

Початок діяльності – 27 травня 2008 р.

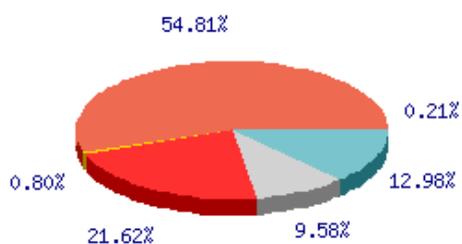
Динаміка	Фонд	Індекс ПФТС
Доходність за II квартал 2020 року	-1,07%	-6,07%
Доходність за 2019 рік	-3,9%	-11,22%
Середньорічна доходність	-1,41%	-5,90%
Показники ризику**		
Стандартне відхилення	10,91%	15,33%
Коефіцієнт Шарпа	від'ємн.	від'ємн.
Коефіцієнт Сортіно	від'ємн.	від'ємн.
Альфа	0,08%	
Бета	0,46	
Коефіцієнт кореляції	0,77	

** - Показники ризику та співвідношення доходностей до ризиків для фондів та індексів розраховуються за величинами щоденної 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/~wfsjarpe/art/sr/sr.htm>). Безризикова доходність для визначення коефіцієнта Шарпа, розрахована на основі доходностей ОВДП на ринку, складає 13,1%. Мінімальний рівень доходності для розрахунків коефіцієнта Сортіно приймається на рівні 20,0%.

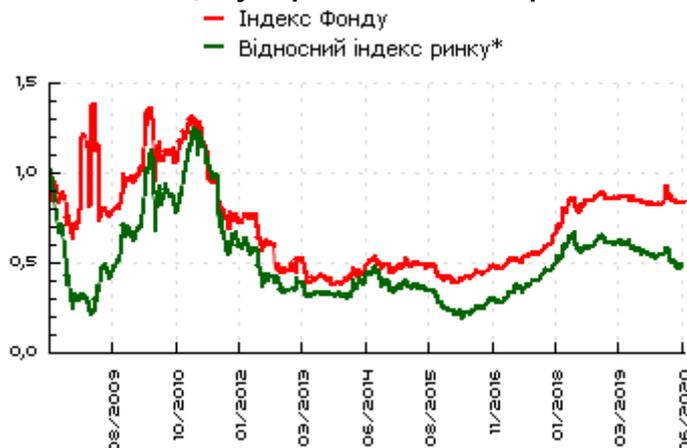
Вкладення акцій за галузями

- Металургія
- Вугільна промисловість
- Фінансовий сектор
- Машинобудування
- Енергетика
- Нафта та газ



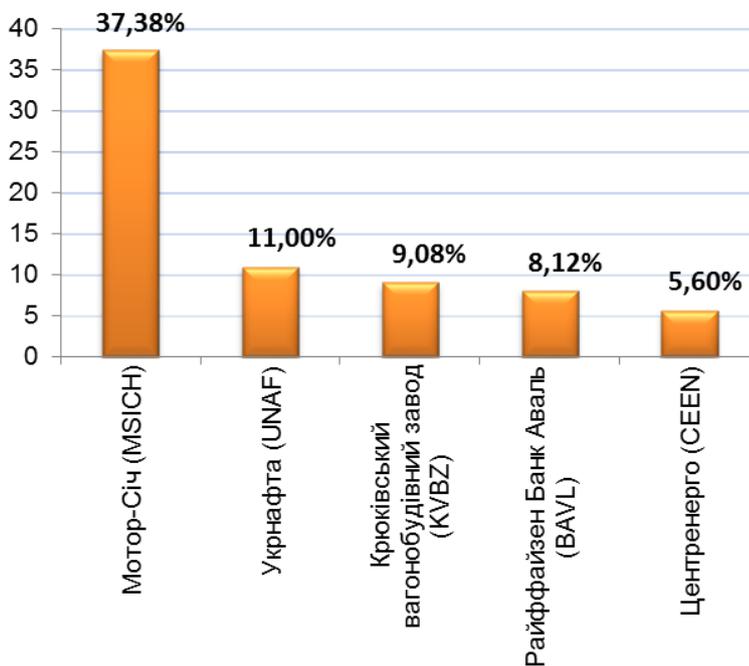
Публічне акціонерне товариство "Закритий недиверсифікований корпоративний інвестиційний фонд "Синергія-7"

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 (27 травня 2008 р.), що дорівнювало 909,40; з 1 січня 2014 р. бенчмарком Фонду є індекс Української біржі.

Найбільші позиції портфеля



Інформація про загальну ситуацію на фондових ринках надана у [«Звіті про діяльність ІФ «КІНТО-Еквіті» за другий квартал 2020 року»](#), що розповсюджується паралельно з даним.

Щодо ІФ «Синергія-7», то протягом квітня-червня 2020 року показники фонду знизилися на 1,1%: вартість чистих активів у розрахунку на акцію – з 8 516,31 до 8 425,02 грн, а загальна ВЧА зменшилася на 68,7 тис. грн (з 6,41 до 6,34 млн гривень).

Однією з головних складових зменшення ВЧА фонду в другому кварталі 2020 року була переоцінка портфеля (-35,8 тис. грн), яка склалася в результаті позитивної оцінки позиції «Райффайзен Банку Аваль» (+8,9 тис. грн) та негативної оцінки 2-х емітентів: «Донбасенерго» (-24,9 тис. грн) та «Центренерго» (-19,8 тис. гривень). Решта позицій, а саме 12, не змінили своєї курсової вартості.

До активів фонду додалися отримані дивіденди (+18,2 тис. грн) за акціями «Житомиробленерго», нараховані в поточному періоді відсотки за банківськими депозитами (+11,8 тис. грн), які скоригувалися необхідними поточними витратами на функціонування фонду (-63,0 тис. гривень).

У підсумку і склався той результат, що продемонстрував ІФ «Синергія-7» у першому кварталі 2020 року: -1,1% доходності, який виявився вищим за показник за аналогічний період часу бенчмарку фонду – індексу УБ (-6,1%).

Щодо активних транзакцій, то протягом звітного періоду була поповнена позиція «Центренерго» (4 800 шт. за 29,8 тис. грн), а також до портфелю було придбано акції емітента «Українська біржа» (310 шт. за 310,0 тис. гривень).

Статистика по всім операціям ІФ «Синергія-7» міститься в закритій частині коментарів керуючого (розділ "Статистичні дані" вкладки "[Портфель](#)").