



## «ОТП Динамичный»

закрытый недиверсифицированный корпоративный инвестиционный фонд

1 сентября 2010 г.

### Динамика СЧА на 1 сертификат

1 месяц	3 месяца	6 месяцев	1 год	С начала года	С начала деятельности
-2.08%	-1.27%	-0.31%	64.16%	33.46%	18.38%

под периодами 1, 3, 6 месяцев, год подразумевается 30, 90, 180, 365 дней, которые отсчитываются в обратном порядке от даты составления данного проспекта.

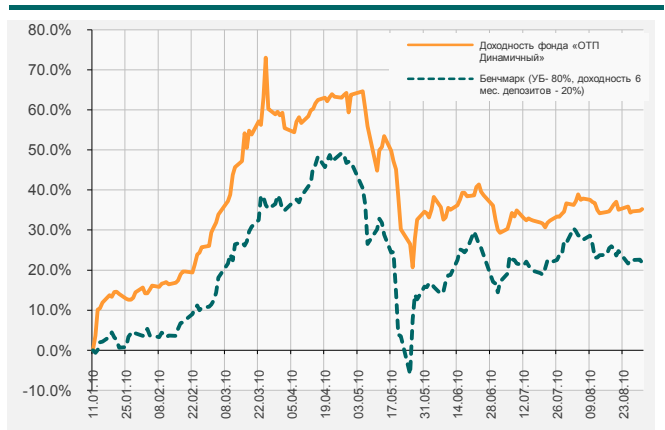
### Показатели риска

Стандартное отклонение <sup>1</sup>	0.72%
Коэффициент Шарпа <sup>2</sup>	-2.44%
Коэффициент корреляции с индексом УБ <sup>3</sup>	0.68

### Сведения о фонде

Дата начала размещения акций	31 марта 2008 года
Объем эмиссии	50 000 000.00 грн.
Срок деятельности фонда	5 лет
Стоимость акции	1 183.82 грн.
Стоимость чистых активов	2 249 250.33 грн.
Количество размещенных ценных бумаг	1 900
Номинальная стоимость акции	1 000.00 грн.
Минимальный объем инвестиции	1 акция
Обратный выкуп акций	по окончании срока деятельности
ISIN код	UA 4000027676
Код ЕДРИСИ	132931
Хранитель фонда	АО "СЕБ Банк"
Вознаграждение управляющей компании	3,5 % от СЧА фонда
Обслуживание счета в ценных бумагах	150 грн. в год*
Комиссия при покупке/продаже акций	1%
Рекомендуемый срок инвестиций	до окончания срока деятельности
Уровень риска	высокий

### Динамика СЧА на 1 сертификат



### Стратегия фонда

Корпоративный инвестиционный фонд создан в форме открытого акционерного общества, которое проводит исключительно деятельность по совместному инвестированию. Фонд ориентирован на инвесторов, которые планируют долгосрочное вложение средств и придерживаются достаточно рискованной инвестиционной стратегии, позволяющей достичь максимальной доходности вложений.

### Комментарий инвестиционного управляющего:

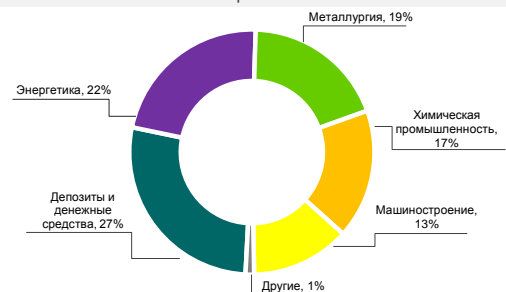
На протяжении месяца в портфель фонда были куплены акции Авдеевского коксохимического завода (AVDK, 9200 шт.), Укрнефти (UNAF, 1220 шт.). За счет этих покупок доля акций в портфеле выросла на 9% до 63% активов. Другие активы фонда составляют денежные средства (27%) и корпоративные облигации (8.2%). В ближайшее время ожидается наращивание акций в портфеле с осенним повышением активности на рынке.

### Крупнейшие вложения активов

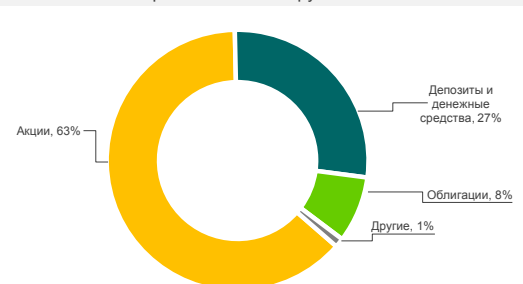
Акции	63%
Укрнафта	14.3%
Ясиновский коксохимический завод	6.2%
Авдеевский коксохимический завод	6.1%
Харцизский трубный завод	5.3%
Центрэнерго	5.0%
Облигации	8%
Богдан Моторс, Серия В	8.2%

### Инвестиционный портфель фонда

#### По секторам экономики



#### По финансовым инструментам



\* - обслуживание счета в ценных бумагах осуществляется АО "ОТП Банк" согласно действующим тарифам, лицензия ГКЦБФР АВ № 470725 от 09.07.2009 г.

1 - Стандартное отклонение - показатель рискованности инвестиции. Значение "0" показывает, что дневная доходность фонда была неизменной, вероятность изменения доходности незначительна. Чем больше данный показатель, тем больше вероятность непредвиденных скачков доходности фонда как вверх, так и вниз.

2 - Коэффициент Шарпа - показатель вознаграждения инвесторов за принятый риск. Показывает, какую дополнительную доходность в сравнении с безрисковой ставкой (ставкой срочного депозита) приносит фонд на каждую дополнительную единицу риска (стандартного отклонения)

3 - Коэффициент корреляции с индексом Украинской биржи показывает взаимосвязь между доходностью фонда и индексом УБ. Значение +1 показывает, что существует идеальная прямая взаимосвязь, значение "0" показывает, что связи между фондом и индексом нет, значение "-1" показывает, что существует идеальная обратная взаимосвязь.

Историческая доходность не является гарантией повторения такой же доходности в будущем. Данный проспект не является рекламой ценных бумаг, а также рекомендацией покупать либо продавать ценные бумаги данного фонда. Перед покупкой инвестиционных сертификатов необходимо внимательно ознакомиться с Проспектом эмиссии ценных бумаг инвестиционного фонда.

ООО «КУА «ОТП Капитал», 01133, Украина, г. Киев, ул. Кутузова, 12

тел./факс +38 044 492 34 69, www.otpcapital.com.ua, capital@otpbank.com.ua

Лицензия ГКЦБФР АВ №470710 от 08.07.2009 на осуществления деятельности по управлению активами институциональных инвесторов (деятельности по управлению активами)