



«ОТП Валютний»

Інтервальний спеціалізований пайовий інвестиційний фонд

отр Capital

30 квітня 2016 р.

Рівень ризику фонду

Цільова структура активів

<p>Низький</p>	<ul style="list-style-type: none"> до 100% ОВДП номіновані в дол. США до 90% єврооблігації укр. емітентів до 100% депозити ном. в гривнях і дол. США до 20% ф'ючерс на пару гривня/дол. США
-----------------------	---

Динаміка ціни інвестиційного сертифіката

1 місяць	3 місяці	6 місяців	1 рік	З початку року	З початку діяльності
-2.96%	-4.43%	-4.43%	0.00%	-4.43%	-4.43%

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 визнання фонду НКЦПФР	18.03.2016
Обсяг емісії	200 000 000 грн.
Термін діяльності фонду	безстроковий
Вартість інвестиційного сертифіката	95.57 грн.
Вартість чистих активів	13 393 520.34 грн.
Кількість розміщених сертифікатів	140 139
Номинальна вартість сертифіката	100 грн.
Мінімальна сума інвестиції	20 000 грн.
Зворотній викуп сертифікатів	щоквартально
Код ЄДРПІ	22400328
Зберігач фонду	ПАТ «Укрсоцбанк»
Винагорода КУА	1% від ВЧА фонду
Відкриття рахунку в цінних паперах*	300 грн.
Комісія при купівлі/продажу сертифікатів	200 грн. / 0.5% (мін. 200 грн.)
Рекомендований термін інвестицій	від 3 місяців

Стратегія фонду

Фонд розрахований на інвесторів з поміркованим ставленням до ризику, що бажають захистити свій капітал від ризику девальвації національної валюти і отримати дохід не нижче рівня банківських валютних депозитів.

Інвестування активів фонду спрямоване на формування диверсифікованого портфеля депозитів та облігацій, номінованих в іноземній валюті, що забезпечують привабливий рівень доходності при збереженні поміркованого ризику.

Коментар інвестиційного керуючого:

Дохідність фонду «ОТП Валютний» в гривнях в квітні склала -2.96%. Курс долара США відносно гривні в цей період знизився на 3.9%, до рівня 25.19 грн./дол. Дохідність фонду в доларах США за цей період становила +1.1% (12.8% річних). Дохідність фонду в доларах США з дати конвертації коштів з старого фонду в новий (17.02.2016) становила +2.5% (12.8% річних). Ревальвация гривні за цей період становила 6.8%.

Політична стабілізація та зростання цін на метали в 1 кварталі 2016 р., які займають значну частку в експорті країни, привели до ревальвации гривні відносно долара США та зниження депозитних ставок. Так ставки по короткостроковим депозитам у доларах США (терміном до 3 місяців) знизились з 3,5% річних до 2,0% річних, довгостроковим (терміном до 12 місяців) знизились до рівня 3-6% річних. ОТП Валютний є найкращим інструментом ОТП Капітал для хеджування валютних ризиків. Він демонструє значно вищу доходність у доларах США порівняно з валютними депозитами.

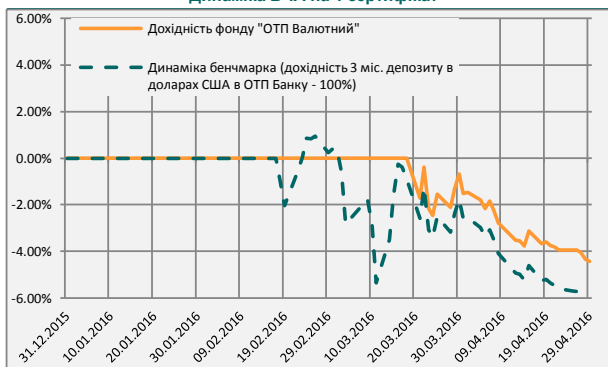
В поточний період в портфель фонду були куплені облігації Міністерства фінансів України, випуск 192744 - 21 шт., на загальну суму 578,5 тис. грн.

З початку діяльності дохідність фонду перебрала бенчмарк на 1.8%.

Показники ризику

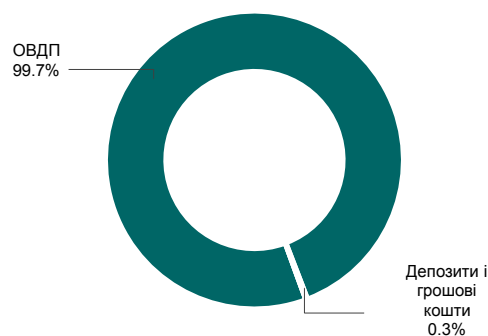
Стандартне відхилення	1	0.29%
Коефіцієнт Шарпа	2	Н/Д
Коефіцієнт кореляції з індексом УБ	3	Н/Д

Динаміка ВЧА на 1 сертифікат



Інвестиційний портфель фонду

За класами активів



Найбільші вкладення активів

Державні облігації		99.7%
Міністерство фінансів України 192611		53.2%
Міністерство фінансів України 172506		42.2%
Депозити і грошові кошти		0.3%
ПАТ "Укргазбанк"		0.2%
ПАТ "ОТП Банк"		0.1%

* 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

ТОВ «ОТП Капітал», 03680, Україна, м. Київ, вул. Фізкультури, 28Д тел./факс +38 044 492 34 69, www.otpcapital.com.ua, capital@otpbank.com.ua
Ліцензія НКЦПФР АД №075876 від 28.09.2012 на здійснення діяльності з управління активами інституційних інвесторів (діяльності з управління активами)