

# Щомісячний звіт

31 січня 2017 року



## Відкритий недержавний пенсійний фонд "ОТП Пенсія"

### Інформація про фонд

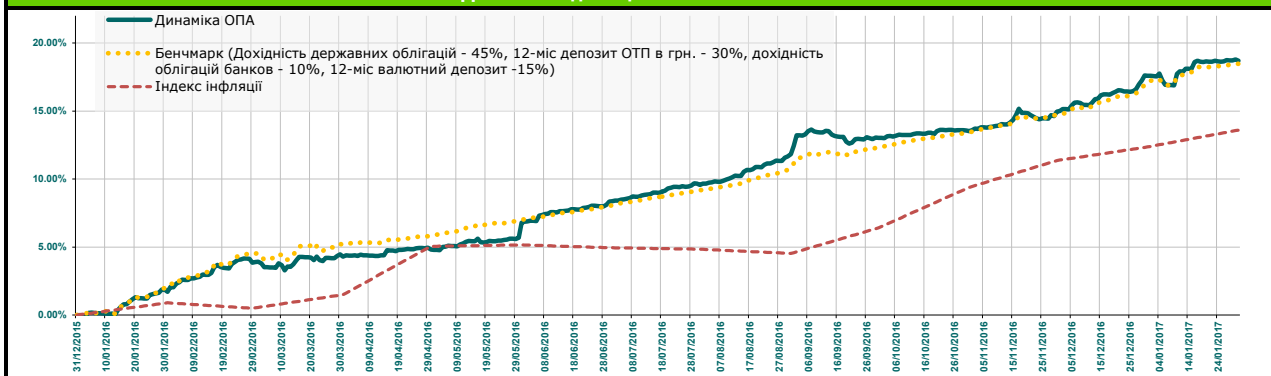
|                                       |                        |  |
|---------------------------------------|------------------------|--|
| <b>Дата створення</b>                 | Червень 2009 р.        | Стратегія фонду спрямована на формування консервативного інвестиційного портфеля з максимальним 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. |
| <b>Код ЄДРПОУ</b>                     | 36274196               |  |
| <b>Компанія з управління активами</b> | ТОВ "КУА "ОТП Капітал" |  |
| <b>Адміністратор</b>                  | ТОВ "АЦПО"             |  |
| <b>Банк-зберігач</b>                  | АТ "Укрсббанк"         |  |

### Показники діяльності

### Дохідність фонду

|   |                    |                             |                  |                 |
|---|--------------------|-----------------------------|------------------|-----------------|
| <b>Чиста вартість активів</b>                   | 89 538 961.36 грн. |                             | <b>За період</b> | <b>У річних</b> |
| <b>Сума пенсійних внесків за період</b>         | 701 741.16 грн.    | <b>1 місяць</b>             | 0.9%             | 11.7%           |
| <b>Сума пенсійних виплат за період</b>          | 175 988.74 грн.    | <b>3 місяці</b>             | 4.5%             | 19.5%           |
| <b>Кількість учасників</b>                      | 29 562             | <b>6 місяців</b>            | 8.3%             | 17.3%           |
| <b>Кількість вкладників - фіз. осіб</b>         | 7 366              | <b>1 рік</b>                | 16.7%            | 16.7%           |
| <b>Кількість вкладників - юр. осіб</b>          | 36                 | <b>3 початку року</b>       | 0.9%             | 11.7%           |
| <b>Чиста вартість одиниці пенсійних внесків</b> | 3.23114            | <b>3 початку діяльності</b> | 226.1%           | 16.8%           |

