



«ОТП Валютний»

Інтервальний спеціалізований пайовий інвестиційний фонд

otp Capital

31 березня 2016 р.

Рівень ризику фонду

Цільова структура активів

| | |
|-----------------------|----------------------------------------------|
| <p>Низький</p> | • 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 |

Показники ризику

| | | |
|------------------------------------|---|-------|
| Стандартне відхилення | 1 | 1.33% |
| Коефіцієнт Шарпа | 2 | Н/Д |
| Коефіцієнт кореляції з індексом УБ | 3 | Н/Д |

Динаміка ціни інвестиційного сертифіката

| 1 місяць | 3 місяці | 6 місяців | 1 рік | 3 початку року | 3 початку діяльності |
|----------|----------|-----------|-------|----------------|----------------------|
| -1.51% | -1.51% | 0.00% | 0.00% | -1.51% | -90.15% |

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 | 98.49 грн. |
| Вартість чистих активів | 13 394 605.23 грн. |
| Кількість розміщених сертифікатів | 136 003 |
| Номинальна вартість сертифіката | 100 грн. |
| Мінімальна сума інвестиції | 20 000 грн. |
| Зворотній викуп сертифікатів | щоквартально |
| Код ЄДРІСІ | 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 дохідності при збереженні поміркованого ризику.

Коментар інвестиційного керуючого:

КУА «ОТП Капітал» зареєструвала новий інтервальний фонд «ОТП Валютний» на заміну попередньому фонду з аналогічною назвою, термін діяльності якого закінчився 25.10.2015 року. Інвестиційна стратегія нового фонду аналогічна попередньому і передбачає інвестування коштів учасників у валютні інструменти з фіксованою дохідністю. 17.02.2016 відбувся перехід інвесторів та активів зі старого фонду «ОТП Валютний» у новий, відповідно, з цієї дати починається розрахунок бенчмарка. До 18.03.2016 фонд розміщував свої інвестиційні сертифікати за номінальною вартістю, а з 19.03.2016 за рішенням НКЦПФР фонд розпочав розміщення своїх інвестиційних сертифікатів за реальною розрахунковою вартістю.

Дохідність фонду «ОТП Валютний» в гривнях з початку діяльності, станом на звітну дату, становила -1.5%. Курс долара США відносно гривні за цей період знизився на 3%, до рівня 26.22 грн./дол. Дохідність фонду в доларах США за цей період становила +1.5% (12.8% річних).

З початку діяльності в портфель фонду були куплені облігації Міністерства фінансів України, випуск 192611 - 284 шт., випуск 172506 - 227 шт. Вільні кошти фонду розміщувались на депозити в Укргазбанку на загальну суму 25 тис. грн.

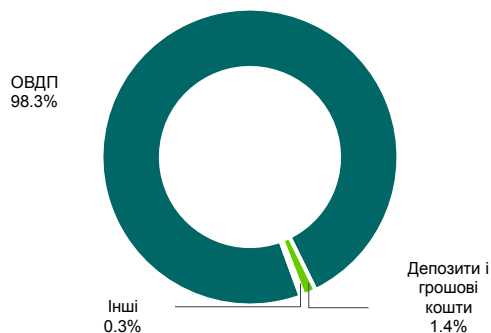
З початку діяльності дохідність фонду перебрала бенчмарк на 1.1%.

Динаміка ВЧА на 1 сертифікат



Інвестиційний портфель фонду

За класами активів



Найбільші вкладення активів

| Державні облігації | 98.3% |
|--------------------------------------|-------------|
| Міністерство фінансів України 192611 | 55.0% |
| Міністерство фінансів України 172506 | 43.3% |
| Депозити і грошові кошти | 1.4% |
| ПАТ "ОТП Банк" | 1.2% |
| ПАТ "Укргазбанк" | 0.2% |
| Інші** | 0.3% |

* 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)