

Щомісячний звіт

31 жовтня 2018 року



Інтервальный спеціалізований пайовий інвестиційний фонд "ОТП Валютний"

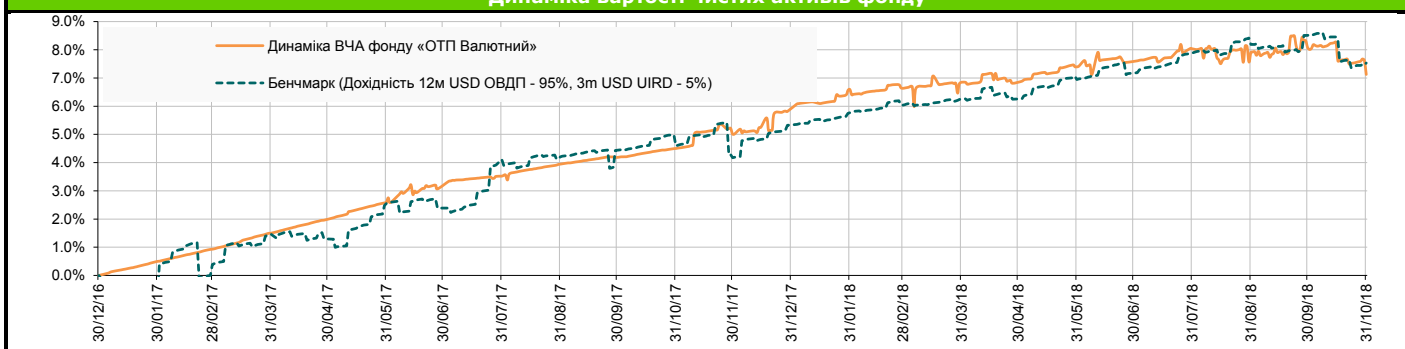
Інформація про фонд

Початок розміщення	18 березня 2016 р.	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.			
Загальний обсяг емісії	200 000 000 грн.	Інвестування активів фонду спрямоване на формування диверсифікованого портфеля депозитів та облігацій, номінованих в іноземній валюті, що забезпечують привабливий рівень дохідності при збереженні поміркованого ризику.			
Номинальна вартість 1 сертифікату	100 грн.				
Термін діяльності	безстроковий				
Поточна загальна вартість чистих активів	32 112 762 грн.				
Поточна вартість 1 сертифікату	121 грн.				
Кількість розміщених сертифікатів	264 810				
Винагорода компанії з управління	1% від ВЧА фонду				
Банк-зберігач	ПАТ "Укрсоцбанк"				
Можливість купівлі/продажу	щодня/щоквартально				
Надбавка/знижка при купівлі/продажу*	0.2% до вартості 1 сертифікату				
Мінімальна сума інвестування	20 000 грн.				
Відкриття рахунку в цінних паперах	750 грн./0 грн.** (одноразово)				
Комісія при купівлі/продажу	200 грн./0,5% (мін. 200, макс. 2000 грн.)				

Дохідність фонду

	Валюта	За період		У річних	
		₴	\$	₴	\$
1 місяць		-1.35%	-0.88%	-15.05%	-10.08%
3 місяці		4.38%	-0.84%	18.71%	-3.32%
6 місяців		7.68%	0.29%	15.95%	0.59%
3 початку року		1.59%	1.24%	1.91%	1.48%
1 рік		7.61%	2.51%	7.61%	2.51%
3 початку діяльності		21.27%	16.34%	6.74%	5.89%

Динаміка вартості чистих активів фонду



Портфель фонду

Державні облігації	99.6%
ОВДП з погашенням у 2019 році	66.5%
ОЗДП з погашенням у 2023 році	17.0%
ОВДП з погашенням у 2020 році	16.1%
Депозити та грошові кошти	0.4%
ПАТ "ОТП Банк"	0.4%

Державні облігації
99.6%



Депозити і грошові кошти
0.4%

Коментар



Юрій Олексієнко,
Керівник департаменту з питань інвестиційної діяльності

Валютний ринок розпочав жовтень на достатньо високих рівнях - курс гривні склав 28.3 за долар. Очікування ринком позитивного рішення по траншу МВФ, потреби у гривні з боку представників, як фінансового, так і реального сектору, призвели до того, що на валютному ринку почали переважати продавці долару. Переважаюча пропозиція сформувала позитивний тренд по гривні до середини місяця і гривня зміцнилася до 27.9. Однак повернення експортерам ПДВ та погашення значних сум гривневих ОВДП дозволили долару частково відіграти втрачені позиції до рівня 28.16 UAH/USD. Такими чином, протягом звітного місяця гривні вдалося зміцнитися по відношенню до долара на 0.5%.

