

Початок діяльності – 27 травня 2008 р.

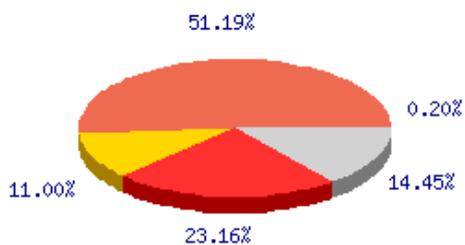
Динаміка	Фонд	Індекс ПФТС
Доходність за III квартал 2020 року	4,61%	-4,03%
Доходність за 2019 рік	-3,9%	-11,22%
Середньорічна доходність	-1,02%	-7,55%
Показники ризику**		
Стандартне відхилення	12,16%	18,68%
Коефіцієнт Шарпа	від'ємн.	від'ємн.
Коефіцієнт Сортіно	від'ємн.	від'ємн.
Альфа	0,69%	
Бета	0,50	
Коефіцієнт кореляції	0,73	

** - 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.

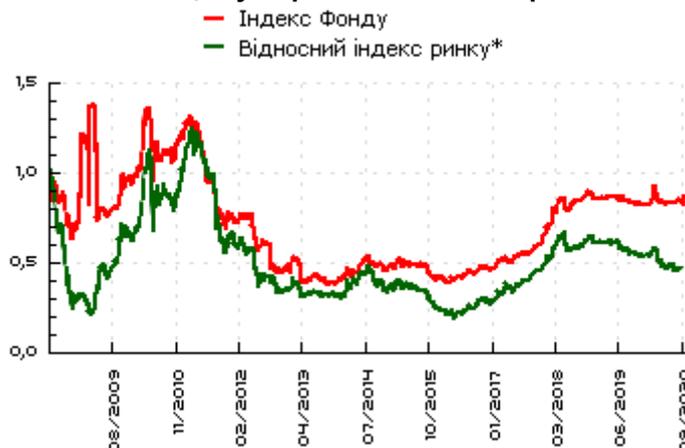
Розрахунки коефіцієнтів Шарпа та Сортіно здійснюються відповідно до методики, рекомендованої у статті У. Шарпа «The Sharpe Ratio» (<http://www.stanford.edu/~wfsjarpe/art/sr/sr.htm>). Безризикова доходність для визначення коефіцієнта Шарпа, розрахована на основі доходностей ОВДП на ринку, складає 8,4%. Мінімальний рівень доходності для розрахунків коефіцієнта Сортіно приймається на рівні 10,0%.

Вкладення акцій за галузями

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

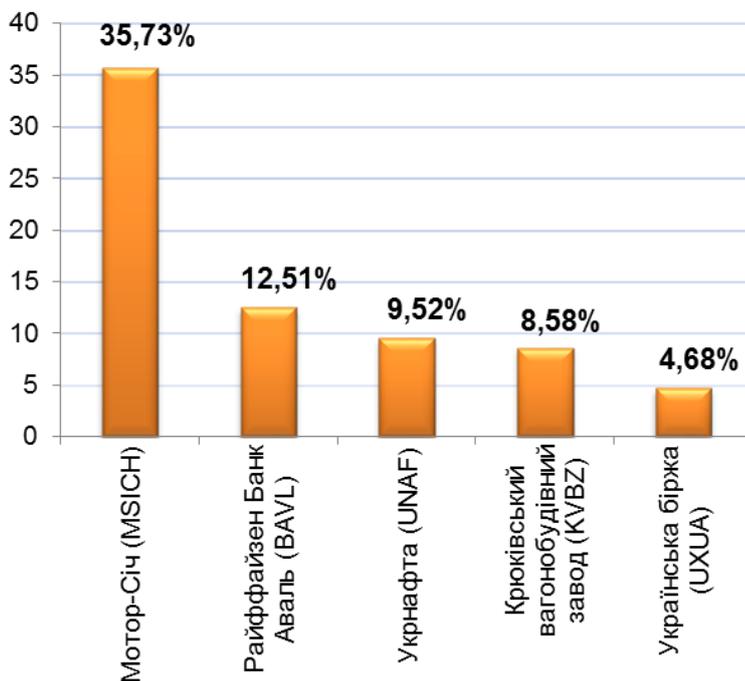


Динаміка ВЧА/акцію у порівнянні з бенчмарком



* - 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 третій квартал 2020 року](#), що розповсюджується паралельно з цим.

Що стосується ІФ «Синергія-7», то вартість чистих активів фонду в розрахунку на акцію за звітний період зросла з 8 425,02 грн до 8 813,17 грн, тобто на 4,6%. Еталон для порівняння фонду – індекс Української біржі UX, як було зазначено вище, знизився за цей період на 4,0%. Загальна вартість чистих активів зросла на 292,3 тис. грн (+4,6%) з 6,34 до 6,64 млн гривень.

Складовими зміни вартості чистих активів фонду були: вартісна переоцінка портфеля (+347,8 тис. грн), нараховані відсотки за депозитами (+5,0 тис. грн), а також поточні витрати на фінансування діяльності фонду (–60,5 тис. гривень).

Переоцінка вартості портфеля ІФ «Синергія-7» склалася в результаті таких складових. Знецінилися акції «Центренерго» (–92,6 тис. грн), «Укрнафти» (–65,5 тис. грн) та «Крюківського вагонобудівного заводу» (–1,7 тис. грн), а позитивний доробок фонду принесли цінні папери «Шахтоуправління «Покровське» (+353,8 тис. грн), «Райффайзен Банку Аваль» (+148,4 тис. грн), «ДТЕК Дніпровські електромережі» (+3,0 тис. грн) та «Донбасенерго» (+2,5 тис. гривень). Решта позицій, а саме 11, не змінили своєї курсової вартості.

Щодо активних транзакцій, то була закрита позиція «Шахтоуправління «Покровське» в портфелі. 124 000 акцій були продані за значно вищою ціною, ніж до цього обліковувалися (3,2 грн./шт. у порівнянні з 0,35 грн/шт.), на загальну суму 396,8 тис. гривень. Крім того, у фонду на біржі був акцептований невеликий пакет акцій «Крюківського вагонобудівного заводу» (300 шт. на суму 5,0 тис. гривень).

Отримані кошти були реінвестовані: поповнені позиції «ДТЕК Дніпровські електромережі» – 600 акцій за 210,0 тис. грн, «Райффайзен Банку Аваль» – 420 000 шт. за 165,9 тис. грн, «Центренерго» – 8 000 шт. за 42,4 тис. грн та «Донбасенерго» – 120 шт. за 2,1 тис. грн на загальну суму 420,4 тис. гривень.