

# Щомісячний звіт

31 березня 2017 року



## Відкритий недержавний пенсійний фонд "ОТП Пенсія"

### Інформація про фонд

Дата створення	Червень 2009 р.	Стратегія фонду спрямована на формування консервативного інвестиційного портфеля з максимальним захистом капіталу. Основні складові: банківські депозити і облігації, облігації гарантовані державою. До 80% активів можуть бути інвестовані в найбільш дохідний сегмент грошового ринку - банківські депозити і облігації; до 50% активів - в державні облігації, що демонструють найвищу дохідність в умовах зниження відсоткових ставок на грошовому ринку. Цільова доля інструментів в іноземній валюті - 15% активів.
Код ЄДРПОУ	36274196	
Компанія з управління активами	ТОВ "КУА "ОТП Капітал"	
Адміністратор	ТОВ "АЦПО"	
Банк-зберігач	АТ "Укрсіббанк"	

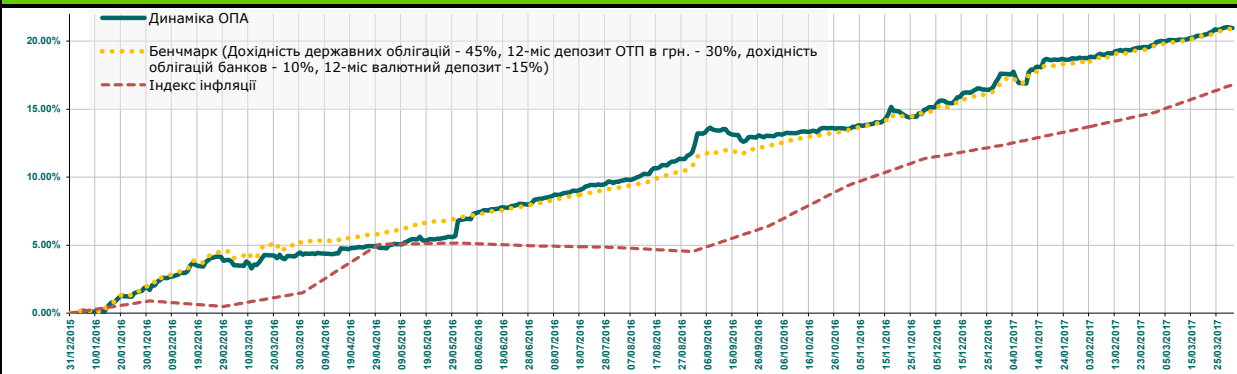
### Показники діяльності

Чиста вартість активів	93 780 342.92 грн.
Сума пенсійних внесків за період	698 235.14 грн.
Сума пенсійних виплат за період	428 637.73 грн.
Кількість учасників	30 112
Кількість вкладників - фіз. осіб	7 900
Кількість вкладників - юр. осіб	32
Чиста вартість одиниці пенсійних внесків	3.32365

### Дохідність фонду

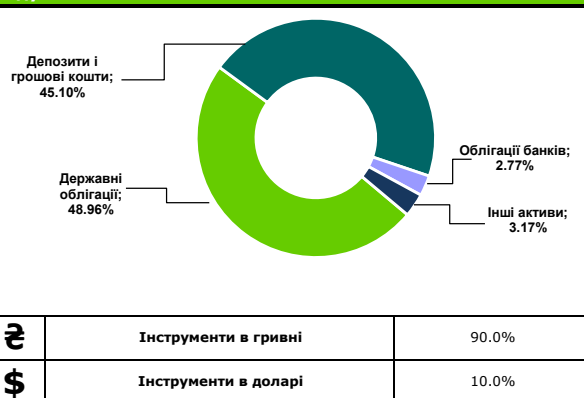
	За період	У річних
1 місяць	1.1%	13.5%
3 місяці	2.9%	12.0%
6 місяців	7.0%	14.5%
1 рік	16.0%	16.0%
3 початку року	2.9%	12.0%
3 початку діяльності	232.4%	16.7%