Ставки по доларових активах здійснили в жовтні стрімкий стрибок вгору. Потреба уряду в доларах США спонукала Міністерство фінансів суттєво збільшити ставки по доларових ОВДП на первинних аукціонах. В жовтні процентні ставки ОВДП були збільшені з 6% до 7%. Це мало негативний вплив на результат фонду "ОТП Валютний" - облігації внутрішньої та зовнішньої позики, які знаходяться в портфелі, були переоцінені за більшою дохідністю, відтак їх вартість знизилася в жовтні. З іншого боку, вільні кошти були розміщені в більш дохідні активи, зокрема, в фонд були придбані доларові ОВДП з погашенням в 2019 році на суму 3.4 млн. грн. Загалом, згідно поточної облікової політики, фонд був змушений збільшити дохідність річних ОВДП на 1.6% до 6.4%, дворічних на 1.28% до 7.1% та п'ятирічних ОЗДП на 0.7% до 9.1%. Зростання ставок дозволило збільшити середню дохідність фонду до 6.7% в доларах США, що в майбутньому дозволить формувати для інвесторів фонду високу дохідність та швидко компенсувати жовтневу негативну динаміку. Відсоткові рухи в жовтні призвели до зниження вартості сертифікатів "ОТП Валютний" на 0.88%. Бенчмарк, який використовує фонд, за аналогічний період знизився ще більше, а саме на 0.9%.

Оскільки близько 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. "ОТП Валютний" залишається найкращим інструментом "ОТП Капітал" для хеджування валютних ризиків та продовжує демонструвати значно вищу дохідність у доларах США порівняно з валютними депозитами.

Контакти

ТОВ "Компанія з управління активами "ОТП Капітал"

ЄДРПОУ 35290039, Ліцензія НКЦПФР на здійснення професійної діяльності на фондовому ринку - діяльності з управління активами інституційних інвесторів (діяльності з управління активами) АД №075876 від 28.09.2012 р., строк дії ліцензії: з 29.09.2012 р. - необмежений. Свідоцтво про включення до державного реєстру фінансових установ, які надають фінансові послуги на ринку цінних паперів №1148, видане ДКЦПФР 26.10.2007 р.

Консультація: 044 492 34 69

03150, м. Київ, вул. Фізкультури, 28Д
Тел./факс: 044 492 34 69
E-mail: capital@otpbank.com.ua
Сайт: www.otpcapital.com.ua

*Відсоток, на який може збільшуватися/зменшуватися ціна сертифікатів при купівлі/продажу для часткової компенсації різниці між курсом НБУ, за яким офіційно обліковуються валютні активи фонду, та курсом міжбанківського валютного ринку, за яким фактично придбаються валютні активи у фонд. Надбавка/знижка застосовується у разі, якщо різниця між курсом НБУ та курсом міжбанку більше 0,5%. **для клієнтів Premium та Private Banking «ОТП Банку» - безкоштовно.

Інтервальный спеціалізований пайовий інвестиційний фонд «ОТП Валютний» ТОВ «КУА «ОТП Капітал», код ЄДРПІС 22400328.

Свідоцтво про внесення інституту спільного інвестування до Єдиного державного реєстру інститутів спільного інвестування №00328, дата видачі: 24.07.2015 р., строк діяльності інституту спільного інвестування - безстроковий.

Із проспектом емісії фонду «ОТП Валютний» можна ознайомитися за місцем знаходження ТОВ «КУА «ОТП Капітал»: 03680, м. Київ, вул. Фізкультури, 28 (Літера «Д») або за адресою: www.otpcapital.com.ua.

Увага: прибутковість інвестицій здійснених на фондовому ринку може збільшитися або зменшитися, результатами інвестування в минулому не гарантуються доходи в майбутньому. Держава не гарантує прибутковість інвестицій на фондовому ринку. ТОВ «КУА «ОТП Капітал» не гарантує розмір прибутковості інвестиційних інструментів, вказаних у цьому матеріалі.