

Початок діяльності – 14 листопада 2007 р.

Динаміка	Фонд	Індекс ринку
Доходність за IV квартал 2021 року	-1,70%	-5,13%
Доходність за 2021 рік	3,55%	7,49%
Середньорічна доходність	-5,49%	-4,74%
Показники ризику**		
Стандартне відхилення	8,47%	22,77%
Коефіцієнт Шарпа	від'ємн.	0,08
Коефіцієнт Сортіно	від'ємн.	від'ємн.
Альфа	-0,56%	
Бета	0,31	
Коефіцієнт кореляції	0,68	

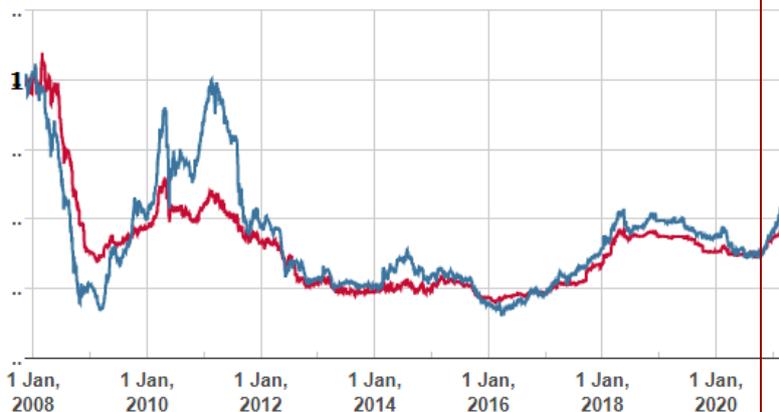
** - Показники ризику та співвідношення доходностей до ризиків для фондів та індексів розраховуються за величинами щоденної вартості чистих активів у розрахунку на цінний папір та значеннями відповідних індексів за останні 12 місяців діяльності фонду.

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

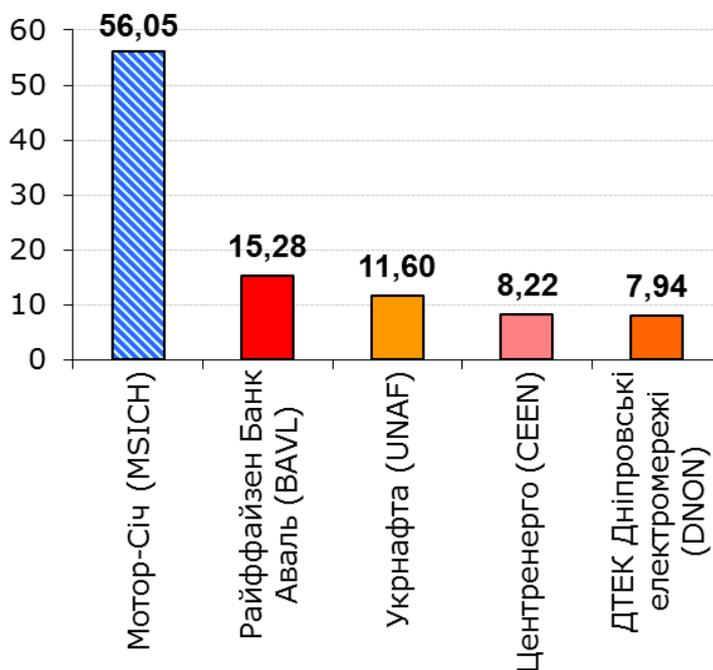


* - для зручності порівняння за умовну одиницю прийняті, відповідно, значення ВЧА/акція Фонду на початок діяльності (10 000 грн.) та значення індексу ПФТС на цю ж дату (14 листопада 2007 р.), що дорівнювало 1143,28; з 1 січня 2014 р. бенчмарком Фонду є індекс Української біржі.

Вкладення акцій за галузями



Найбільші позиції портфеля, %



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

Що стосується ІФ «Синергія-5», то протягом четвертого кварталу 2021 року показники фонду скоротились на 1,7%: загальна вартість чистих активів зменшилась на 379,7 тис. грн: з 22 млн 391,0 тис. грн до 22 млн 011,3 тис. грн, а ВЧА в розрахунку на одну акцію – з 4 579,88 грн до 4 502,21 гривень. Бенчмарк фонду – індекс Української біржі UX – показав падіння на 5,1% за звітний період.

Складовими зміни вартості чистих активів фонду були вартісна переоцінка портфеля (–274,3 тис. грн), поточні витрати на фінансування діяльності фонду (–153,7 тис. грн), купонні виплати за облігаціями внутрішньої державної позики (+46,4 тис. грн) та нараховані відсотки за депозитами (+1,8 тис. гривень).

Переоцінка вартості портфеля ІФ «Синергія-5» склалася в результаті негативної переоцінки вартості субпортфелів акцій (–295,3 тис. грн) та позитивної зміни для субпортфеля облігацій (+21,1 тис. гривень).

Позитивний доробок фонду принесли цінні папери «Укрнафти» (+167,0 тис. грн) та «Райффайзен Банку» (+37,8 тис. грн), а знецінився пакет акцій «Центренерго» (–500,1 тис. гривень). Решта 11 позицій в акціях не змінили своєї курсової вартості.

Щодо облігацій, то з трьох позицій фонду дві показали зростання оцінки (+52,8 тис. грн), а одна – зниження облікової вартості (–31,8 тис. грн), що було пов'язане з перерахування купонних платежів власникам.

У звітному періоді ІФ «Синергія-5» проводив такі активні операції:

- купівля 40 акцій «Укрнафти» на суму 9,6 тис. гривень;
- короткострокова операція зворотного РЕПО з 1 145 акціями «Укрнафти» на суму закриття 231,4 тис. гривень;
- відкриття операції зворотного РЕПО з 30 000 акцій «Центренерго» на суму 225,0 тис. гривень;
- продаж для фінансування поточних витрат 94 штук ОВДП з датою погашення 3 серпня 2022 р. на суму 100,7 тис. гривень.