### Динаміка одиниці пенсійних внесків



### Портфель фонду

|   |                             |  |   |                             |       |    |                             |       |
|---|-----------------------------|--|---|-----------------------------|-------|----|-----------------------------|-------|
| <b>Державні/державні облігації (ОВДП)</b> | <b>49.7%</b>                |  |   |                             |       |    |                             |       |
| ОВДП з погашенням в 2019 р.               | 35.9%                       |  |   |                             |       |    |                             |       |
| ОВДП з погашенням в 2018 р.               | 7.9%                        |  |   |                             |       |    |                             |       |
| ОВДП з погашенням в 2020 р.               | 5.7%                        |  |   |                             |       |    |                             |       |
| ОВДП з погашенням в 2017 р.               | 0.1%                        |  |   |                             |       |    |                             |       |
| <b>Корпоративні облігації</b>             | <b>2.8%</b>                 |  |   |                             |       |    |                             |       |
| ПАТ "Альфа Банк"                          | 1.8%                        |  |   |                             |       |    |                             |       |
| ПАТ "Таскомбанк"                          | 1.1%                        |  |   |                             |       |    |                             |       |
| <b>Депозити та грошові кошти</b>          | <b>44.4%</b>                |  |   |                             |       |    |                             |       |
| ПАТ "Ідея Банк"                           | 8.8%                        |  |   |                             |       |    |                             |       |
| ПАТ "Альфа Банк"                          | 7.4%                        |  |   |                             |       |    |                             |       |
| ПАТ "Таскомбанк"                          | 7.2%                        |  |   |                             |       |    |                             |       |
| ПАТ "Укргазбанк"                          | 7.1%                        |  |   |                             |       |    |                             |       |
| ПАТ "Ошадбанк"                            | 6.6%                        |  |   |                             |       |    |                             |       |
| ПАТ "Мегабанк"                            | 4.8%                        |  |   |                             |       |    |                             |       |
| ПАТ "Укрсббанк"                           | 2.6%                        |  |   |                             |       |    |                             |       |
| <b>Інші</b>                               | <b>3.0%</b>                 | <table border="1"> <tr> <td>₴</td> <td><b>Інструменти в гривні</b></td> <td>89.0%</td> </tr> <tr> <td>\$</td> <td><b>Інструменти в доларі</b></td> <td>11.0%</td> </tr> </table> | ₴ | <b>Інструменти в гривні</b> | 89.0% | \$ | <b>Інструменти в доларі</b> | 11.0% |
| ₴   | <b>Інструменти в гривні</b> | 89.0%  |   |                             |       |    |                             |       |
| \$  | <b>Інструменти в доларі</b> | 11.0%  |   |                             |       |    |                             |       |

### Коментар



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

У січні НБУ залишив незмінною облікову ставку, очікуючи прискорення інфляції у 1 кварталі 2017. Висока ліквідність у банківській системі на початку року зумовила стабілізацію ставок дохідності на грошовому ринку. Дохідність депозитних сертифікатів НБУ на 14 днів залишилась на рівні 14% річних. Дохідність ОВДП з терміном до погашення 11 місяців становила 15.7%-16.3%, дохідність довгих паперів з терміном до погашення 2 і 3 роки становила 16% - 16.5% річних. Ставка за короткими депозитами (до 3 місяців) складала до 16% річних. Ставки на більш довгі терміни складають до 19% річних.

В кінці грудня та на початку січня відбувся тимчасовий приріст курсу доларів США відносно гривні. З метою фіксації дохідності валютних активів, у січні з портфеля фонду були продані валютні облігації Міністерства фінансів України на загальну суму 9.7 млн. грн. (11% активів). Взаєм в портфель фонду були придбані облігації Міністерства фінансів України з погашенням в 2019 та 2020. Ці облігації характеризуються найвищою дохідністю серед державних облігацій. Частка валютних інструментів у портфелі фонду знизилась до 11%. Вільні кошти фонду розміщувались на депозитах в ПАТ "Таскомбанк" та ПАТ "Альфа Банк" на загальну суму 1.2 млн. грн. Середня ставка, за якою розміщувались кошти становила 18.9% річних.

Дохідність фонду становила 0.9%, що на 0.4% вище бенчмарку. Девальвація гривні на 1.9% у першій половині січня року спричинила здороження валютних активів фонду, які частково були продані з подальшим придбанням 2-річних та 3-річних ОВДП. З огляду на продовження тренду стабільності курсу гривні ми продовжимо заміну валютних інструментів на гривневі з довгою дюрацією.



### Контакти

|   |   |
|---|---|
| <b>Відкритий пенсійний фонд "ОТП Пенсія"</b><br>Свідоцтво про реєстрацію фінансової установи: ПФ № 116 від 26.03.2009.<br>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><br>E-mail: pension@otpbank.com.ua<br>Сайт: www.otppension.com.ua                                 |
| <b>ТОВ "Компанія з управління активами "ОТП Капітал"</b><br>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. Фізкультурни, 28Д<br>Тел./факс: (044) 492 34 69<br>E-mail: capital@otpbank.com.ua<br>Сайт: www.otpcapital.com.ua |
| <b>ТОВ "Адміністратор пенсійного фонду "Центр персоналізованого обліку"</b><br>Ліцензія Нацфінпослуг на провадження діяльності з адміністрування недержавних пенсійних фондів АБ № 115988 від 07.02.2008 р. (безстрокова)   | 04080, м. Київ, вул. Кирилівська, 40<br>Тел./факс: (044) 537 66 57<br>E-mail: info@acpo.com.ua<br>Сайт: www.acpo.com.ua               |