

Щомісячний звіт

31 серпня 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"	

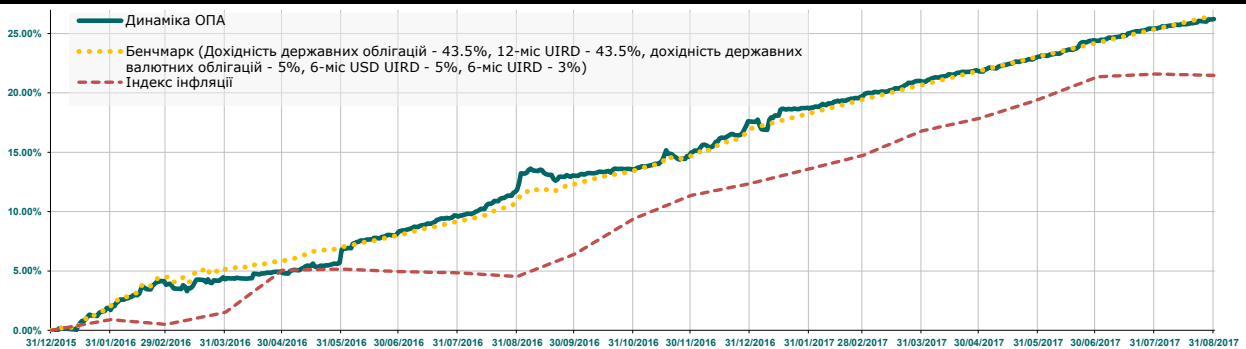
Показники діяльності

Чиста вартість активів	101 829 779.60 грн.
Сума пенсійних внесків за період	853 591.28 грн.
Сума пенсійних виплат за період	198 196.13 грн.
Кількість учасників	31 568
Кількість вкладників - фіз. осіб	9 383
Кількість вкладників - юр. осіб	34
Чиста вартість одиниці пенсійних внесків	3.46810

Дохідність фонду

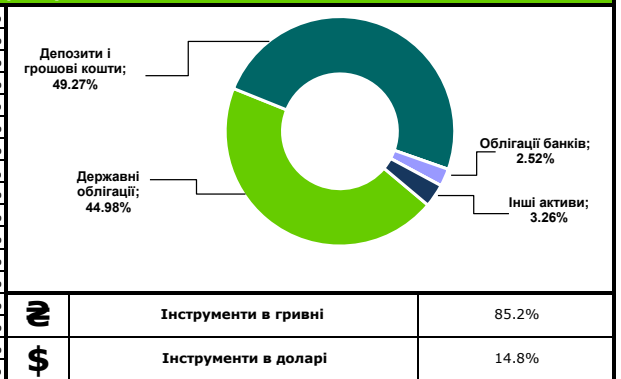
	За період	У річних
1 місяць	0.6%	7.9%
3 місяці	2.6%	10.7%
6 місяців	5.2%	10.6%
1 рік	12.9%	12.9%
3 початку року	7.3%	11.2%
3 початку діяльності	246.8%	16.4%

Динаміка одиниці пенсійних внесків



Портфель фонду

Державні облігації (ОВДП)	45.0%
ОВДП з погашенням в 2020 р.	3.9%
ОВДП з погашенням в 2019 р.	30.1%
ОВДП з погашенням в 2018 р.	11.0%
Корпоративні облігації	2.5%
ПАТ "Альфа Банк"	1.6%
ПАТ "Таскомбанк"	0.9%
Депозити та грошові кошти	49.3%
ПАТ "Приватбанк"	9.2%
ПАТ "Ідея Банк"	9.2%
ПАТ "УкрГазбанк"	8.1%
ПАТ "Альфа Банк"	7.7%
ПАТ "Таскомбанк"	6.3%
ПАТ "Мегабанк"	4.4%
ПАТ "Ощадбанк"	3.9%
ПАТ "УкрСиббанк"	0.4%
Інші	3.3%



Коментар

Юрій Олексієнко,
 Керівник департаменту з питань інвестиційної діяльності

На початку серпня НБУ проводив засідання щодо прийняття рішень по обліковій ставці. Незважаючи на уповільнення інфляції в липні, монетарний регулятор залишив ключову ставку без змін на рівні 12.5%. Це зумовлено поточним ризиком відхилення інфляції від цільового діапазону НБУ, що стимулює регулятора проводити стриману монетарну політику. Відтак, дохідність ОВДП в серпні не змінилася і залишилася на рівні кінця липня. Зокрема, дохідність короткострокових ОВДП (до 1 року) знаходилися на рівні 14.9%. Дохідність довгих паперів з терміном погашення 2 і 3 роки становила 15% та 15.1% відповідно. Ставки за короткими депозитами (до 3 місяців) складають до 14% річних. Ставки на більш довгі терміни становлять до 16% річних.

Сезонна активність експортерів продовжувала підтримувати гривню в серпні місяці. Як наслідок, ревальваційний тренд гривні відносно долара США досягнув локальних максимумів, а саме найвищого значення з серпня 2016 року. Ставки у доларах США у звітному періоді по короткострокових депозитах залишилися на рівні 1-4% річних, а по довгострокових (терміном до 12 місяців) - на рівні 3-5% річних.

У звітному періоді з портфеля фонду були продані облігації Міністерства фінансів України на загальну суму 31.2 млн. грн. В свою чергу, в портфель фонду були придбані облігації Міністерства фінансів України на суму 31.8 млн. грн., з який 7.9 млн. склали облігації деноміновані в долар. Відтак, частка валютних активів в портфелі фонду була збільшена майже до 15%. Вільні кошти фонду розміщувалися на короткострокових депозитах в ПАТ "УкрГазбанк" та ПАТ "Ощадбанк" на загальну суму 0.5 млн. грн. з середньою ставкою в 11.52% річних.

Дохідність фонду у серпні становила 0.6%. Стимулюючим фактором у звітному періоді стало збільшення частки валютних активів до майже 15%. Дії спрямовані на нарощення частки валютних активів в портфелі фонду зумовлені нашими очікуваннями щодо девальвації гривні до рівня 27-27,5 UAH/USD до кінця 2017 року. Відтак, збільшення частки валютних активів, в першу чергу, направлено на забезпечення додаткової диверсифікації та захисту учасників та вкладників НПФ «ОТП Пенсія».

Контакти

<p>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.</p>	<p>Консультація: (044) 492 34 69 E-mail: pension@otpbank.com.ua Сайт: www.otppension.com.ua</p>
<p>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)</p>	<p>03150, м. Київ, вул. Фізкультури, 28Д Тел./факс: (044) 492 34 69 E-mail: capital@otpbank.com.ua Сайт: www.otpcapital.com.ua</p>
<p>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)</p>	<p>04080, м. Київ, вул. Кирилівська, 40 Тел./факс: (044) 537 66 57 E-mail: info@acpo.com.ua Сайт: www.acpo.com.ua</p>