

Початок діяльності – 12 вересня 2005 р.

Динаміка	Фонд	Індекс ПФТС
Доходність за 3 квартал 2022 року	-1,47%	-11,39%
Доходність за 2021 рік	14,80%	7,49%
Середньорічна доходність	-4,41%	1,90%
Показники ризику**		
Стандартне відхилення	не розрах.	не розрах.
Коефіцієнт Шарпа	не розрах.	не розрах.
Коефіцієнт Сортіно	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 Сортіно здійснюються відповідно до методики, рекомендованої у статті У. Шарпа «The Sharpe Ratio» (<http://www.stanford.edu/~wfsnarpe/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 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



* - 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.

В країні продовжується війна. Загалом економічна ситуація в третьому кварталі покращилась, відновився експорт сільськогосподарської продукції, банківську систему стабілізовано, військова економічна та гуманітарна допомога набирає обертів, обмінний курс гривні до твердих валют укріплювався. Основним чинником з яким це пов'язують – успіхи ЗСУ на полі бою.

У 3 кварталі 2022 року індекс українських акцій Української біржі (Індекс UX) продемонстрував падіння на -11,39% від рівня кінця другого кварталу 2022 року. На дату закриття торгової сесії 30 вересня його значення склало 1522,84 пунктів проти 1787,5 пунктів 30 червня. З початку року Індекс UX показує падіння на рівні -12,6%.

Чисті активи Фонду на кінець 3 кварталу склали 3 915 553,16 гривень, вартість чистих активів в розрахунку на одну акцію Фонду в обігу склала 4 633,79 гривень. Середньорічна доходність Фонду склала -4,39%.

Продовжуються заходи з реструктуризації портфеля фонду та продажу об'єкту незавершеного будівництва ТРЦ.