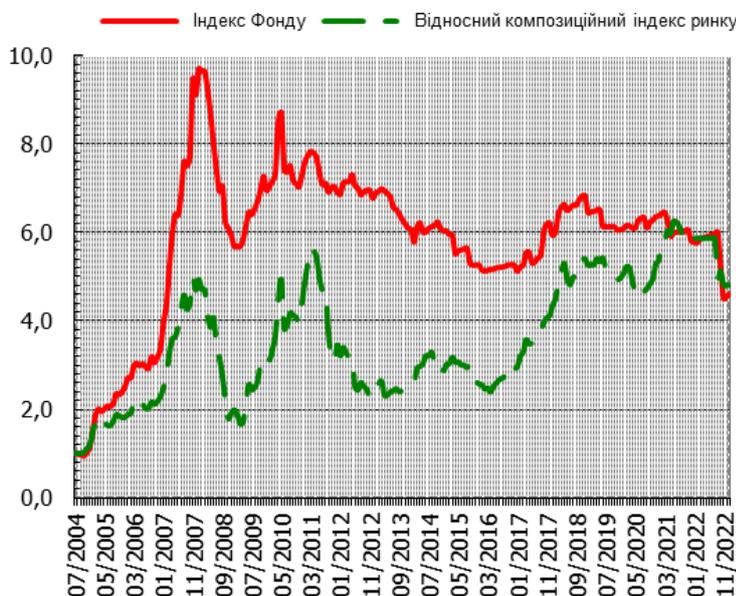
| Динаміка | Фонд | Композиційний індекс ринку |
|--|--------|----------------------------|
| Доходність за 4 квартал 2022 року* | -11,5% | -6,3% |
| Доходність за 2022 рік | -20,4% | -18,3% |
| Середньорічна доходність (з 1 липня 2004 року) | 8,6% | 8,8% |
| Показники ризику** (не розраховувались) | | |
| Стандартне відхилення | | |
| Коефіцієнт Шарпа*** | | |
| Коефіцієнт Сортино*** | | |
| Альфа | | |
| Бета | | |
| Коефіцієнт кореляції | | |

* - З жовтня 2012 року результати надаються на 10 число кожного місяця, тому звітний період охопив період, що не співпадає з 4 кварталом – з 10 жовтня 2022 року по 10 січня 2023 року.

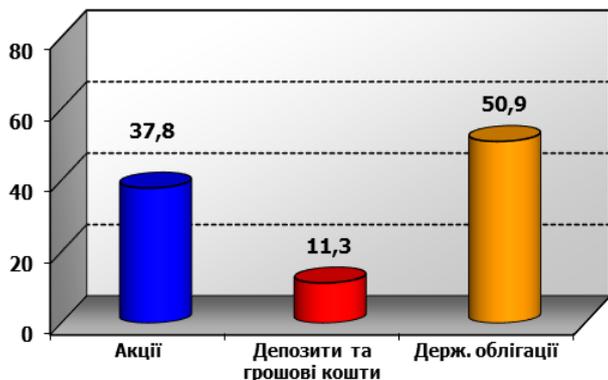
** - Показники ризику та співвідношення доходностей до ризиків для фондів та індексів розраховувались у довоєнний час за величинами щоденної вартості чистих активів у розрахунку на цінний папір та значеннями відповідних індексів за останні 12 місяців діяльності фонду.

*** - Розрахунки коефіцієнтів Шарпа та Сортино здійснювались 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, складала 12,7%. Мінімальний рівень доходності для розрахунків коефіцієнта Сортино приймався на рівні 10,0%.

