

Початок діяльності – 14 листопада 2007 р.

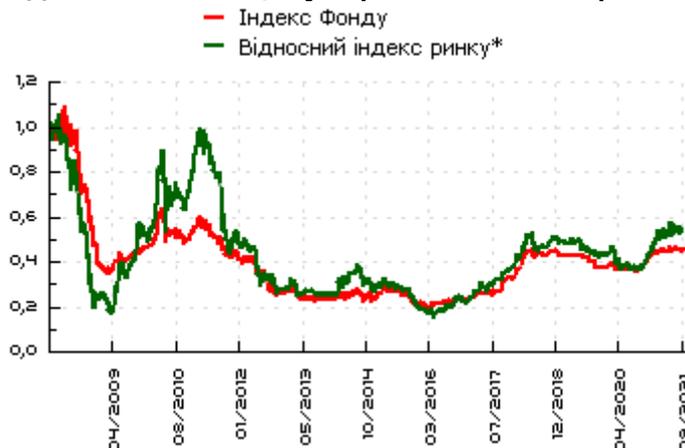
Динаміка	Фонд	Індекс ринку
Доходність за III квартал 2021 року	0,58%	-6,58%
Доходність за 2020 рік	13,71%	6,48%
Середньорічна доходність	-5,47%	-4,53%
Показники ризику**		
Стандартне відхилення	10,06%	22,21%
Коефіцієнт Шарпа***	1,15	1,27
Коефіцієнт Сортино***	1,14	1,25
Альфа	-0,20%	
Бета	0,42	
Коефіцієнт кореляції	0,80	

** - 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 11,1%. Мінімальний рівень доходності для розрахунків коефіцієнта Сортино приймається на рівні 10,0%.

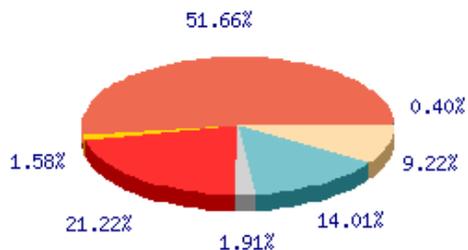
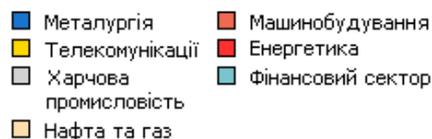
Обчислення показників альфи, бети та кореляції здійснюється на основі щомісячних даних; всіх інших показників – на основі щоденних даних за останній рік діяльності фонду.

Динаміка ВЧА/акцію у порівнянні з бенчмарком

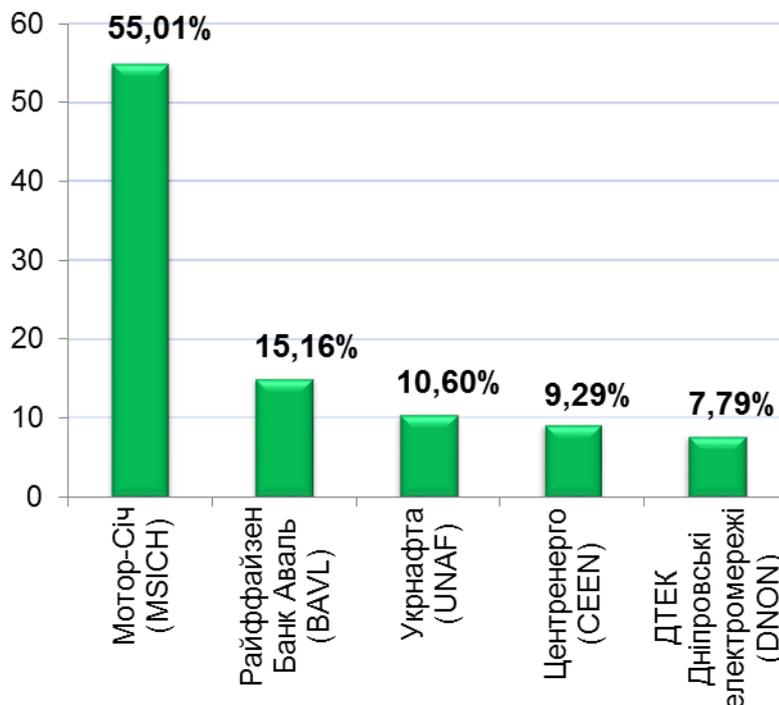


* - для зручності порівняння за умовну одиницю прийняті, відповідно, значення ВЧА/акція Фонду на початок діяльності (10 000 грн.) та значення індексу ПФТС на цю ж дату (14 листопада 2007 р.), що дорівнювало 1143,28; з 1 січня 2014 р. бенчмарком Фонду є індекс Української біржі.

Вкладення акцій за галузями



Найбільші позиції портфеля



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

Що стосується ІФ «Синергія-5», то протягом третього кварталу 2021 року показники фонду зросли на 0,6%: загальна вартість чистих активів зросла на 128,1 тис. грн з 22 млн 262,9 тис. грн до 22 млн 391,0 тис. грн, а ВЧА в розрахунку на одну акцію – з 4 553,67 грн до 4 579,88 гривень. Бенчмарк фонду – індекс Української біржі UX – показав падіння на 6,6% за звітний період.

Складовими зміни вартості чистих активів фонду були вартісна переоцінка портфеля (-110,1 тис. грн), поточні витрати на фінансування діяльності фонду (-152,6 тис. грн), отримані дивіденди на акції «Центренерго» та «Райффайзен Банку» за 2020 рік (+269,0 тис. грн), купонні виплати за облігаціями внутрішньої державної позики (+115,1 тис. грн) та нараховані відсотки за депозитами (+6,8 тис. гривень).

Переоцінка вартості портфеля ІФ «Синергія-5» склалася в результаті негативної переоцінки вартості субпортфелів акцій (-40,0 тис. грн) та облігацій (-70,2 тис. гривень).

Позитивний доробок фонду принесли цінні папери «Укрнафти» (+27,9 тис. грн), а знецінилися пакети акцій «Райффайзен Банку» (-18,9 тис. грн) та «Центренерго» (-49,0 тис. гривень). Решта 11 позицій в акціях не змінили своєї курсової вартості.

Щодо облігацій, то з трьох позицій фонду одна показала зростання оцінки (+14,9 тис. грн), по двох інших зниження облікової вартості (-85,0 тис. грн) було пов'язане з перерахування купонних платежів власникам.

У звітному періоді фонд проводив такі активні операції:

- купівля 100 штук ОВДП з датою погашення 3 серпня 2022 р. на суму 111,7 тис. гривень;
- купівля 680 штук ОВДП з датою погашення 23 серпня 2023 р. на суму 690,4 тис. гривень;
- купівля 3 900 акцій «Крюківського вагонобудівного заводу» на суму 76,1 тис. гривень;
- купівля 70 акцій «Укрнафти» на суму 18,9 тис. гривень;
- короткострокові операції зворотного РЕПО з двома пакетами акцій «Укрнафти» (1 200 штук та 909 штук) на суми закриття 305,0 тис. грн та 204,0 тис. гривень.