

Початок діяльності – 14 листопада 2007 р.

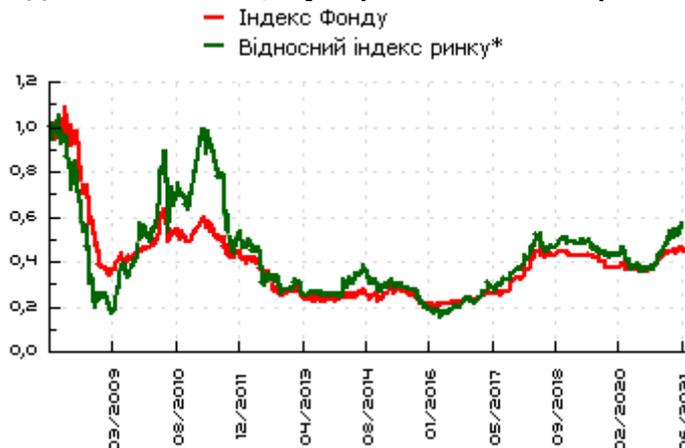
Динаміка	Фонд	Індекс ринку
Доходність за II квартал 2021 року	-1,74%	4,63%
Доходність за 2020 рік	13,71%	6,48%
Середньорічна доходність	-5,60%	-4,28%
Показники ризику**		
Стандартне відхилення	10,52%	24,06%
Коефіцієнт Шарпа***	1,30	1,38
Коефіцієнт Сортино***	1,29	1,24
Альфа	-0,07%	
Бета	0,41	
Коефіцієнт кореляції	0,73	

** - 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 **10,5%**. 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.

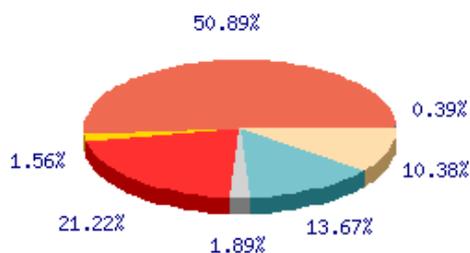
Динаміка ВЧА/акцію у порівнянні з бенчмарком



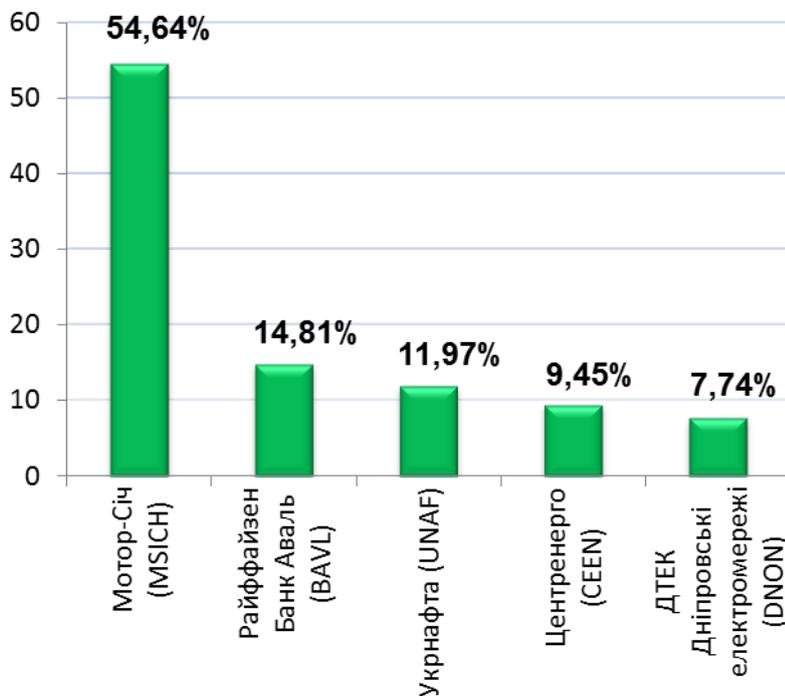
* - для зручності порівняння за умовну одиницю прийняті, відповідно, значення ВЧА/акція Фонду на початок діяльності (10 000 грн.) та значення індексу ПФТС на цю ж дату (14 листопада 2007 р.), що дорівнювало 1143,28; з 1 січня 2014 р. бенчмарком Фонду є індекс Української біржі.

Вкладення акцій за галузями

- Металургія
- Телекомунікації
- Харчова промисловість
- Нафта та газ
- Машинобудування
- Енергетика
- Фінансовий сектор



Найбільші позиції портфеля



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

Що стосується ІФ «Синергія-5», то протягом другого кварталу 2021 року показники фонду знизились на 1,7%: загальна вартість чистих активів скоротилась на 394,5 тис. грн: з 22 млн 657,4 тис. грн до 22 млн 262,9 тис. грн, а ВЧА в розрахунку на одну акцію – з 4 634,37 грн до 4 553,67 гривень. Бенчмарк фонду – індекс Української біржі UX – показав зростання 4,6% за звітний період.

Складовими зміни вартості чистих активів фонду були вартісна переоцінка портфеля (–294,4 тис. грн), поточні витрати на фінансування діяльності фонду (–165,6 тис. грн) купонні виплати за облігаціями внутрішньої державної позики (+46,4 тис. грн) та нараховані відсотки за депозитами (+19,1 тис. гривень).

Переоцінка вартості портфеля ІФ «Синергія-5» склалася в результаті негативної переоцінки вартості субпортфелів акцій (–289,8 тис. грн) та облігацій (–4,6 тис. гривень).

Позитивний доробок фонду принесли цінні папери «Центренерго» (+146,6 тис. грн), а знецінилися після проходження екс-дивідендних дат пакети акцій «Райффайзен Банку Аваль» (–359,0 тис. грн) та «Укрнафти» (–77,4 тис. гривень). Решта 11 позицій в акціях не змінили своєї курсової вартості.

Щодо облігацій, то з двох позицій фонду одна показала зростання оцінки (+26,1 тис. грн), по іншій зниження облікової вартості (–30,8 тис. грн) було пов'язане з перерахування купонних платежів власникам.

У червні ІФ «Синергія-5» продав два пакети акцій «Укрнафти» на загальну суму 61,9 тис. грн: 80 акцій за ціною 293 грн./шт. та 130 акцій за ціною 296 грн./штуку.