

Початок діяльності – 14 листопада 2007 р.

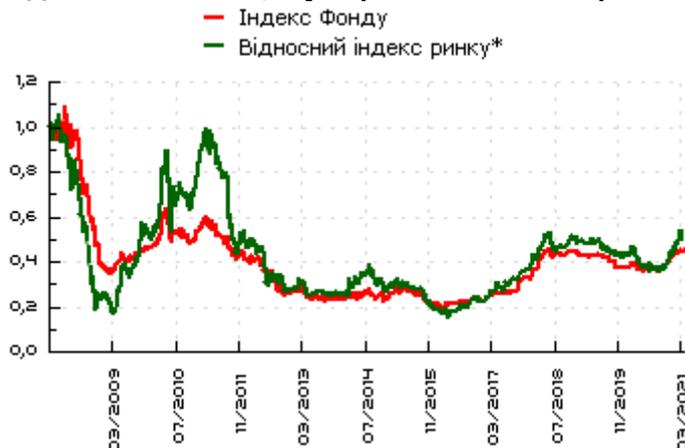
Динаміка	Фонд	Індекс ринку
Доходність за I квартал 2021 року	6,59%	15,92%
Доходність за 2020 рік	13,71%	6,48%
Середньорічна доходність	-5,58%	-4,48%
Показники ризику**		
Стандартне відхилення	9,86%	21,86%
Коефіцієнт Шарпа***	1,52	1,11
Коефіцієнт Сортино***	1,72	0,92
Альфа	0,39%	
Бета	0,35	
Коефіцієнт кореляції	0,79	

** - Показники ризику та співвідношення доходностей до ризиків для фондів та індексів розраховуються за величинами вартості чистих активів у розрахунку на цінний папір та значеннями відповідних індексів за останні 12 місяців діяльності фонду.

*** - Розрахунки коефіцієнтів Шарпа та Сортино 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 **10,4%**. Мінімальний рівень доходності для розрахунків коефіцієнта Сортино приймається на рівні **10,0%**.

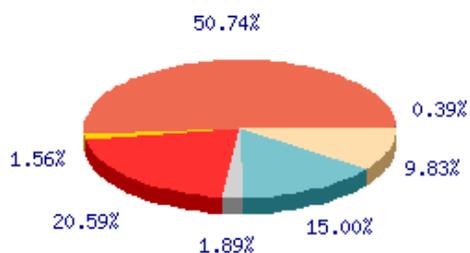
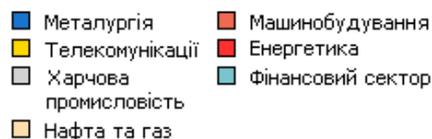
Обчислення показників альфи, бети та кореляції здійснюється на основі щомісячних даних; всіх інших показників – на основі щоденних даних за останній рік діяльності фонду.

Динаміка ВЧА/акцію у порівнянні з бенчмарком

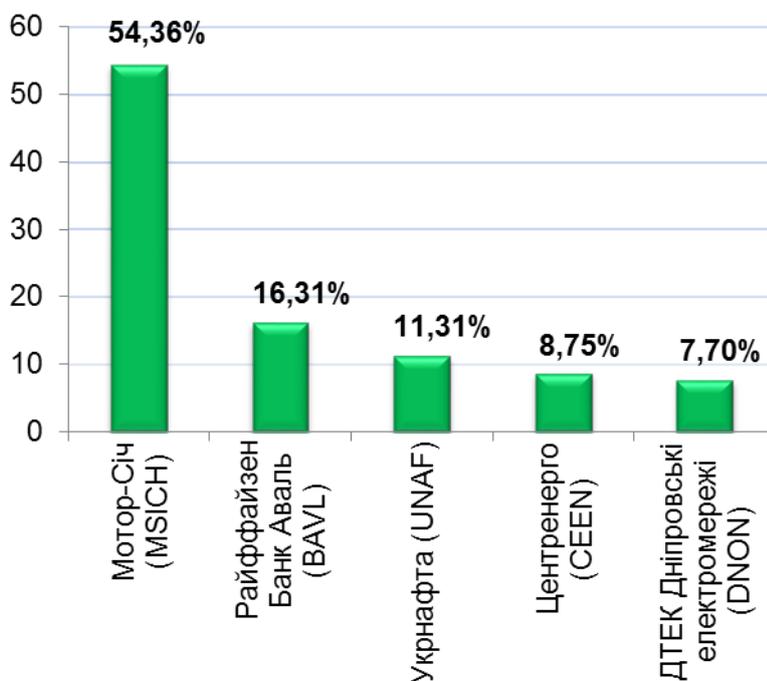


* - для зручності порівняння за умовну одиницю прийняті, відповідно, значення ВЧА/акція Фонду на початок діяльності (10 000 грн.) та значення індексу ПФТС на цю ж дату (14 листопада 2007 р.), що дорівнювало 1143,28; з 1 січня 2014 р. бенчмарком Фонду є індекс Української біржі.

Вкладення акцій за галузями



Найбільші позиції портфеля



Інформація про загальну ситуацію на фондових ринках надана у [Звіті про діяльність ІФ «КІНТО-Еквіті» за перший квартал 2021 року](#), що розповсюджується паралельно з цим.

Що стосується ІФ «Синергія-5», то протягом першого кварталу 2021 року показники фонду зросли на 6,6%: загальна вартість чистих активів зросла на 1,40 млн грн: з 21 млн 256,7 тис. грн до 22 млн 657,4 тис. грн, а ВЧА в розрахунку на одну акцію – з 4 347,86 грн до 4 634,37 гривень. Бенчмарк фонду – індекс Української біржі UX – показав зростання 15,9% за звітний період.

Складовими зміни вартості чистих активів фонду були вартісна переоцінка портфеля (+1,47 млн грн), купонні виплати за облігаціями внутрішньої державної позики (+0,07 млн грн), нараховані відсотки за депозитами (+0,02 млн грн), а також поточні витрати на фінансування діяльності фонду (–0,16 млн гривень).

Переоцінка вартості портфеля ІФ «Синергія-5» склалася в результаті позитивної переоцінки вартості субпортфеля акцій (+1 млн 497,7 тис. грн) та негативної зміни вартості субпортфеля облігацій (–31,4 тис. гривень).

Позитивний доробок фонду принесли цінні папери «Укрнафти» (+666,0 тис. грн), «Райффайзен Банку Аваль» (+491,2 тис. грн) та «Центренерго» (+340,5 тис. гривень). Решта 11 позицій в акціях не змінили своєї курсової вартості.

Щодо облігацій, то з двох позицій фонду одна показала зростання оцінки (+19,8 тис. грн), по іншій зниження облікової вартості (–51,2 тис. грн) пов'язане з перерахування купонних платежів власникам.

У звітному періоді ІФ «Синергія-5» поповнив свій портфель акціями «Укрнафти» на суму 82,2 тис. грн та акціями «Чернігівобленерго» на суму 36,4 тис. гривень.