



«ОТП Валютний»

Інтервальный спеціалізований пайовий інвестиційний фонд



31 жовтня 2016 р.

Рівень ризику фонду

<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
----------------	---

Цільова структура активів

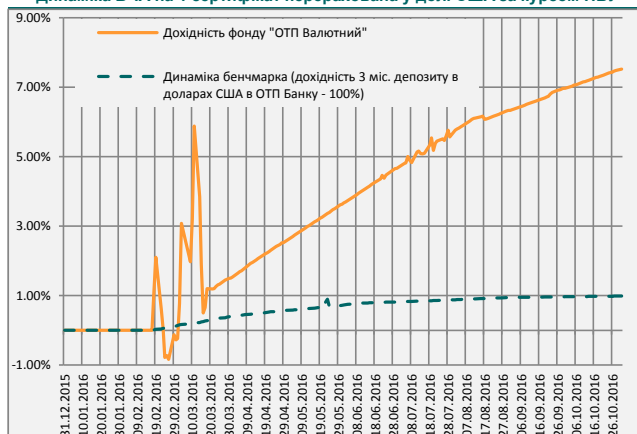
Показники ризику

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					
-1.09%	4.64%	6.16%	Н/Д	Н/Д	1.46%
перерахована у доларах США за курсом НБУ					
0.52%	1.85%	4.87%	Н/Д	Н/Д	7.52%

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



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	101.46 грн.
Вартість чистих активів	19 186 444.25 грн.
Кількість розміщених сертифікатів	188 633
Номинальна 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 доходності при збереженні поміркованого ризику.

Коментар інвестиційного керуючого:

Доходність фонду «ОТП Валютний» в гривнях в жовтні становила -1.1%. Курс долара США відносно гривні в цей період знизився на 1.6%, до рівня 25.50 грн./дол. Доходність фонду в доларах США за цей період становила +0.5% (7.5% річних). Доходність фонду в доларах США з дати конвертації коштів з старого фонду в новий (17.02.2016) склала +7.5% (10.7% річних). Ревальвація гривні за цей період становила 5.7%.

Стабільні валютні надходження від експортерів металу та аграрної продукції спричинили подальшу підтримку гривні в жовтні. Як наслідок відбулась ревальвація гривні відносно долара США протягом звітного періоду. Ставки по депозитам у доларах США у звітному періоді по короткостроковим депозитам залишилися на рівні 2-4% річних, а по довгостроковим (терміном до 12 місяців) - на рівні 3-6% річних. ОТП Валютний залишається найкращим інструментом ОТП Капітал для хеджування валютних ризиків. Він продовжує демонструвати значно вищу доходність у доларах США порівняно з валютними депозитами.

В жовтні дії з активами фонду не відбувались. З початку діяльності доходність фонду перевищила бенчмарк на 6.5%. 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 доходності фонду.

Інвестиційний портфель фонду

За класами активів



Найбільші вкладення активів

Державні облігації	97.6%
Міністерство фінансів України 195036	45.1%
Міністерство фінансів України 192611	38.1%
Міністерство фінансів України 194476	5.6%
Міністерство фінансів України 193783	4.5%
Міністерство фінансів України 192744	3.0%
Міністерство фінансів України 194666	1.4%
Депозити і грошові кошти	2.4%
ПАТ "Укргазбанк"	2.1%
ПАТ "ОТП Банк"	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)