

Щомісячний звіт

31 грудня 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 "КВА "ОТП Капітал"	
Адміністратор	ТОВ "АЦПО"	
Банк-зберігач	ПАТ "УкрСиббанк"	

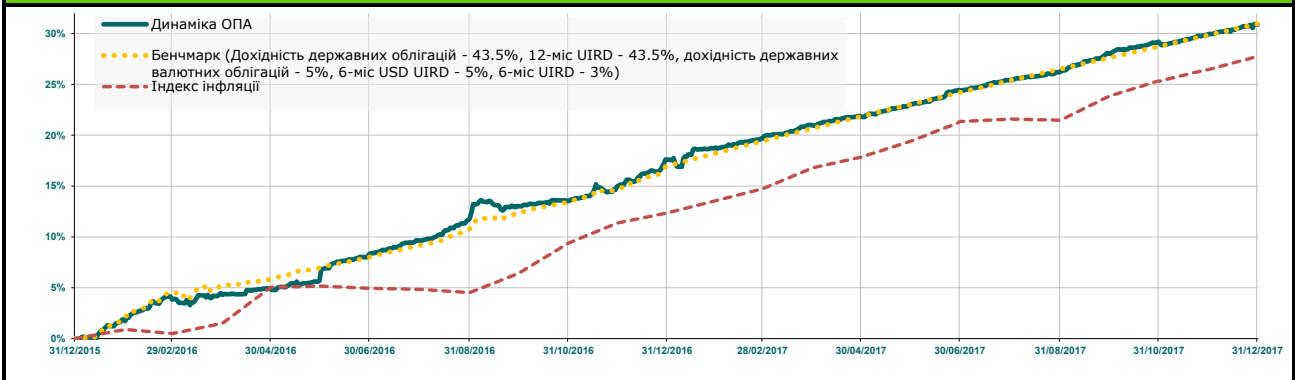
Показники діяльності

Чиста вартість активів	108 278 751.85 грн.
Сума пенсійних внесків за період	994 133.87 грн.
Сума пенсійних виплат за період	96 965.61 грн.
Кількість учасників	33 065
Кількість вкладників - фіз. осіб	10 727
Кількість вкладників - юр. осіб	38
Чиста вартість одиниці пенсійних внесків	3.59579

Дохідність фонду

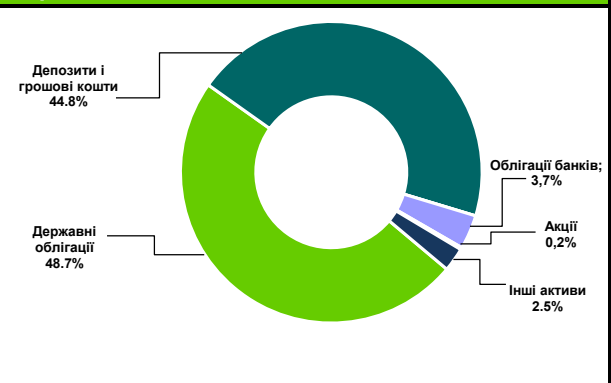
	За період	У річних
1 місяць	0.8%	9.7%
3 місяці	2.2%	9.2%
6 місяців	5.2%	10.6%
1 рік	11.3%	11.3%
3 початку року	11.3%	11.3%
3 початку діяльності	259.6%	16.2%

Динаміка одиниці пенсійних внесків



Портфель фонду

Державні облігації (ОВДП)	48.7%
ОВДП з погашенням в 2019 р.	22.5%
ОВДП з погашенням в 2020 р.	20.4%
ОВДП з погашенням в 2018 р.	3.2%
ОВДП з погашенням в 2022 р.	2.6%
Корпоративні облігації	3.7%
ПАТ "Альфа Банк"	2.8%
ПАТ "Таскомбанк"	0.9%
Депозити та грошові кошти	44.9%
ПАТ "Приватбанк"	8.7%
ПАТ "Ідея Банк"	8.1%
ПАТ "Таскомбанк"	7.0%
ПАТ "Альфа Банк"	5.8%
ПАТ "Кредобанк"	3.8%
ПАТ "Кредит-вест Банк"	3.7%
ПАТ "Прокредит Банк"	3.3%
ПАТ "УкрСиббанк"	2.5%
ПАТ "Укргазбанк"	2.3%
ПАТ "Ощадбанк"	2.0%
ПАТ "Мегабанк"	0.1%
Акції	0.2%
ПАТ "Укрнафта"	0.2%
Інші	2.5%



₴	Інструменти в гривні	96.8%
\$	Інструменти в доларі	3.2%

Коментар

Юрій Олексієнко,
 Керівник департаменту з питань інвестиційної діяльності



В грудні НБУ в черговий раз прийняв рішення збільшити облікову ставку на 1 в.п., з 13.5% до 14.5%, з метою зменшення інфляційного тиску на українську економіку. Збільшення ключової ставки країни вплинуло і на ринок облігацій та депозитів, зокрема в листопаді дохідності 2-х річних ОВДП зросли до рівня 15.6%, 3-х річних ОВДП до 15.7%. За короткими депозитами (до 3 місяців) спостерігалося зростання ставок до рівня 14-14.5% через потребу фін. установ в ліквідності на IV квартал 2017 року. Середні ставки на більш довгі терміни залишилися на рівні 15.5% річних. Ставки у доларів США у звітному періоді по короткостроковим депозитам залишилися на рівні 1-3% річних, а по довгостроковим (терміном до 12 місяців) – на рівні 3-4% річних. У звітному періоді акції індексного кошика демонстрували різнонаправлену динаміку: зросли акції ПАТ "Мотор Січ" (+13.6%), ПАТ "Центрэнерго" (+10.9%) та ПАТ "Райффайзен Банк Аваль" (+3.5%), знизилися цінні папери ПАТ "Донбасенерго" (-4.0%) та ПАТ "Укрнафта" (-1.8%).

У грудні з портфеля фонду були продані облігації Міністерства фінансів України на загальну суму 30.1 млн. грн. Натомість були придбані облігації Міністерства фінансів України на суму 29.9 млн. грн., корпоративні облігації ПАТ «Альфа Банк» на суму 1.3 млн. грн. та акції ПАТ «Укрнафта» на суму 0,2 млн. грн. Вільні кошти фонду розміщувалися на депозитах в ПАТ "Таскомбанк" на загальну суму 2.8 млн. грн. з середньою ставкою в 16% річних.

Дохідність фонду у грудні становила 0.8% (9.7% річних). Зменшення динаміки приросту активів фонду в грудні зумовлено продовженням тенденції до переоцінки інструментів з фіксованою дохідністю після чергового збільшення облікової ставки з боку НБУ до 14.5%. Як зазначалося вище, дохідність ОВДП на вторинному та первинному ринках збільшилася, що призвело до зменшення їхньої вартості в портфелі фонду, що і стало причиною тимчасового зменшення динаміки приросту активів "ОТП Пенсія". Загалом, за 2017 рік дохідність недержавного пенсійного фонду «ОТП Пенсія» складала 11.3%.

Контакти

Відкритий пенсійний фонд "ОТП Пенсія" 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.	Консультація: (044) 492 34 69 E-mail: pension@otpbank.com.ua Сайт: www.otppension.com.ua
ТОВ "Компанія з управління активами "ОТП Капітал" Ліцензія НКЦФР АД №075876 від 28.09.2012 (безстрокова) на здійснення діяльності з управління активами інституційних інвесторів (діяльності 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
ТОВ "Адміністратор пенсійного фонду "Центр персоналізованого обліку" Ліцензія Нацфінпослуг 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