

Початок діяльності – 27 травня 2008 р.

Динаміка	Фонд	Індекс ПФТС
Доходність за III квартал 2021 року	0,11%	-6,58%
Доходність за 2020 рік	17,22%	6,48%
Середньорічна доходність	1,08%	-3,06%
Показники ризику**		
Стандартне відхилення	14,94%	22,21%
Коефіцієнт Шарпа***	1,39	1,27
Коефіцієнт Сортино***	1,97	1,25
Альфа	0,82%	
Бета	0,30	
Коефіцієнт кореляції	0,38	

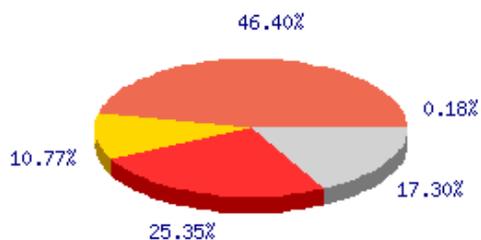
** - Показники ризику та співвідношення доходностей до ризиків для фондів та індексів розраховуються за величинами вартості чистих активів у розрахунку на цінний папір та значеннями відповідних індексів за останні 12 місяців діяльності фонду.

*** - 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.

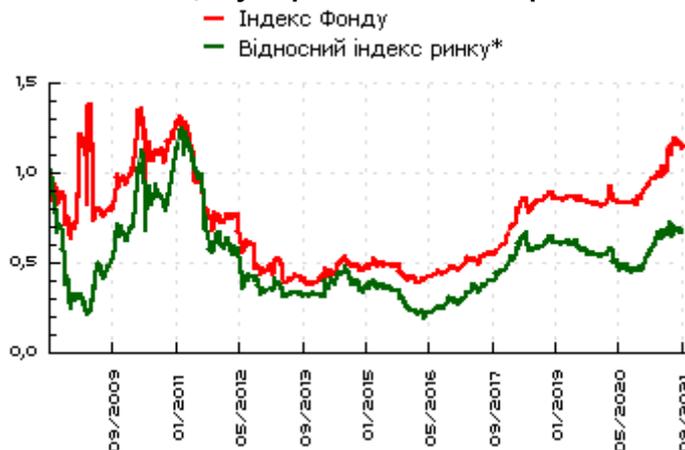
Вкладення акцій за галузями

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



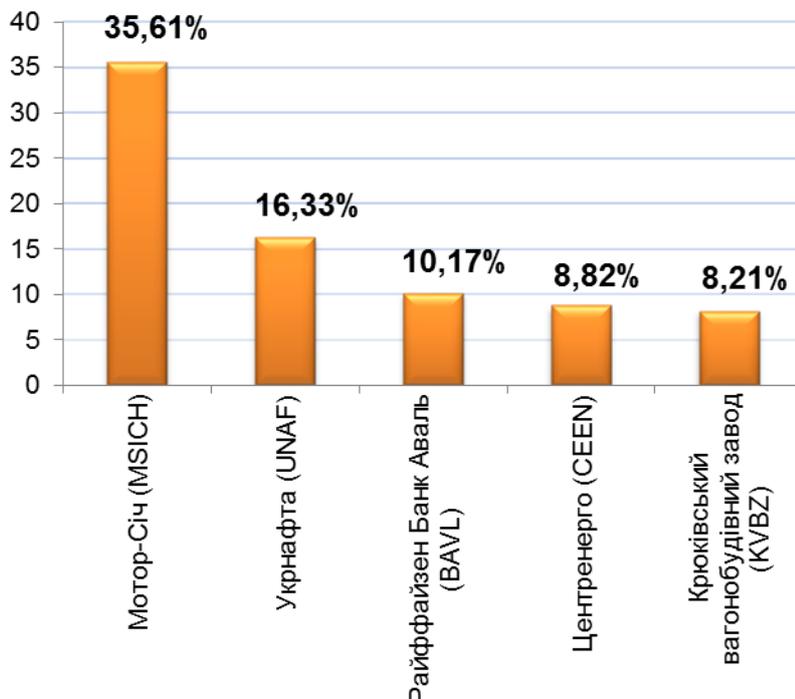
Публічне акціонерне товариство "Закритий недиверсифікований корпоративний інвестиційний фонд "Синергія-7"

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 2021 року](#), що розповсюджується паралельно з цим.

Що стосується ІФ «Синергія-7», то вартість чистих активів фонду в розрахунку на акцію за звітний період трохи зросла з 11 537,24 грн до 11 549,81 грн, тобто на 0,1%. Еталон для порівняння фонду – індекс Української біржі UX – впав за цей період на 6,6%. Загальна вартість чистих активів збільшилась на 7,2 тис. грн і склала 6,63 млн гривень.

Складовими зміни вартості чистих активів фонду були вартісна переоцінка портфеля (–37,5 тис. грн), нараховані відсотки за депозитами (+24,1 тис. грн), отримані дивіденди на акції «Центренерго», «Райффайзен Банку» за 2020 рік та «Харківобленерго» за 2018 рік (+71,7 тис. грн), а також поточні витрати на фінансування діяльності фонду (–51,1 тис. гривень).

У вартісній переоцінці портфеля незначний позитивний доробок фонду принесли лише цінні папери «Укрнафти» (+128,0 грн), а знецінилися пакети акцій «Донбасенерго» (–11,3 тис. грн), «Райффайзен Банку» (–12,5 тис. грн) та «Центренерго» (–13,8 тис. гривень). Решта дев'ять позицій не змінили своєї курсової вартості.

У звітному періоді фонд продав цінні папери на загальну суму 544,3 тис. грн, а саме 1 310 акцій «Укрнафти» на суму 331,8 тис. грн та 500 000 акцій «Райффайзен Банку» на суму 212,5 тис. гривень.