

Початок діяльності – 14 листопада 2007 р.

Динаміка	Фонд	Індекс ринку
Доходність за I квартал 2022 року	1,12%	-1,14%
Доходність за 2021 рік	3,55%	7,49%
Середньорічна доходність	-5,32%	-4,75%
Показники ризику**		
Стандартне відхилення	7,41%	21,30%
Коефіцієнт Шарпа	від'ємн.	від'ємн.
Коефіцієнт Сортіно	від'ємн.	від'ємн.
Альфа	-0,67%	
Бета	0,26	
Коефіцієнт кореляції	0,48	

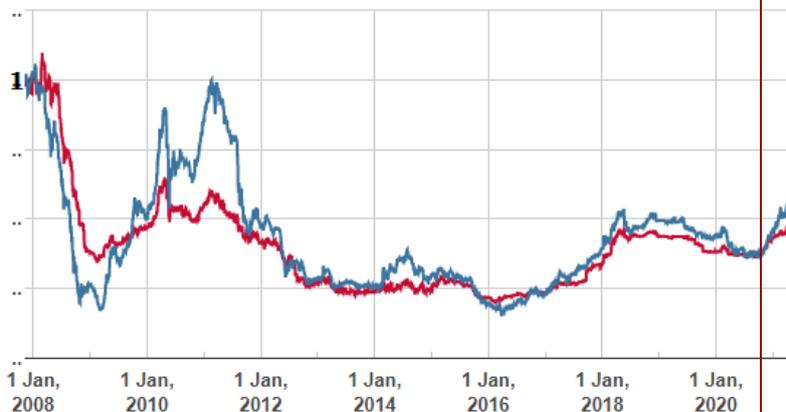
** - Показники ризику та співвідношення доходностей до ризиків для фондів та індексів розраховуються за величинами щоденної вартості чистих активів у розрахунку на цінний папір та значеннями відповідних індексів за останні 12 місяців діяльності фонду.

Розрахунки коефіцієнтів Шарпа та Сортіно 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 10,2%. Мінімальний рівень доходності для розрахунків коефіцієнта Сортіно приймається на рівні 10,0%.

Динаміка ВЧА/акцію у порівнянні з бенчмарком

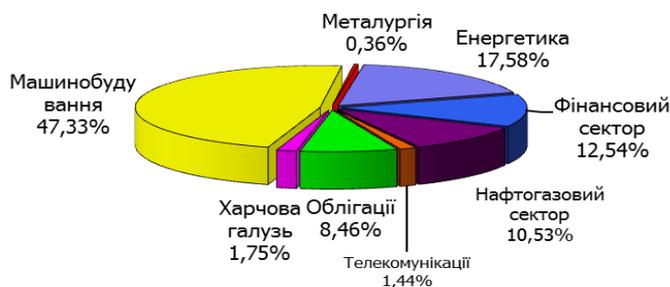
Динаміка вартості чистих активів

— Індекс Фонду — Відносний індекс ринку

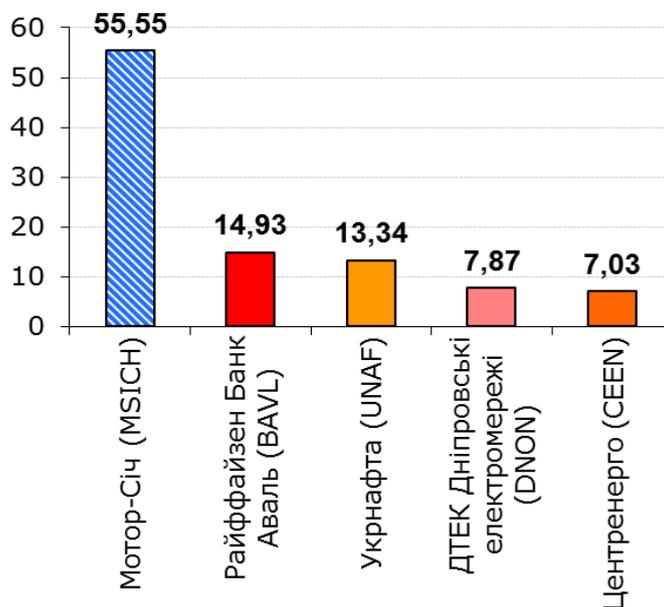


* - для зручності порівняння за умовну одиницю прийняті, відповідно, значення ВЧА/акція Фонду на початок діяльності (10 000 грн.) та значення індексу ПФТС на цю ж дату (14 листопада 2007 р.), що дорівнювало 1143,28; з 1 січня 2014 р. бенчмарком Фонду є індекс Української біржі.

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 2022 року](#), що розповсюджується паралельно з цим.

Що стосується ІФ «Синергія-5», то протягом першого кварталу 2022 року показники фонду зросли на 1,1%: загальна вартість чистих активів зростає на 246,3 тис. грн: з 22,01 млн грн до 22,26 млн грн, а ВЧА в розрахунку на одну акцію – з 4 502,21 грн до 4 552,58 гривень. Бенчмарк фонду – індекс Української біржі UX – показав падіння на 1,1% за звітний період.

Складовими зміни вартості чистих активів фонду були вартісна переоцінка портфеля (+286,7 тис. грн), поточні витрати на фінансування діяльності фонду (-149,6 тис. грн), купонні виплати за облігаціями внутрішньої державної позики (+107,6 тис. грн) та нараховані відсотки за депозитами (+1,6 тис. гривень).

Переоцінка вартості портфеля ІФ «Синергія-5» склалася в результаті позитивної переоцінки вартості субпортфелів акцій (+348,9 тис. грн) та негативної зміни для субпортфеля облігацій (-62,2 тис. гривень).

Позитивний доробок фонду принесли цінні папери «Укрнафти» (+410,5 тис. грн), а знецінились пакети акцій «Райффайзен Банку» (-46,1 тис. грн) та «Центренерго» (-15,5 тис. гривень). Решта 11 позицій в акціях не змінили своєї курсової вартості. Суттєва корекція оціночної вартості акцій «Укрнафти» відповідно до останнього біржового курсу компанії станом на 23 лютого 2022 р. (325,16 грн/акцію) відбулася як позитивна реакція ринку на те, що позачергові загальні збори акціонерів товариства 17 лютого 2022 р. не ухвалили рішення щодо поділу активів компанії між НАК «Нафтогаз України» і групою «Приват».

Щодо облігацій, то з чотирьох позицій фонду дві показали зростання оцінки (+16,1 тис. грн), і дві – зниження облікової вартості (-78,3 тис. грн), що було пов'язане з перерахування купонних платежів власникам.

У звітному періоді, а по суті в період з 1 січня по 23 лютого 2022 р., ІФ «Синергія-5» проводив такі активні операції:

- купівля 180 штук ОВДП з датою погашення 23 листопада 2022 р. на суму 183,0 тис. гривень;
- закриття операції зворотного РЕПО з 30 000 акцій «Центренерго» на суму 230,0 тис. гривень;

відкриття і закриття короткострокової операції зворотного РЕПО з 30 000 акцій «Центренерго» на суму закриття 228,1 тис. гривень.