

Початок діяльності – 14 листопада 2007 р.

Динаміка	Фонд	Індекс ринку
Доходність за 2 квартал 2022 року	-0,38%	0%
Доходність за 2021 рік	3,55%	7,49%
Середньорічна доходність	-5,26%	-4,62%
Показники ризику**		
Стандартне відхилення	не розрах.	не розрах.
Коефіцієнт Шарпа	не розрах.	не розрах.
Коефіцієнт Сортіно	не розрах.	не розрах.
Альфа	не розрах.	
Бета	не розрах.	
Коефіцієнт кореляції	не розрах.	

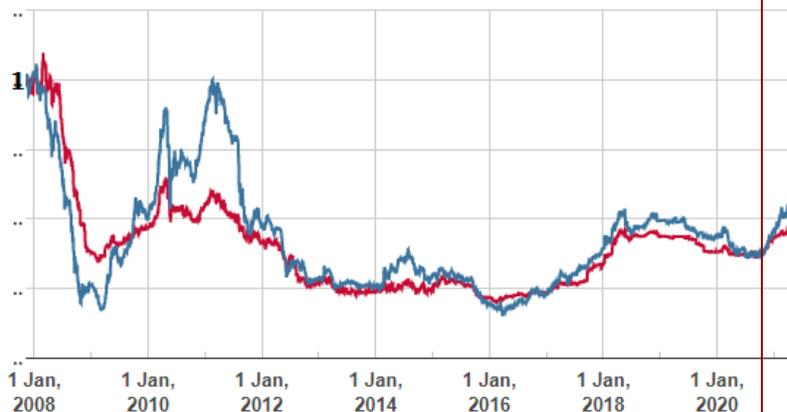
** - Показники ризику та співвідношення доходностей до ризиків для фондів та індексів розраховуються за величинами щоденної вартості чистих активів у розрахунку на цінний папір та значеннями відповідних індексів за останні 12 місяців діяльності фонду.

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 11,2%. 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

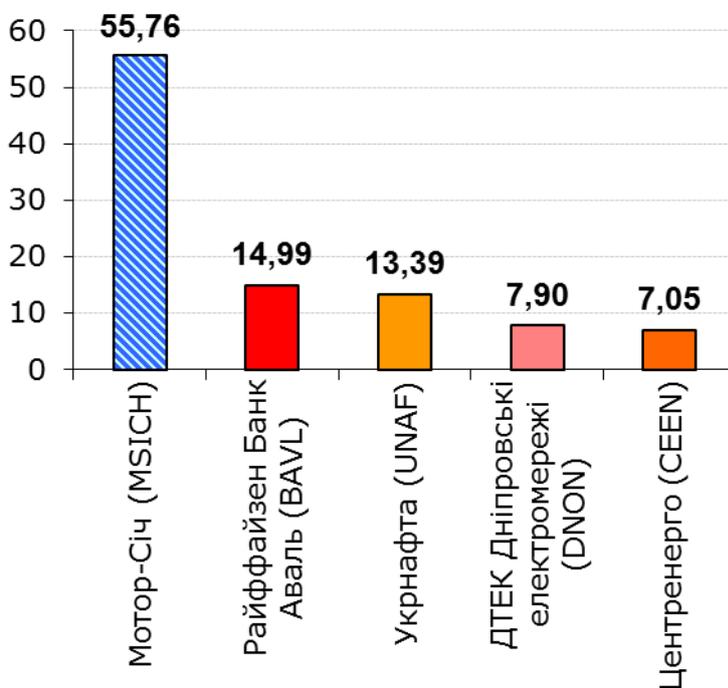


* - для зручності порівняння за умовну одиницю прийняті, відповідно, значення ВЧА/акція Фонду на початок діяльності (10 000 грн.) та значення індексу ПФТС на цю ж дату (14 листопада 2007 р.), що дорівнювало 1143,28; з 1 січня 2014 р. бенчмарком Фонду є індекс Української біржі.

Вкладення акцій за галузями



Найбільші позиції портфеля, %



Інформація про загальну ситуацію на фондових ринках надана у [Звіті про діяльність ІФ «КІНТО-Еквіті» за другий квартал 2022 року](#), що розповсюджується паралельно з цим.

Що стосується ІФ «Синергія-5», то протягом другого кварталу 2022 року показники фонду скоротились на 0,4%: загальна вартість чистих активів знизилась на 85,3 тис. грн з 22,26 млн грн до 22,17 млн грн, а ВЧА в розрахунку на одну акцію – з 4 552,58 грн до 4 535,14 гривень. Бенчмарк фонду – індекс Української біржі UX – під час дії воєнного стану не змінювався.

Складовими зміни вартості чистих активів фонду були вартісна переоцінка портфеля за рахунок субпортфеля облігацій (–19,8 тис. грн), поточні витрати на фінансування діяльності фонду (–150,6 тис. грн), купонні виплати за облігаціями внутрішньої державної позики (+83,9 тис. грн) та нараховані відсотки за депозитами (+1,2 тис. гривень).

Під час дії воєнного стану регулятором зупинено обіг цінних паперів, тому всі 14 позицій в акціях не змінили своєї курсової вартості. Щодо облігацій, то з п'яти позицій фонду дві продовжили накопичувати купонний дохід у балансовій вартості й показали зростання оцінки (+51,8 тис. грн), а три – зниження облікової вартості (–71,6 тис. грн), що було пов'язане з перерахування купонних платежів власникам.

У звітному періоді від погашення ОВДП 11 травня 2022 року фонд отримав 546,0 тис. грн (реалізована доходність без урахування реінвестицій купонів за 705 днів перебування паперів в активах фонду склала +19,6%). Це надходження фонд інвестував у так звані військові облігації, придбавши 500 штук ОВДП з датою погашення 21 червня 2023 р. на суму 521,1 тис. гривень.