

ДОСТАТОК

Початок діяльності – 11 вересня 2003 р.

Динаміка	Фонд	Композиційний індекс ринку
Доходність за 1 квартал 2024 року*	2,8%	-21,9%
Доходність за 2023 рік	11,0%	6,9%
Середньорічна доходність (з 1 липня 2004 року)	8,7%	7,9%
Показники ризику**		
Стандартне відхилення	37,5%	55,2%
Коефіцієнт Шарпа***	від'ємн.	від'ємн.
Коефіцієнт Сортіно***	від'ємн.	1,56
Альфа	-30,2%	
Бета	-0,5	
Коефіцієнт кореляції	-0,8	

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

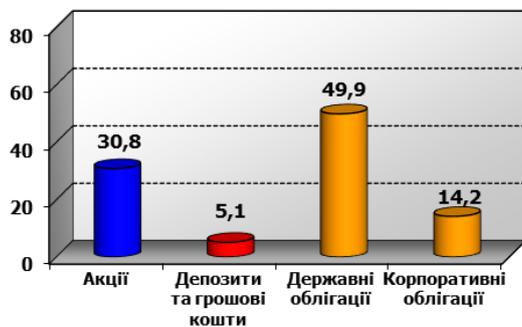
*** - Розрахунки коефіцієнтів Шарпа та Сортіно здійснювалися відповідно до методики, рекомендованої у статті У. Шарпа «The Sharpe Ratio» (<http://www.stanford.edu/~wfscharpe/art/sr/sr.htm>). Безризикова доходність для визначення коефіцієнта Шарпа, розрахована на основі доходностей ОВДП на ринку, складала 18,3%. Мінімальний рівень доходності для розрахунків коефіцієнта Сортіно приймався на рівні 10,0%.

Інтервальний диверсифікований пайовий інвестиційний фонд «Достаток»

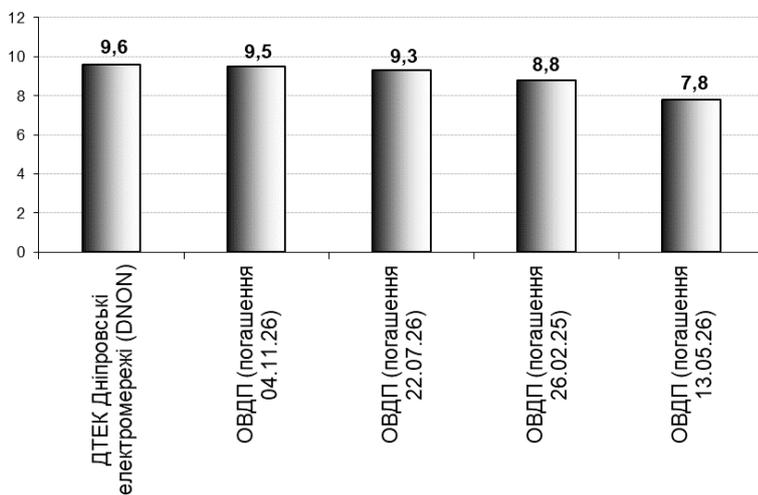
Динаміка ВЧА/інвестиційний сертифікат у порівнянні з еталоном



Вкладення за класами активів, %



Найбільші позиції портфеля, %



Інформація про загальну ситуацію на фондових ринках надана у [«Звіті про діяльність ІФ «КІНТО-Еквіті» за перший квартал 2024 року»](#), що розповсюджується паралельно з цим.

Щодо ІФ «Достаток», то з 10 січня 2024 року по 10 квітня 2024 року показники фонду зросли на 2,8%: вартість інвестиційного сертифіката зросла з 6,13 грн до 6,30 грн, а загальна вартість чистих активів – на 317,4 тис. грн, і склала 11,55 млн гривень. За цей період бенчмарк фонду – відносний композиційний індекс ринку – впав на 21,9%.

Складниками зміни вартості чистих активів фонду були вартісна переоцінка портфеля (+57,7 тис. грн), купонні виплати за облігаціями (+274,6 тис. грн), нараховані відсотки за депозитами (+8,3 тис. грн), поточні витрати на фінансування діяльності фонду (-23,1 тис. гривень).

У переоцінці портфеля ІФ «Достаток» субпортфель акцій знецінився на 19,4 тис. грн за рахунок одного емітента – «Райффайзен Банку». Решта 12 позицій портфеля в акціях не змінили своєї оціночної вартості. Субпортфель облігацій зріс на 77,0 тис. гривень. Щодо цінних паперів з фіксованим доходом, то плюс був зумовлений тим фактом, що випуски тих восьми облігацій, по яких купонний дохід продовжував накопичуватися у балансовій вартості, перекрыли зниження курсової вартості тих п'яти випусків, по яких у звітному періоді було здійснено поточне перерахування купонних платежів власникам (+166,0 тис. грн та -89,0 тис. грн, відповідно).

У звітному періоді ІФ «Достаток» купив 545 штук корпоративних облігацій ТОВ «РУШ» серії G на суму 559,8 тис. грн та 61 штуку ОВДП з датою погашення 7 липня 2027 р. на суму 63,7 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 +7,9%.