

Початок діяльності – 27 травня 2008 р.

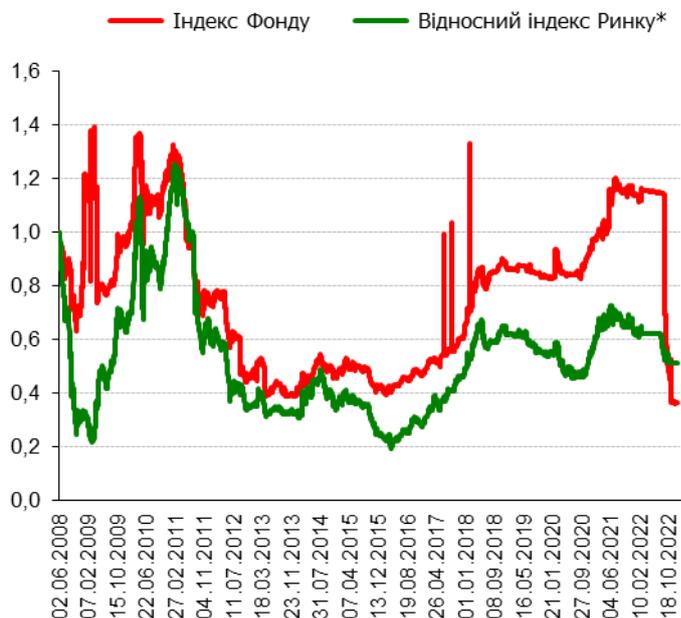
Динаміка	Фонд	Індекс ПФТС
Доходність за IV квартал 2022 року	-29,1%	2,8%
Доходність за 2022 рік	-68,0%	-9,9%
Середньорічна доходність	-6,7%	-3,8%
Показники ризику**		
Стандартне відхилення		
Коефіцієнт Шарпа		
Коефіцієнт Сортіно		
Альфа		
Бета		
Коефіцієнт кореляції		

** - 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 Сортіно 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 Сортіно приймався на рівні 10,0%.

Публічне акціонерне товариство "Закритий недиверсифікований корпоративний інвестиційний фонд "Синергія-7"

Динаміка ВЧА/акцію у порівнянні з бенчмарком

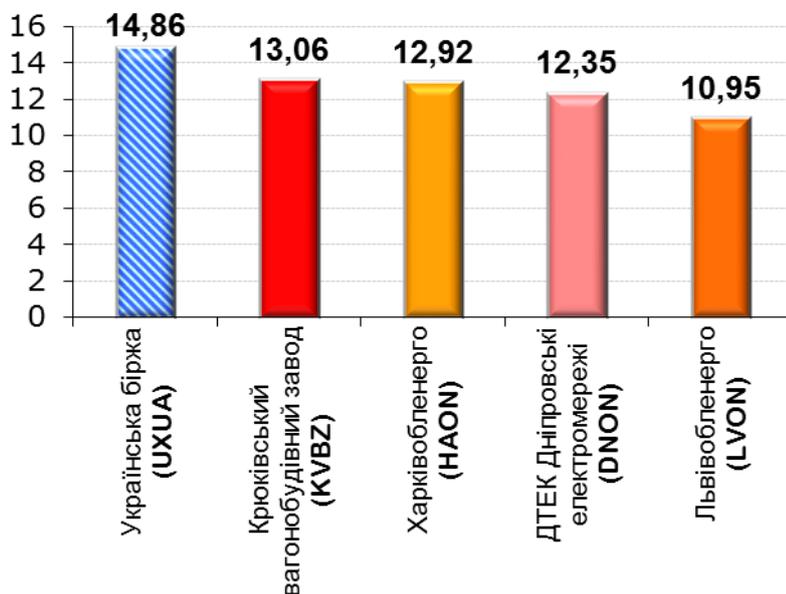


* - для зручності порівняння за умовну одиницю прийняті, відповідно, значення ВЧА/акція Фонду на початок діяльності (10 000 грн.) та значення індексу ПФТС на цю ж дату (27 травня 2008 р.), що дорівнювало 909,40; з 1 січня 2014 р. бенчмарком Фонду є індекс Української біржі.

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-7», то вартість чистих активів фонду в розрахунку на акцію за звітний період знизилась з 5 127,66 грн до 3 633,48 грн, тобто на 29,1%. Еталон для порівняння фонду – індекс Української біржі UX – зріс за цей період на 2,8%. Загальна вартість чистих активів скоротилась на 857,7 тис. грн і склала 2,09 млн гривень.

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-7» було виключено акції «Укрнафти» на суму 910,8 тис. грн, що і стало основним чинником загального скорочення 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 (+85,5 тис. грн), отримані дивіденди на акції «Харківобленерго» та «Харківенергозбут» (+30,3 тис. грн), нараховані відсотки за депозитами (+0,3 тис. грн), а також поточні витрати на фінансування діяльності фонду (-63,0 тис. гривень).

У вартісній переоцінці портфеля позитивний доробок фонду принесли цінні папери «Укрнафти» (+19,3 тис. грн), «Центренерго» (+21,5 тис. грн) та Крюківського вагонобудівного заводу (+136,2 тис. грн), а знецінився пакет акцій «Райффайзен Банку» (-91,5 тис. грн), біржовий курс акцій якого впав на 24,3%: з 0,2908 грн/акц. до 0,22 грн/акцію. Решта сім позицій не змінили своєї курсової вартості.

У звітному періоді ІФ «Синергія-7» продав цінні папери на загальну суму 113,7 тис. грн, а саме 3 000 акцій «Центренерго» на суму 15,0 тис. грн та 410 000 акцій «Райффайзен Банку» на суму 98,7 тис. гривень. Кошти необхідні були для сплати поточних витрат фонду.