



Публічне акціонерне товариство "ЗНКІФ "Синергія Клуб"

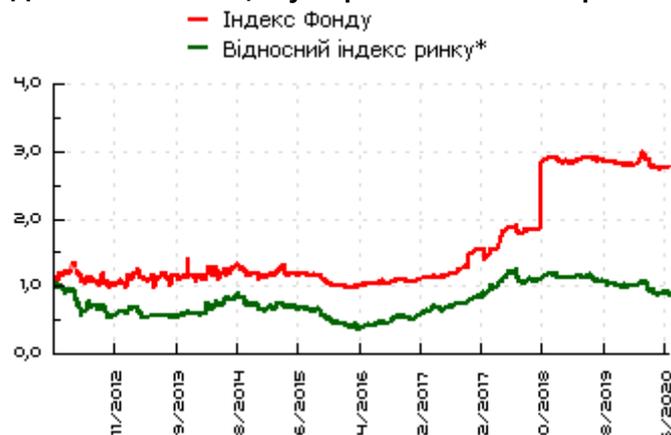
Початок діяльності – 26 січня 2012 р.

Динаміка	Фонд	Індекс ринку
Доходність за II квартал 2020 року	-0,65%	-6,07%
Доходність за 2019 рік	-1,36%	-11,22%
Середньорічна доходність	12,92%	-0,93%
Показники ризику**		
Стандартне відхилення	5,56%	15,33%
Коефіцієнт Шарпа	від'ємн.	від'ємн.
Коефіцієнт Сортіно	від'ємн.	від'ємн.
Альфа	-0,34%	0,33
Бета	0,34	
Коефіцієнт кореляції	0,86	

** - 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.

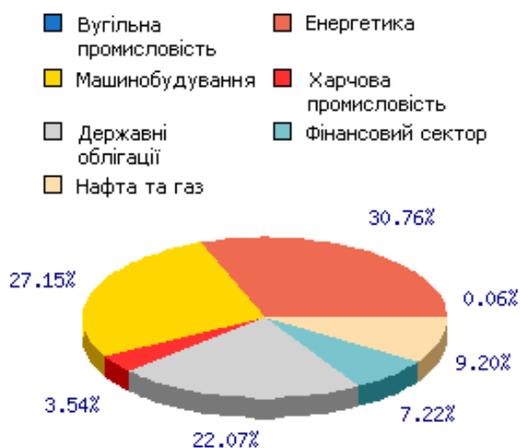
Розрахунки коефіцієнтів Шарпа та Сортіно здійснюються відповідно до методики, рекомендованої у статті У. Шарпа «The Sharpe Ratio» (<http://www.stanford.edu/~wfsarpe/art/sr/sr.htm>). Безризикова доходність для визначення коефіцієнта Шарпа, розрахована на основі доходностей ОВДП на ринку, складає 13,1%. Мінімальний рівень доходності для розрахунків коефіцієнта Сортіно приймається на рівні 20,0%.

Динаміка ВЧА/акцію у порівнянні з бенчмарком

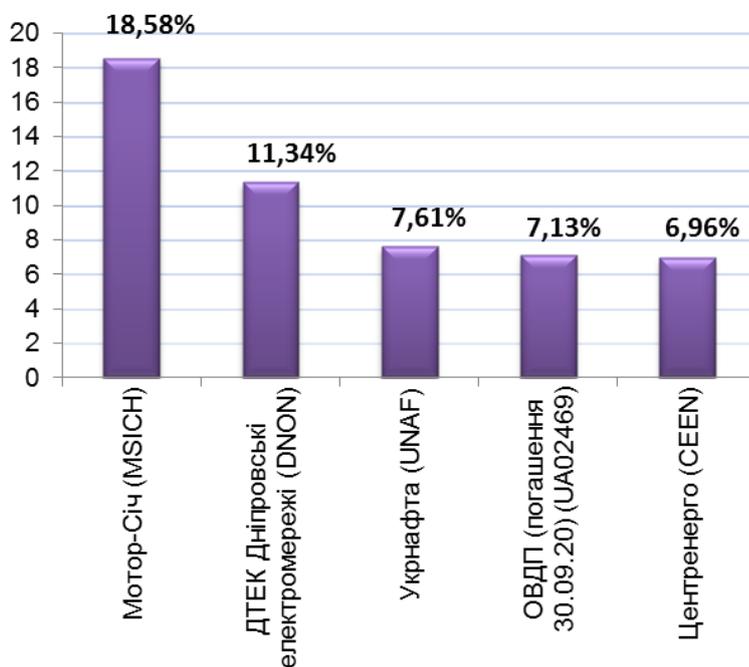


* - для зручності порівняння за умовну одиницю прийняті, відповідно, значення ВЧА/акція Фонду на початок діяльності (9 876,69 грн.) та значення індексу Української біржі на цю ж дату (26 січня 2012 р.), що дорівнювало 1426,75.

Вкладення за класами активів



Найбільші позиції портфеля



Інформація про загальну ситуацію на фондових ринках надана у [«Звіті про діяльність ІФ «КІНТО-Еквіті» за 2 квартал 2020 року»](#), що розповсюджується паралельно з цим.

Що стосується ІФ «Синергія Клуб», то протягом другого кварталу 2020 року показники фонду знизились на 0,7%: загальна вартість чистих активів фонду зменшилась на 243,3 тис. грн: з 37 млн. 703,7 тис. грн до 37 млн. 460,4 тис. грн, а ВЧА в розрахунку на одну акцію – з 27 702,95 грн до 27 524,16 гривень.

Позитивні накопичення принесли фонду купонні виплати за облігаціями внутрішньої державної позики на суму 263,9 тис. грн, а також відсотки за депозитами розміром 92,7 тис. гривень. На забезпечення функціонування ІФ «Синергія Клуб» було витрачено 264,0 тис. гривень.

Ну а сумарний від'ємний баланс склався в результаті переоцінки вартості портфеля на –336,0 тис. гривень. Остання відбулася в результаті негативної зміни вартості субпортфеля акцій (–485,5 тис. грн) та позитивної субпортфеля облігацій (+149,5 тис. гривень).

Серед акцій зміни в оцінці цінних паперів зафіксовані у 3-х емітентів: «Донбасенерго» (–363,6 тис. грн), «Центренерго» (–166,4 тис. грн) та «Райффайзен Банку Аваль» (+44,6 тис. гривень). Решта 12 компаній не змінили своєї курсової вартості.

Щодо облігацій, то сумарне збільшення облікової вартості відбулося за рахунок того, що більша кількість випусків продовжувала накопичувати свій купонний дохід.

Активні транзакції – це поповнення позиції «Крюківського вагонобудівного заводу» пакетом акцій на суму 270,0 тис. грн, погашення облігації внутрішньої державної позики (10 червня 2020 р) на суму 660,0 тис. грн та придбання 3-х випусків ОВДП: 530 шт. з датою погашення 3 серпня 2022 р. на суму 611,0 тис. грн., 150 шт. з датою погашення 8 липня 2020 р. на суму 154,8 тис. грн та 2 417 шт. з датою погашення 24 березня 2021 р. на суму 2 499,2 тис. гривень.

У підсумку і був зафіксований результат ІФ «Синергія Клуб» за звітний період – –0,7%, який виявився вищим за показник за аналогічний період часу бенчмарку фонду – індексу УБ (–6,1%).

Статистика по всім операціям ІФ «Синергія Клуб» протягом квітня-червня 2020 року міститься в [закритій частині коментарів керуючого](#) (розділ "Статистичні дані" вкладки "[Портфель](#)").