

Початок діяльності – 14 листопада 2007 р.

Динаміка	Фонд	Індекс ринку
Доходність за IV квартал 2022 року	-39,9%	2,8%
Доходність за 2022 рік	-84,3%	-9,9%
Середньорічна доходність	-16,0%	-4,9%
Показники ризику**		
Стандартне відхилення		
Коефіцієнт Шарпа***		
Коефіцієнт Сортино***		
Альфа		
Бета		
Коефіцієнт кореляції		

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

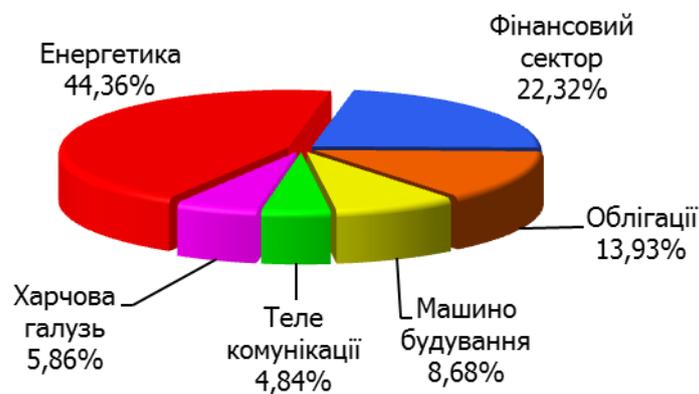
*** - Розрахунки коефіцієнтів Шарпа та Сортино здійснювалися відповідно до методики, рекомендованої у статті У. Шарпа «The Sharpe Ratio» (<http://www.stanford.edu/~wfsarpe/art/sr/sr.htm>). Безризикова доходність для визначення коефіцієнта Шарпа, розрахована на основі доходностей ОВДП на ринку, складала 12,7%. Мінімальний рівень доходності для розрахунків коефіцієнта Сортино приймався на рівні 10,0%.

Динаміка ВЧА/акцію у порівнянні з бенчмарком*

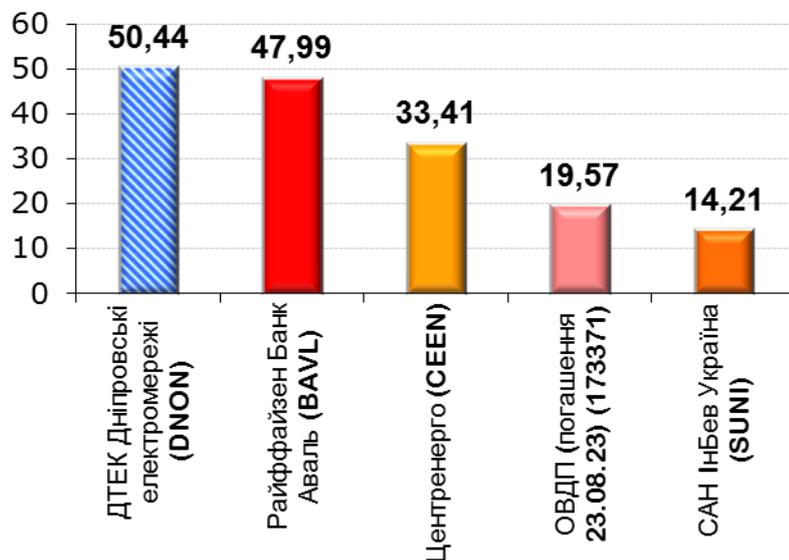


* - для зручності порівняння за умовну одиницю прийняті, відповідно, значення ВЧА/акція Фонду на початок діяльності (10 000 грн.) та значення індексу ПФТС на цю ж дату (14 листопада 2007 р.), що дорівнювало 1143,28; з 1 січня 2014 р. бенчмарком Фонду є індекс Української біржі.

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

Що стосується ІФ «Синергія-5», то протягом четвертого кварталу 2022 року показники фонду скоротились на 39,9%: загальна вартість чистих активів знизилась на 2,30 млн грн з 5,76 млн грн до 3,46 млн грн, а ВЧА в розрахунку на одну акцію – з 1 178,98 грн до 708,64 гривень. Бенчмарк фонду – індекс Української біржі UX – за цей період зріс на 2,8%.

На виконання рішення засідання Ставки Верховного Головнокомандувача Збройних Сил України 6 листопада 2022 р. відповідно до Закону України «Про передачу, примусове відчуження або вилучення майна в умовах правового режиму воєнного чи надзвичайного стану», відбулося примусове відчуження у власність держави акцій стратегічно важливих підприємств, серед яких «Укрнафта» та «Мотор Січ». Вилучені акції набули статусу військового майна, а їх управління передано Міністерству оборони України. По завершенню воєнного стану відповідно до вимог Закону зазначені акції будуть або повернені власникам, або відшкодовано їх вартість. Національна комісія з цінних паперів та фондового ринку України, зі свого боку, схвалила рішення про забезпечення проведення в системі депозитарного обліку депозитарних операцій щодо примусового відчуження у власність держави акцій вказаних товариств. Отже, 7 листопада 2022 р. з портфелю ІФ «Синергія-5» було виключено акції «Укрнафти» на суму 2,00 млн грн, що склало основну частину в загальному скороченні вартості чистих активів за квартал. Оскільки акції «Мотор Січ» були переоцінені до нульової вартості в попередньому кварталі, їх вилучення з портфеля не вплинуло на вартість чистих активів фонду.

Іншими складовими зміни вартості чистих активів фонду були вартісна переоцінка портфеля (-231,9 тис. грн), поточні витрати на фінансування діяльності фонду (-134,1 тис. грн), купонні виплати за облігаціями внутрішньої державної позики (+37,5 тис. грн) та нараховані відсотки за депозитами (+33,9 тис. гривень).

Переоцінка вартості портфеля ІФ «Синергія-5» склалася в результаті негативної переоцінки вартості субпортфеля акцій (-250,2 тис. грн) та позитивної зміни для субпортфеля облігацій (+18,3 тис. гривень).

Позитивний доробок фонду принесли цінні папери «Укрнафти» (+42,4 тис. грн), «Центренерго» (+109,0 тис. грн) та Крюківського вагонобудівного заводу (+133,5 тис. грн), а знецінився пакет акцій «Райффайзен Банку» (-535,0 тис. грн), біржовий курс акцій якого впав на 24,3%: з 0,2908 грн/акц. до 0,22 грн/акцію. Решта 8 позицій в акціях не змінили своєї курсової вартості.

Щодо облігацій, то з трьох позицій фонду одна показала зростання оцінки (+29,7 тис. грн), і дві – зниження облікової вартості (-11,4 тис. грн), що було пов'язане з перерахування купонних платежів власникам.

У звітному періоді від погашення ОВДП 23 листопада 2022 року фонд отримав 180,0 тис. грн (реалізована доходність без урахування реінвестицій купонів за 274 дні перебування паперів в активах фонду склала +9,3%).