

ДОСТАТОК

Початок діяльності – 11 вересня 2003 р.

Динаміка	Фонд	Композиційний індекс ринку
Доходність за 4 квартал 2023 року*	3,5%	-17,8%
Доходність за 2023 рік	11,0%	6,9%
Середньорічна доходність (з 1 липня 2004 року)	8,7%	9,4%
Показники ризику**		
Стандартне відхилення	40,6%	48,9%
Коефіцієнт Шарпа***	від'ємн.	від'ємн.
Коефіцієнт Сортіно***	від'ємн.	1,88
Альфа	-30,3%	
Бета	-0,4	
Коефіцієнт кореляції	-0,6	

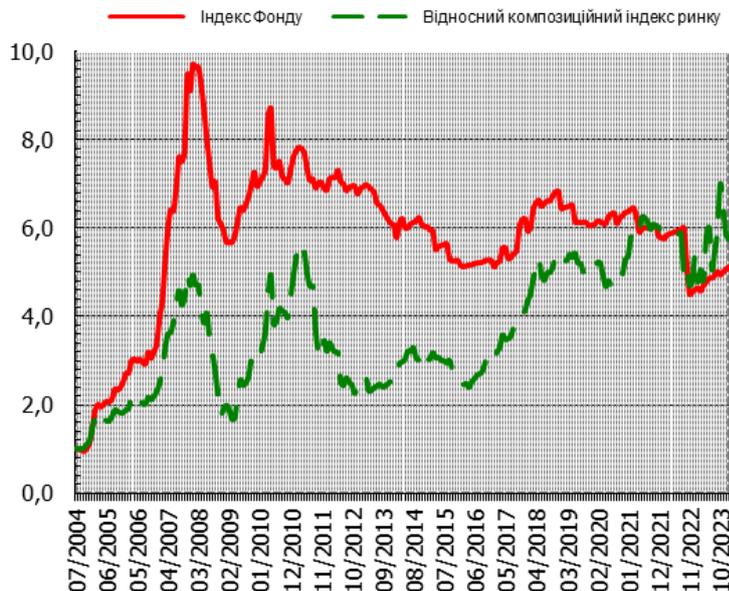
* - З жовтня 2012 року результати надаються на 10 число кожного місяця, тому звітний період охопив період, що не співпадає з четвертим кварталом – з 10 жовтня 2023 року по 10 січня 2024 року.

** - 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.

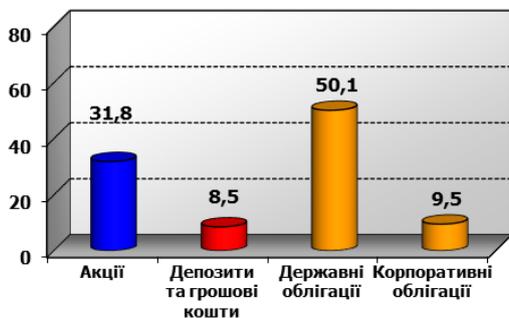
*** - Розрахунки коефіцієнтів Шарпа та Сортіно здійснювалися відповідно до методики, рекомендованої у статті У. Шарпа «The Sharpe Ratio» (<http://www.stanford.edu/~wfsarpe/art/sr/sr.htm>). Безризикова доходність для визначення коефіцієнта Шарпа, розрахована на основі доходностей ОВДП на ринку, складала 18,7%. Мінімальний рівень доходності для розрахунків коефіцієнта Сортіно приймався на рівні 10,0%.

Інтервальний диверсифікований пайовий інвестиційний фонд «Достаток»

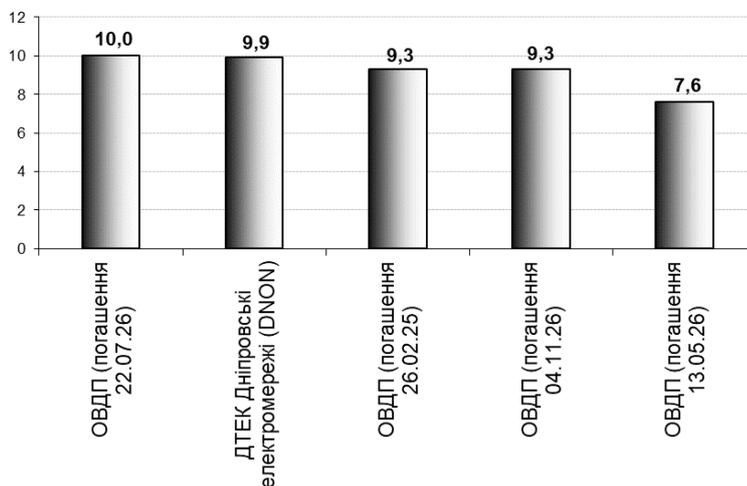
Динаміка ВЧА/інвестиційний сертифікат у порівнянні з еталоном



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 2023 року»](#), що розповсюджується паралельно з цим.

Щодо ІФ «Достаток», то з 10 жовтня 2023 року по 10 січня 2024 року показники фонду зросли на 3,5%: вартість інвестиційного сертифіката зросла з 5,92 грн до 6,13 грн, а загальна вартість чистих активів – на 378,4 тис. грн, і склала 11,24 млн гривень. За цей період бенчмарк фонду – відносний композиційний індекс ринку – впав на 17,8%.

Складниками зміни вартості чистих активів фонду були вартісна переоцінка портфеля (+110,9 тис. грн), купонні виплати за облігаціями (+275,2 тис. грн), нараховані відсотки за депозитами (+19,8 тис. грн), поточні витрати на фінансування діяльності фонду (-27,5 тис. гривень).

У переоцінці портфеля ІФ «Достаток» субпортфель акцій зріс в оцінці на +38,2 тис. грн за рахунок одного емітента – «Центрэнерго». Решта 12 позицій портфеля в акціях не змінили своєї оціночної вартості. Субпортфель облігацій зріс на +72,7 тис. гривень. Щодо цінних паперів з фіксованим доходом, то плюс був зумовлений тим фактом, що випуски тих чотирьох облігацій, по яких купонний дохід продовжував накопичуватися у балансовій вартості, перекрыли зниження курсової вартості тих семи випусків, по яких у звітному періоді було здійснено поточне перерахування купонних платежів власникам (+135,2 тис. грн та -62,5 тис. грн, відповідно).

У звітному періоді ІФ «Достаток» купив 540 штук корпоративних облігацій ТОВ «ЕСКА Капітал» серії Е на суму 542,5 тис. грн та 135 штук ОВДП з датою погашення 24 лютого 2027 р. на суму 142,6 тис. гривень.

Середньорічна доходність ІФ «Достаток» з 1 липня 2004 року станом на 10 січня 2024 року склала +8,7%, а аналогічний показник для індексу ринку становить +9,4%.