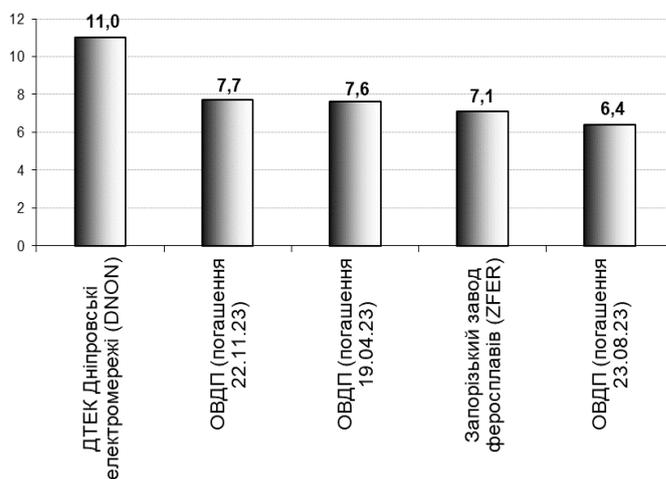
Динаміка ВЧА/інвестиційний сертифікат у порівнянні з еталоном



Вкладення за класами активів, %



Найбільші позиції портфеля, %



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

Що стосується ІФ «Достаток», то з 10 жовтня 2022 року по 10 січня 2023 року показники фонду скоротились на 11,5%: вартість інвестиційного сертифіката знизилась з 6,24 грн до 5,52 грн, а загальна вартість чистих активів – на 1,32 млн грн і склала 10,12 млн гривень. Бенчмарк фонду – відносний композиційний індекс ринку – впав на 6,3% за звітний період.

На виконання рішення засідання Ставки Верховного Головнокомандувача Збройних Сил України 6 листопада 2022 р. відповідно до Закону України «Про передачу, примусове відчуження або вилучення майна в умовах правового режиму воєнного чи надзвичайного стану», відбулося примусове відчуження у власність держави акцій стратегічно важливих підприємств, серед яких «Укрнафта» та «Мотор Січ». Вилучені акції набули статусу військового майна, а їх управління передано Міністерству оборони України. По завершенню воєнного стану відповідно до вимог Закону зазначені акції будуть або повернені власникам, або відшкодовано їх вартість. Національна комісія з цінних паперів та фондового ринку України, зі свого боку, схвалила рішення про забезпечення проведення в системі депозитарного обліку депозитарних операцій щодо примусового відчуження у власність держави акцій вказаних товариств. Отже, 7 листопада 2022 р. з портфеля ІФ «Достаток» було вилучено акції «Укрнафти» на суму 594,0 тис. грн, що склало суттєву частину загального скорочення вартості чистих активів за квартал. Оскільки акції «Мотор Січ» були переоцінені до нульової вартості в попередньому кварталі, їх вилучення з портфеля не вплинуло на вартість чистих активів фонду.

Іншими складовими зміни вартості чистих активів фонду були вартісна переоцінка портфеля (-43,1 тис. грн), купонні виплати за облігаціями (+311,8 тис. грн), нараховані відсотки за депозитами та інші доходи (+34,6 тис. грн), поточні витрати на фінансування діяльності фонду (-26,0 тис. грн), а також списання сумнівної дебіторської заборгованості (-1,01 млн гривень).

У переоцінці портфеля ІФ «Достаток» субпортфель акцій зріс в оцінці на +52,0 тис. грн, а субпортфель облігацій знецінився на -95,1 тис. гривень. Серед акцій збільшились в оцінці «Райффайзен Банк» (+8,6 тис. грн), «Укрнафта» (+12,6 тис. грн) та «Центрэнерго» (+30,8 тис. грн), решта 12 позицій портфеля не змінили своєї оціночної вартості.

Щодо цінних паперів з фіксованим доходом, то мінус був обумовлений тим фактом, що випуски тих трьох облігацій, по яких купонний дохід продовжував накопичуватися у балансовій вартості, не змогли перекрити зниження курсової вартості тих восьми випусків, по яких у звітному періоді було здійснено поточне перерахування купонних платежів власникам.

У звітному періоді ІФ «Достаток» від погашення ОВДП 12 жовтня 2022 року фонд отримав 546,0 тис. грн (реалізована доходність без урахування реінвестицій купонів за 988 днів перебування паперів в активах фонду склала +35,5%) та придбав 1 035 акцій «Української біржі» на суму 518,0 тис. гривень.

Залишок вільних грошових коштів був розміщений на депозитах.