



Початок діяльності – 26 січня 2012 р.

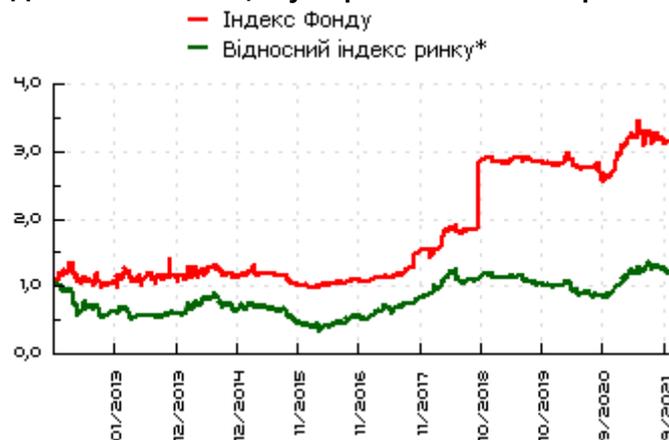
Динаміка	Фонд	Індекс ринку
Доходність за III квартал 2021 року	-0,04%	-6,58%
Доходність за 2020 рік	9,75%	6,48%
Середньорічна доходність	12,61%	2,62%
Показники ризику**		
Стандартне відхилення	14,54%	22,21%
Коефіцієнт Шарпа***	0,82	1,27
Коефіцієнт Сортино***	0,74	1,25
Альфа	-0,63%	
Бета	0,63	
Коефіцієнт кореляції	0,65	

\*\* - 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/~wfscharpe/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.

Публічне акціонерне товариство "ЗНКІФ  
"Синергія Клуб"

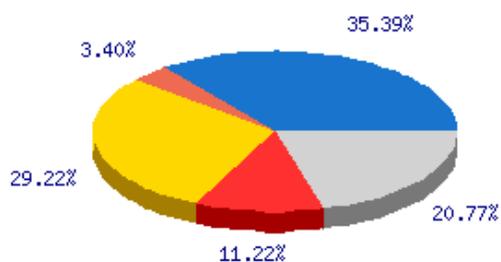
Динаміка ВЧА/акцію у порівнянні з бенчмарком



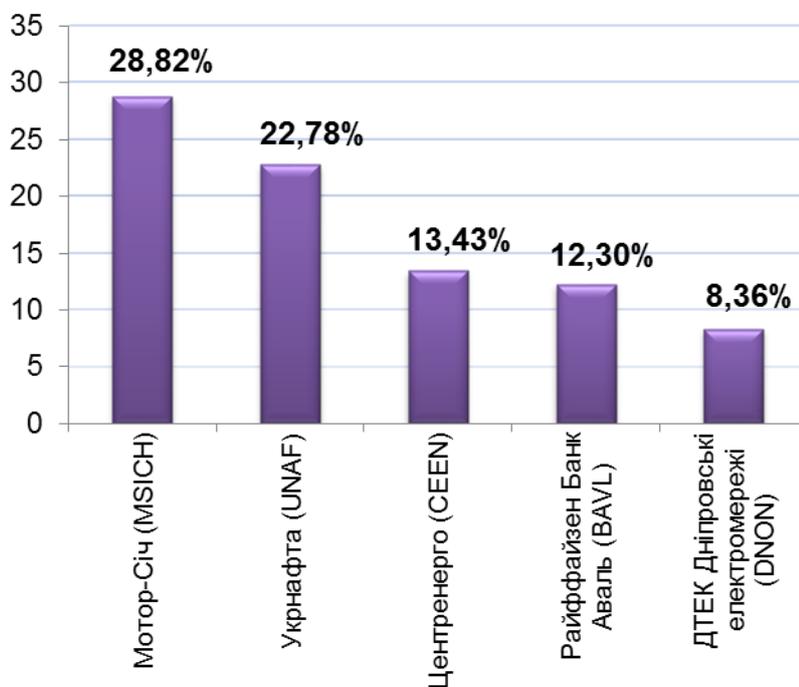
\* - для зручності порівняння за умовну одиницю прийняті, відповідно, значення ВЧА/акція Фонду на початок діяльності (9 876,69 грн.) та значення індексу Української біржі на цю ж дату (26 січня 2012 р.), що дорівнювало 1426,75.

Розподіл акцій за галузями

- Машинобудування
- Державні облігації
- Енергетика
- Фінансовий сектор
- Нафта та газ



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 Клуб», то вартість чистих активів фонду в розрахунку на акцію за звітний період знизилась з 31 224,22 грн до 31 211,42 грн, тобто на -0,04%. Еталон для порівняння фонду – індекс Української біржі UX – знизився за цей період на -6,6%. Загальна вартість чистих активів знизилась на 9,9 тис. грн: з 24,04 до 24,03 млн гривень.

Складовими зміни вартості чистих активів фонду були вартісна переоцінка портфеля (-123,5 тис. грн), поточні витрати на фінансування діяльності фонду (-159,6 тис. грн), отримані дивіденди на акції «Центренерго», «Райффайзен Банку» за 2020 рік та «Харківобленерго» за 2018 рік (+247,6 тис. грн), купонні виплати за облігаціями внутрішньої державної позики (+24,4 тис. грн), нараховані відсотки за депозитами (+1,2 тис. гривень).

Переоцінка вартості портфеля ІФ «Синергія Клуб» склалася в результаті негативної переоцінки вартості субпортфелів акцій (-109,8 тис. грн) та облігацій (-13,6 тис. гривень).

Позитивний доробок фонду принесли цінні папери «Укрнафти» (+59,9 тис. грн), а знецінилися пакети акцій «Райффайзен Банку» (-16,5 тис. грн), «Центренерго» (-76,0 тис. грн) та «Донбасенерго» (-77,2 тис. гривень). Решта 8 позицій в акціях не змінили своєї курсової вартості. Щодо облігацій, то з двох позицій фонду одна показала зростання оцінки (+1,9 тис. грн), інша – зниження облікової вартості (-15,5 тис. грн), пов'язане з перерахування купонного платежу.

У звітному періоді фонд проводив такі активні операції:

- продаж 226 штук ОВДП з датою погашення 3 серпня 2022 р. на суму 252,9 тис. гривень;
- короткострокова операція зворотного РЕПО з 2 196 акціями «Укрнафти» на суму закриття 563,8 тис. гривень;

купівля 586 штук ОВДП з датою погашення 23 серпня 2023 р. на суму 565,0 тис. гривень.