



«ОТП Валютний»

Інтерв'яльний спеціалізований пайовий інвестиційний фонд



29 липня 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	3 початку року	3 початку діяльності
у гривні					
0.71%	1.45%	Н/Д	Н/Д	Н/Д	-3.04%
перерахована у доларах США за курсом НБУ					
0.86%	2.97%	Н/Д	Н/Д	Н/Д	5.57%

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	96.96 грн.
Вартість чистих активів	14 243 567.35 грн.
Кількість розміщених сертифікатів	146 628
Номінальна вартість сертифіката	100 грн.
Мінімальна сума інвестиції	20 000 грн.
Зворотній викуп сертифікатів	щоквартально
Код ЄДРПС	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:

Дохідність фонду «ОТП Валютний» в гривнях в липні складала +0.71%. Курс долара США відносно гривні в цей період знизився на 0.2%, до рівня 24.82 грн./дол. Дохідність фонду в доларах США за цей період складала +0.86% (10.9% річних). Дохідність фонду в доларах США з дати конвертації коштів з старого фонду в новий (17.02.2016) склала +5.57% (12.5% річних). Ревальвация гривні за цей період становила 8.2%.

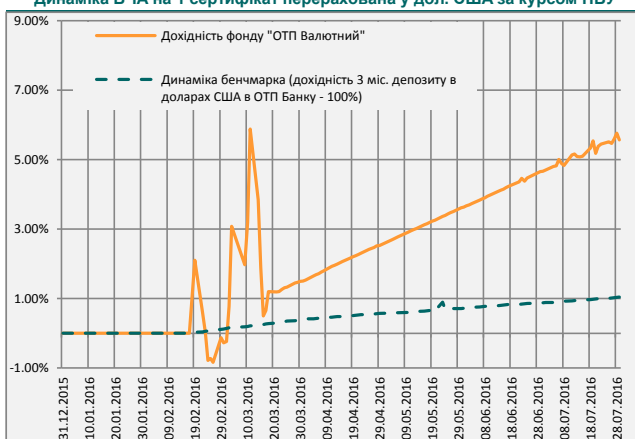
Ріст валютної виручки привели до подальшої ревальвации гривні відносно долара США. Ставки по депозитах у доларах США у звітному періоді залишилися незмінними: по короткостроковим депозитах ставка складає 2.0% річних, по довгостроковим (терміном до 12 місяців) залишається на рівні 3-6% річних. ОТП Валютний залишається найкращим інструментом ОТП Капітал для хеджування валютних ризиків. Він продовжує демонструвати значно вищу дохідність у доларах США порівняно з валютними депозитами.

В поточному періоді дії з активами портфелю не проводилися. З початку діяльності дохідність фонду перебрала бенчмарк на 4.5%. 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.

Показники ризику

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

Динаміка ВЧА на 1 сертифікат перерахована у дол. США за курсом НБУ



Інвестиційний портфель фонду

За класами активів



Найбільші вкладення активів

Державні облігації	99.1%
Міністерство фінансів України 192611	48.7%
Міністерство фінансів України 172506	41.0%
Міністерство фінансів України 192744	4.0%
Депозити і грошові кошти	0.5%
ПАТ "ОТП Банк"	0.5%
Інші**	0.5%

* 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)