



## «ОТП Класичний»

відкритий спеціалізований пайовий інвестиційний фонд

**отр Capital**

31 жовтня 2016 р.

Рівень ризику фонду

Цільова структура активів

	•До 100% депозити
	•До 50% ОВДП
	•До 10% муніципальні і банківські облигації

Динаміка ціни інвестиційного сертифіката

1 місяць	3 місяці	6 місяців	1 рік	З початку року	З початку діяльності
1.42%	4.29%	8.67%	17.30%	14.57%	151.23%

під періодами 1, 3, 6 місяців, рік, маються на увазі 30 (31), 90 (91), 181 (182), 365 днів, що відраховуються у зворотньому порядку від дати цього звіту.

Інформація про фонд

Дата початку розміщення сертифікатів	18 січня 2008 року
Обсяг емісії	250 000 000.00 грн.
Термін діяльності фонду	безстроковий
Вартість інвестиційного сертифіката	2 512.27 грн.
Вартість чистих активів	2 720 965.61 грн.
Кількість розміщених сертифікатів	1 082
Номинальна вартість сертифіката	1 000.00 грн.
Мінімальна сума інвестиції	20 000 грн.
Зворотній викуп сертифікатів	кожний робочий день
Код ЄДРІСІ	211851
Зберігач фонду	ПАТ «Укрсоцбанк»
Винагорода КУА	0,5% від ВЧА фонду
Відкриття рахунку в цінних паперах*	300 грн.
Комісія при купівлі/продажі сертифікатів	200 грн. / 0.5% (мін. 200 грн.)
Рекомендований термін інвестицій	Короткостроковий

Стратегія фонду

Фонд розрахований на інвесторів з поміркованим ставленням до ризику, схильних до стриманої, консервативної стратегії збереження власного капіталу.

Інвестування активів фонду спрямоване на формування диверсифікованого портфеля, який забезпечує максимально можливий рівень доходності при мінімальному рівні ризику. Активи фонду інвестуються виключно в інструменти з фіксованою доходністю: депозити і облигації, оскільки ці інструменти забезпечують мінімальний рівень ризику інвестицій.

Коментар інвестиційного керуючого:

Фактична доходність фонду ОТП Класичний в жовтні становила 1.4% (17.8% річних). Середня доходність, під яку розміщені активи фонду, після відрахування винагорода КУА, складає 17.4% річних. Цей показник відображає приблизний рівень доходності фонду протягом найближчих 3 місяців.

В жовтні НБУ знизив облікову ставку на 1%, що спричинило подальше зниження ставок доходності на грошовому ринку в звітному періоді. Доходність депозитних сертифікатів НБУ на 14 днів знизилась з 15% до 14% річних. Доходність ОВДП з терміном до погашення 11 місяців становила 16.5%-16.9%, доходність довгих паперів з терміном до погашення 2 і 3 роки становила 15.9% - 16.4% річних. Ставка за короткими депозитами (до 3 місяців) складала до 16% річних. Ставки на більш довгі терміни складають до 20% річних.

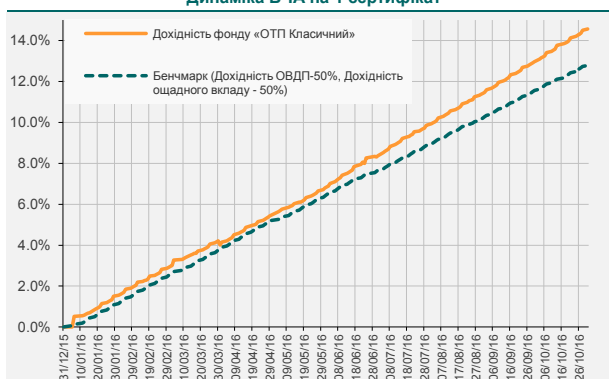
У звітному періоді вільні кошти фонду в обсязі 155 тис. грн. були розміщені на депозити в ПАТ «Мегабанк» та ПАТ «Укресімбанк». Купівля та продаж цінних паперів не відбувалася.

Доходність фонду з початку року перенала бенчмарк на 1.8%.

Показники ризику

Стандартне відхилення <sup>1</sup>	0.04%
Коефіцієнт Шарпа <sup>2</sup>	8.07%
Коефіцієнт кореляції з індексом УБ <sup>3</sup>	Н/Д

Динаміка ВЧА на 1 сертифікат



Інвестиційний портфель фонду

За класами активів



Найбільші вкладення активів

Депозити і грошові кошти	78.7%
ПАТ "Ідея Банк"	18.6%
ПАТ "Альфа Банк"	18.0%
ПАТ "Таскомбанк"	15.8%
ПАТ "ВТБ Банк"	15.4%
ПАТ "Мегабанк"	9.4%
ПАТ "Укресімбанк"	1.5%
ПАТ "ОТП Банк"	0.1%
Облігації	18.3%
Міністерство фінансів України 194591	7.7%
Міністерство фінансів України 192637	3.6%
ПАТ "Таскомбанк"	3.5%
Міністерство фінансів України 180400	3.5%
Інші**	3.1%

Історична доходність не є гарантією повторення такої самої доходності в майбутньому. Цей звіт не є рекламою цінних паперів, а також рекомендацією купувати чи продавати цінні папери цього фонду. Перед купівлею інвестиційних сертифікатів необхідно уважно ознайомитись із Проспектом емісії цінних паперів інвестиційного фонду.

ТОВ «КУА «ОТП Капітал», 03680, Україна, м. Київ, вул. Фізкультури, 28Д тел./факс +38 044 492 34 69, www.otrcapital.com.ua, capital@otrbank.com.ua

Ліцензія НКЦПФР АД №075876 від 28.09.2012 на здійснення діяльності з управління активами інституційних інвесторів (діяльності з управління активами)

\* обслуговування рахунку в цінних паперах здійснює ПАТ "ОТП Банк", ліцензія НКЦПФР АЕ №263434 від 12.10.2013 р.

\*\* дебіторська заборгованість, кошти для торгівлі на фондовому ринку