### Динаміка одиниці пенсійних внесків



### Портфель фонду

<b>Державні облігації (ОВДП)</b>	<b>48.9%</b>
ОВДП з погашенням в 2019 р.	28.4%
ОВДП з погашенням в 2020 р.	16.8%
ОВДП з погашенням в 2018 р.	3.6%
ОВДП з погашенням в 2017 р.	0.1%
<b>Корпоративні облігації</b>	<b>2.8%</b>
ПАТ "Альфа Банк"	1.8%
ПАТ "Таскомбанк"	1.0%
<b>Депозити та грошові кошти</b>	<b>45.1%</b>
ПАТ "Приватбанк"	9.9%
ПАТ "Ідея Банк"	8.8%
ПАТ "Альфа Банк"	7.4%
ПАТ "Таскомбанк"	6.9%
ПАТ "Ощадбанк"	6.5%
ПАТ "Мегабанк"	4.5%
ПАТ "Укргазбанк"	0.6%
ПАТ "Укрсіббанк"	0.3%
<b>Інші</b>	<b>3.2%</b>



### Коментар



**Денис Шептицький,**  
Керівник департаменту з питань інвестиційної діяльності

У березні НБУ зберіг облікову ставку незмінною, що пов'язано з необхідністю нівелювати ризики для досягнення цілей з інфляції, 9.1%, у 2017 р. Висока ліквідність у банківській системі продовжила підтовхувати Мінфін до зниження ставок на аукціонах, що зумовило вторинний ринок відповідно відреагувати по ставках дохідності. Дохідність депозитних сертифікатів НБУ на 14 днів залишилась на рівні 14% річних. Дохідність ОВДП з терміном до погашення 11 місяців знизилась до 14.8% - 15.3%, дохідність довгих паперів з терміном до погашення 2 і 3 роки знизилась до 15.2% - 15.7% річних. Ставка за короткими депозитами (до 3 місяців) складала до 15% річних. Ставки на більш довгі терміни складають до 17% річних.

У березні з портфеля фонду були продані облігації Міністерства фінансів України на загальну суму 35.9 млн. грн. Взаємін в портфель фонду були придбані облігації Міністерства фінансів України з погашенням в 2019 р. на загальну суму 24.9 млн. грн. та облігації Міністерства фінансів України з погашенням в 2020 р. на суму 10.1 млн. грн. Вільні кошти фонду розміщувались на депозитах в ПАТ "Державний ощадний банк України", ПАТ "Приватбанк", ПАТ "Альфа Банк" та ПАТ "Укргазбанк" на загальну суму 15.2 млн. грн. та 72.8 тис. доларів. Середні ставки по депозитах в гривні та доларах склали 14.8% річних та 3.4% річних відповідно.

Дохідність фонду становила 1.1% (13.5% річних). З огляду на продовження тренду стабільності курсу гривні ми продовжимо заміну валютних інструментів на гривневі з довгою дюрацією. З огляду на зниження ставок дохідності на ринку облігацій у фонді зберігається накопичений нереалізований прибуток від росту цін на ОВДП. Цей прибуток буде поступово реалізовуватись в наступні періоди, що дозволить демонструвати фактичну дохідність вище рівня бенчмарку.



### Контакти

<b>Відкритий пенсійний фонд "ОТП Пенсія"</b> Свідоцтво про реєстрацію фінансової установи: ПФ № 116 від 26.03.2009. Вказана дохідність не є прогнозом дохідності чи гарантією збільшення доходів учасників недержавного пенсійного фонду в майбутньому, а лише показником вже отриманої історичної дохідності за вказані періоди.	<b>Консультація: (044) 492 34 69</b> E-mail: pension@otpbank.com.ua Сайт: www.otppension.com.ua
<b>ТОВ "Компанія з управління активами "ОТП Капітал"</b> Ліцензія НКЦПФР АД №075876 від 28.09.2012 (безстрокова) на здійснення діяльності з управління активами інституційних інвесторів (діяльність з управління активами)	03150, м. Київ, вул. Фізкультури, 28Д Тел./факс: (044) 492 34 69 E-mail: capital@otpbank.com.ua Сайт: www.otpcapital.com.ua
<b>ТОВ "Адміністратор пенсійного фонду "Центр персоналізованого обліку"</b> Ліцензія Наушпінсслуг на провадження діяльності з адміністрування недержавних пенсійних фондів АБ № 115988 від 07.02.2008 р. (безстрокова)	04080, м. Київ, вул. Кирилівська, 40 Тел./факс: (044) 537 66 57 E-mail: info@acpo.com.ua Сайт: www.acpo.com.ua