

Щомісячний звіт

31 січня 2018 року



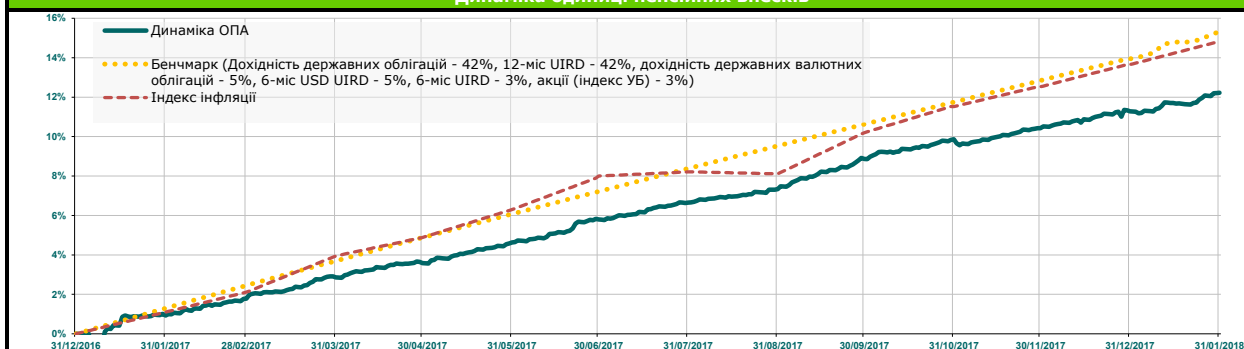
Відкритий недержавний пенсійний фонд "ОТП Пенсія"

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 облигації, облигації гарантовані державою. До 80% активів можуть бути інвестовані в найбільш дохідний сегмент грошового ринку - банківські депозити і облигації; до 50% активів - в державні облигації, що демонструють найвищу дохідність в умовах зниження відсоткових ставок на грошовому ринку. Цільова доля інструментів в іноземній валюті - 10% активів.
Код ЄДРПОУ	36274196	
Компанія з управління активами	ТОВ "КУА "ОТП Капітал"	
Адміністратор	ТОВ "АЦПО"	
Банк-зберігач	ПАТ "УкрСиббанк"	

Показники діяльності	Значення	Дохідність фонду		
		За період	У річних	
Чиста вартість активів	110 340 560.05 грн.			
Сума пенсійних внесків за період	1 292 933.06 грн.	1 місяць	0.8%	10.6%
Сума пенсійних виплат за період	148 180.61 грн.	3 місяці	2.1%	8.9%
Кількість учасників	33 657	6 місяців	5.2%	10.7%
Кількість вкладників - фіз. осіб	11 258	1 рік	11.1%	11.1%
Кількість вкладників - юр. осіб	40	3 початку року	0.8%	10.6%
Чиста вартість одиниці пенсійних внесків	3.62605	3 початку діяльності	262.6%	16.2%

Динаміка одиниці пенсійних внесків



Портфель фонду

Державні облигації (ОВДП)	46.0%	
ОВДП з погашенням в 2019 р.	20.5%	
ОВДП з погашенням в 2020 р.	17.8%	
ОВДП з погашенням в 2022 р.	7.2%	
ОВДП з погашенням в 2018 р.	0.6%	
Корпоративні облигації	3.4%	
ПАТ "Альфа Банк"	2.6%	
ПАТ "Таскомбанк"	0.9%	
Депозити та грошові кошти	44.4%	
ПАТ "Приватбанк"	8.5%	
ПАТ "Ідея Банк"	7.9%	
ПАТ "Таскомбанк"	6.7%	
ПАТ "Альфа Банк"	4.8%	
ПАТ "Кредобанк"	3.7%	
ПАТ "Кредит-вест Банк"	3.6%	
ПАТ "УкрГазбанк"	3.4%	
ПАТ "Прокредит Банк"	3.3%	
ПАТ "УкрСиббанк"	2.5%	
ПАТ "Ощадбанк"	2.0%	
ПАТ "Мегабанк"	0.1%	
ПАТ "УкрСиббанк"	0.5%	
Акції	3.8%	
ПАТ "Райффайзен Банк Аваль"	2.9%	
ПАТ "Укрнафта"	0.9%	
Інші	2.3%	

Коментар



Юрій Олексієнко,
Керівник департаменту з питань інвестиційної діяльності



В першій половині січня 2018 року фінансовий ринок України перебував в зоні турбулентності, оговтуючись від збільшення облікової ставки на 100 б.п. в грудні 2017 року та сезонної девальвації гривні. В кінці січня НБУ неочікувано знову підійняв облікову ставку на 150 б.п., що призвело до нових негативних наслідків на ринку ОВДП. Значні інфляційні ризики, зокрема імовірність відтермінування чергового траншу МВФ, збільшення урядом соціальних видатків та зростання цін на енергоносії змушують регулятора вдатися до жорстких дій та збільшити облікову ставку до 16%.

Збільшення ключової ставки другий місяць поспіль сильно вплинуло на ринок облигацій: дохідності 2-х та 3-х річних ОВДП зросли до рівня 16% - 16.75%, а дохідності короткострокових ОВДП досягали рівнів в 16.5% - 17.2% в кінці січня. На відміну від ОВДП, депозитні ставки, за присутності ліквідності в банківській системі, продемонстрували зниження - за короткими депозитами (до 3-х місяців) спостерігалася зниження ставок до рівня 13.5%. Ставки по депозитах на більш довгі терміни не перевищували рівень 15.1% річних. У звітному періоді акції індексного кошика демонстрували наступну динаміку: зросли акції ПАТ "Центренерго" (+21.5%), ПАТ "Мотор Січ" (+15.4%), ПАТ "Райффайзен Банк Аваль" (+3.3%) та ПАТ "Донбасенерго" (+2.5%), знизилися ціни паперу ПАТ "Укрнафта" (-8.4%).

У січні з портфеля фонду були продані облигації Міністерства фінансів України на загальну суму 12.9 млн. грн., в тому числі і ОВДП номіновані в доларах, а взаємні були придбані облигації Міністерства фінансів України на суму 12.9 млн. грн. Фонд також продовжив нарощувати позиції по найбільш перспективних акціях: скориставшись тимчасовою корекцією ринку акцій були придбані цінні папери ПАТ «Укрнафта» на суму 626 тис. грн. та ПАТ "Райффайзен Банк Аваль" на суму 3.2 млн грн. Вільні кошти фонду розміщувались на депозитах в ПАТ "УкрГазбанк" на загальну суму 1.3 млн. грн.

Дохідність фонду у січні становила 0.8% (10.6% річних). Помірна динаміка приросту активів фонду в звітному періоді зумовлена зростанням ставок по ОВДП на вторинному ринку через збільшення облікової ставки НБУ другий місяць поспіль. Як наслідок, низка ОВДП, які знаходилися в портфелі фонду, були переоцінені в нижчу сторону.

Контакти

Відкритий пенсійний фонд "ОТП Пенсія" Свідчення 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 Націфінпослуг 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