



«ОТП Валютний»

Інтервальный спеціалізований пайовий інвестиційний фонд

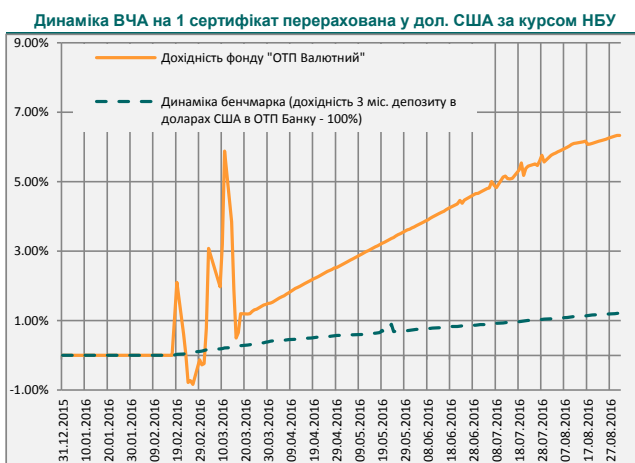


31 серпня 2016 р.

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

Показники ризику	
Стандартне відхилення ¹	0.91%
Коефіцієнт Шарпа ²	0.77%
Коефіцієнт кореляції з індексом УБ ³	Н/Д

Динаміка ціни інвестиційного сертифіката					
1 місяць	3 місяці	6 місяців	1 рік	З початку року	З початку діяльності
у гривні					
4.11%	4.59%	0.95%	Н/Д	Н/Д	0.95%
перерахована у доларах США за курсом НБУ					
0.72%	2.61%	6.47%	Н/Д	Н/Д	6.33%

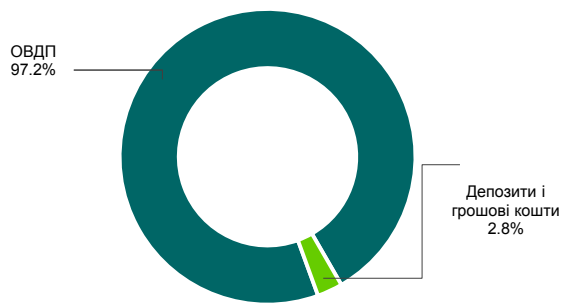


під періодами 1, 3, 6 місяців, рік, маються на увазі 30 (31), 90 (91), 181 (182), 365 днів, що відраховуються у зворотньому порядку від дати цього звіту.

Інформація про фонд	
Дата визнання фонду НКЦПФР	18.03.2016
Обсяг емісії	200 000 000 грн.
Термін діяльності фонду	безстроковий
Вартість інвестиційного сертифіката	100.95 грн.
Вартість чистих активів	16 100 515.89 грн.
Кількість розміщених сертифікатів	159 496
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

Інвестиційний портфель фонду

За класами активів



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:

Дохідність фонду "ОТП Валютний" в гривнях в серпні становила 4.1%. Курс долара США відносно гривні в цей період виріс на 3.4%, до рівня 25.65 грн./дол. Дохідність фонду в доларах США за цей період становила 0.7% (8.9% річних). Дохідність фонду в доларах США з дати конвертації коштів з старого фонду в новий (17.02.2016) становила 6.3% (11.8% річних). Ревальвація гривні за цей період дорівнювала 5.1%.

Ризики відтермінування траншу МВФ в вересні та, як наслідок, можлива девальвація гривні спричинили підвищений попит на валюту у звітному періоді, що привело до девальвації гривні відносно долара США. Ставки по депозитах у доларах США у звітному періоді залишилися незмінними: по короткострокових депозитах ставка складає 2.0% річних, по довгострокових (терміном до 12 місяців) залишається на рівні 3-6% річних. ОТП Валютний залишається найкращим інструментом ОТП Капітал для хеджування валютних ризиків. Він продовжує демонструвати значно вищу дохідність у доларах США порівняно з валютними депозитами.

В серпні погасилися облігації Міністерства фінансів України, випуск 172506 - 227 шт. На отримані кошти в портфель фонду були придбані облігації Міністерства фінансів України, випуск 194476 - 40 шт., випуск 195036 - 220 шт., випуск 193783 - 13 шт. З початку діяльності дохідність фонду перенала бенчмарк на 5.1%. Оскільки майже 100% портфелю фонду складають активи номіновані в доларах США, ОТП Капітал публікує динаміку чистих активів фонду перераховану у доларах США за курсом НБУ для більш якісного відображення дохідності фонду.

Найбільші вкладення активів

Державні облігації	97.2%
Міністерство фінансів України 192611	44.9%
Міністерство фінансів України 195036	35.1%
Міністерство фінансів України 194476	6.6%
Міністерство фінансів України 193783	5.6%
Міністерство фінансів України 192744	3.5%
Міністерство фінансів України 194666	1.6%
Депозити і грошові кошти	2.8%
ПАТ "ОТП Банк"	2.0%
ПАТ "Таскомбанк"	0.8%

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

** дебіторська заборгованість, кошти для торгівлі на фондовому ринку

ТОВ «ОТП Капітал», 03680, Україна, м. Київ, вул. Фіскуль-тури, 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)