

ДОСТАТОК

Початок діяльності – 11 вересня 2003 р.

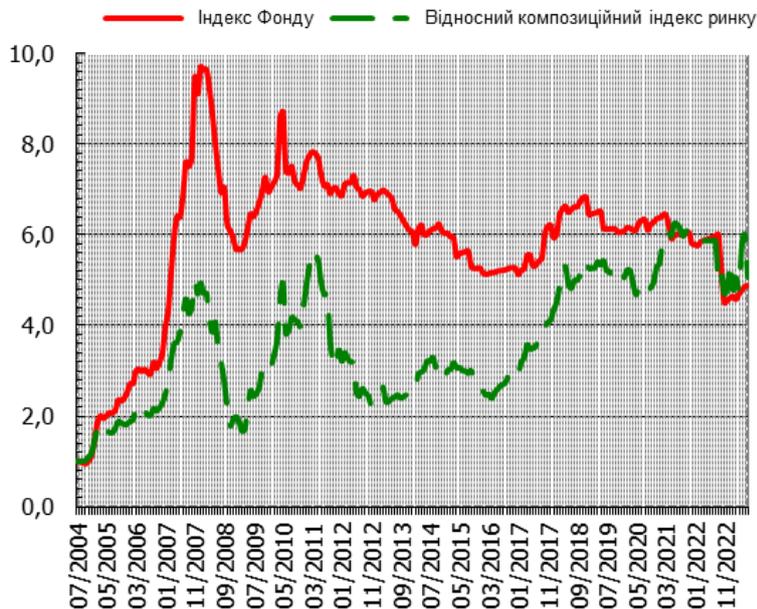
Динаміка	Фонд	Композиційний індекс ринку
Доходність за 2 квартал 2023 року*	3,7%	5,0%
Доходність за 2022 рік	-20,4%	-8,6%
Середньорічна доходність (з 1 липня 2004 року)	8,7%	8,9%
Показники ризику**		
Стандартне відхилення	40,9%	40,6%
Коефіцієнт Шарпа***	від'ємн.	0,63
Коефіцієнт Сортіно***	від'ємн.	0,67
Альфа	-7,4%	
Бета	-0,3	
Коефіцієнт кореляції	-0,3	

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

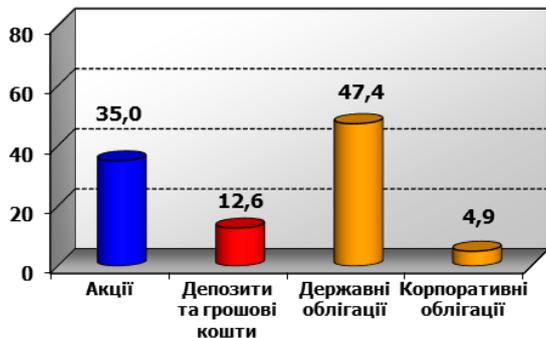
** - Показники ризику та співвідношення доходностей до ризиків для фонду та індексу розраховувалися за величинами щомісячної вартості чистих активів у розрахунку на цінний папір та значеннями відповідних індексів за останні 12 місяців діяльності фонду.

*** - Розрахунки коефіцієнтів Шарпа та Сортіно здійснювалися 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 18,2%. Мінімальний рівень доходності для розрахунків коефіцієнта Сортіно приймався на рівні 10,0%.

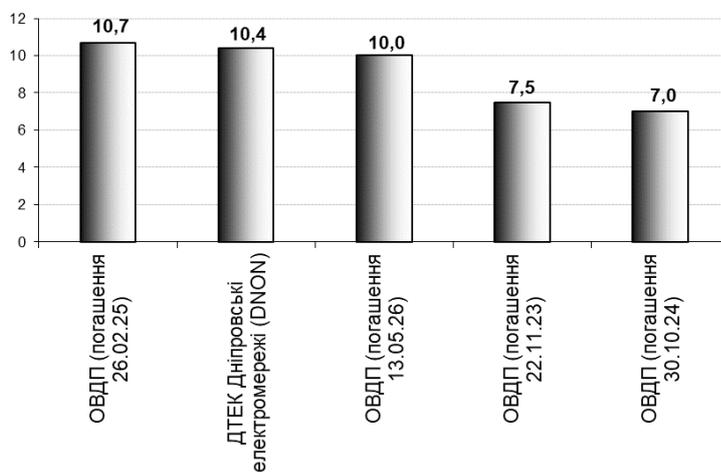
Динаміка ВЧА/інвестиційний сертифікат у порівнянні з еталоном



Вкладення за класами активів, %



Найбільші позиції портфеля, %



Інформація про загальну ситуацію на фондових ринках надана у [«Звіті про діяльність ІФ «КІНТО-Еквіті» за другий квартал 2023 року»](#), що розповсюджується паралельно з цим.

Щодо ІФ «Достаток», то з 10 квітня по 10 липня 2023 року показники фонду зросли на 3,7%: вартість інвестиційного сертифіката зросла з 5,63 грн до 5,83 грн, а загальна вартість чистих активів – на 377,1 тис. грн і склала 10,70 млн гривень. За цей період бенчмарк фонду – відносний композиційний індекс ринку – зріс на 5,0%.

Складниками зміни вартості чистих активів фонду були вартісна переоцінка портфеля (+106,8 тис. грн), купонні виплати за облігаціями (+264,1 тис. грн), нараховані відсотки за депозитами (+58,3 тис. грн), поточні витрати на фінансування діяльності фонду (-52,1 тис. гривень).

У переоцінці портфеля ІФ «Достаток» субпортфель акцій зріс в оцінці на +6,3 тис. грн, а субпортфель облігацій зріс на +100,5 тис. гривень. Серед акцій збільшились в оцінці акції «Центренерго» (+23,0 тис. грн), а знецінились акції «Укренергомашин» (-3,7 тис. грн) та «Райффайзен Банку» (-12,9 тис. грн), решта 11 позицій портфеля не змінили своєї оціночної вартості.

Щодо цінних паперів з фіксованим доходом, то плюс був зумовлений тим фактом, що випуски тих п'яти облігацій, по яких купонний дохід продовжував накопичуватися у балансовій вартості, перекрили зниження курсової вартості тих чотирьох випусків, по яких у звітному періоді було здійснено поточне перерахування купонних платежів власникам.

У звітному періоді від погашення 740 штук ОВДП 19 квітня 2023 року фонд отримав 740,0 тис. грн (реалізована доходність без урахування реінвестицій купонів за 585 днів перебування паперів в активах фонду склала +18,0%), а від погашення 600 штук ОВДП 24 травня 2023 року – 600,0 тис. грн (реалізована доходність без урахування реінвестицій купонів за 286 днів перебування паперів в активах фонду склала +11,7%).

Отримані та інші вільні кошти направлено на придбання облігацій на загальну суму 1,79 млн грн, а саме:

- 330 штук ОВДП з датою погашення 13 травня 2026 р. на суму 270,7 тис. гривень;
- 290 штук ОВДП з датою погашення 26 лютого 2025 р. на суму 264,0 тис. гривень;
- 790 штук ОВДП з датою погашення 30 жовтня 2024 р. на суму 731,1 тис. гривень;
- 500 штук облігацій ТОВ «Нова пошта» серії D на суму 522,0 тис. гривень.

Середньорічна доходність ІФ «Достаток» з 1 липня 2004 року станом на 10 липня 2023 року склала +8,7%, що приблизно співмірно з аналогічним показником для індексу ринку, який становить +8,9%.