

ДОСТАТОК

Початок діяльності – 11 вересня 2003 р.

Динаміка	Фонд	Композиційний індекс ринку
Доходність за 2 квартал 2024 року*	4,4%	-9,1%
Доходність за 2023 рік	11,0%	6,9%
Середньорічна доходність (з 1 липня 2004 року)	8,9%	7,3%
Показники ризику**		
Стандартне відхилення	33,5%	54,3%
Коефіцієнт Шарпа***	від'ємн.	від'ємн.
Коефіцієнт Сортино***	від'ємн.	0,7
Альфа	-28,5%	
Бета	-0,4	
Коефіцієнт кореляції	-0,7	

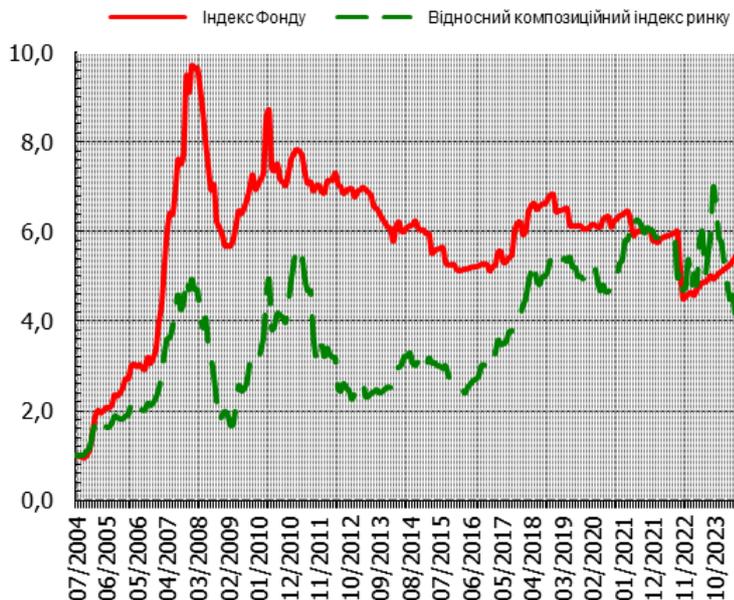
* - З жовтня 2012 року результати надаються на 10 число кожного місяця, тому звітний період охопив період, що не співпадає з четвертим кварталом – з 10 квітня 2024 року по 10 липня 2024 року.

** - 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.

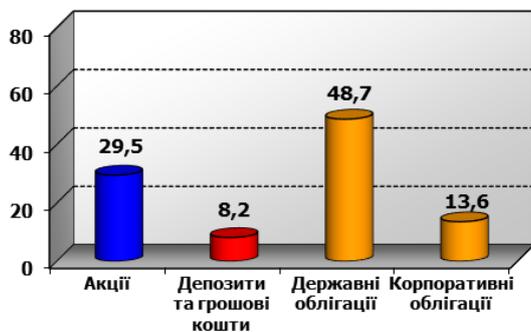
*** - Розрахунки коефіцієнтів Шарпа та Сортино здійснювалися відповідно до методики, рекомендованої у статті У. Шарпа «The Sharpe Ratio» (<http://www.stanford.edu/~wfscharpe/art/sr/sr.htm>). Безризикова доходність для визначення коефіцієнта Шарпа, розрахована на основі доходностей ОВДП на ринку, складала 17,5%. Мінімальний рівень доходності для розрахунків коефіцієнта Сортино приймався на рівні 10,0%.

Інтервальний диверсифікований пайовий інвестиційний фонд «Достаток»

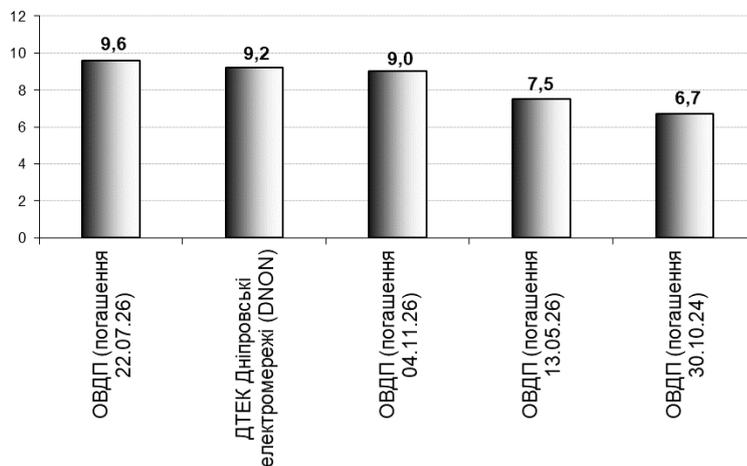
Динаміка ВЧА/інвестиційний сертифікат у порівнянні з еталоном



Вкладення за класами активів, %



Найбільші позиції портфеля, %



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

Щодо ІФ «Достаток», то з 10 квітня 2024 року по 10 липня 2024 року показники фонду зросли на 4,4%: вартість інвестиційного сертифіката зросла з 6,30 грн до 6,57 грн, а загальна вартість чистих активів – на 505,9 тис. грн, і склала 12,06 млн гривень. За цей період бенчмарк фонду – відносний композиційний індекс ринку – впав на 9,1%.

Складниками зміни вартості чистих активів фонду були вартісна переоцінка портфеля (+197,1 тис. грн), купонні виплати за облігаціями (+344,7 тис. грн), нараховані відсотки за депозитами (+0,9 тис. грн), поточні витрати на фінансування діяльності фонду (–36,9 тис. гривень).

У переоцінці портфеля ІФ «Достаток» субпортфель акцій додав 3,6 тис. грн за рахунок одного емітента – «Райффайзен Банку». Решта 12 позицій портфеля в акціях не змінили своєї оціночної вартості. Субпортфель облігацій зріс на 193,5 тис. гривень. Щодо цінних паперів з фіксованим доходом, то плюс був зумовлений тим фактом, що випуски тих семи 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 (+254,4 тис. грн та –60,8 тис. грн, відповідно).

У звітному періоді від погашення 200 штук ОВДП 22 травня 2024 року фонд отримав 200,0 тис. грн (реалізована доходність без урахування реінвестицій купонів за 1 050 днів перебування паперів в активах фонду склала +34,9%). Також, фонд продав 800 штук ОВДП з датою погашення 26 лютого 2025 р. на суму 926,7 тис. гривень.

На вільні кошти ІФ «Достаток» поповнив свій портфель державними облігаціями на загальну суму 1,04 млн грн, а саме:

- 550 штук ОВДП з датою погашення 4 червня 2025 р. на суму 578,8 тис. гривень;
- 420 штук ОВДП з датою погашення 7 липня 2027 р. на суму 466,1 тис. гривень.

Середньорічна доходність ІФ «Достаток» з 1 липня 2004 року станом на 10 липня 2024 року склала +8,9%, а аналогічний показник для індексу ринку становить +7,3%.