

Щомісячний звіт

30 червня 2023 року



Відкритий недержавний пенсійний фонд "ОТП Пенсія"

Інформація про фонд

Дата створення	Грудень 2008 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 - 10% активів.
Код ЄДРПОУ	36274196	
Компанія з управління активами	ТОВ "КУА "ОТП Капітал"	
Адміністратор	ТОВ "АЦПО"	
Банк-зберігач	АТ "Піреус Банк"	

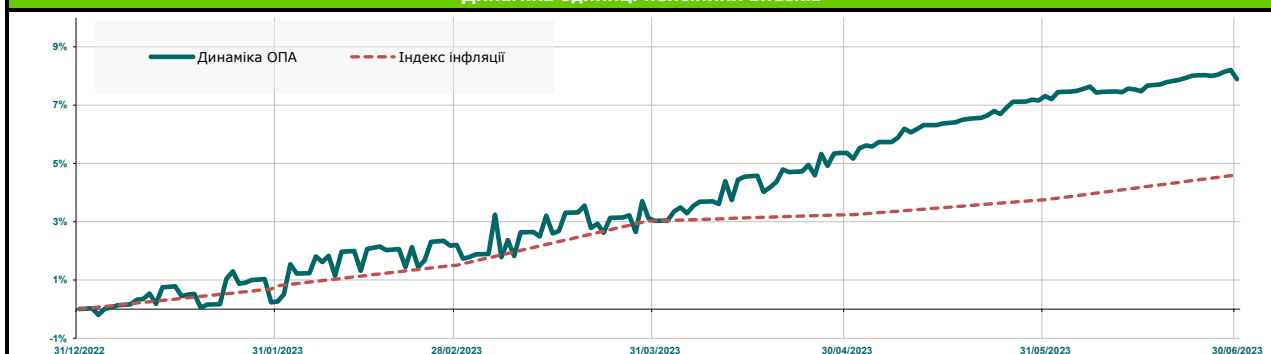
Показники діяльності

Чиста вартість активів	429 167 579 грн.
Сума пенсійних внесків за період	4 827 410 грн.
Сума пенсійних виплат за період	690 081 грн.
Кількість учасників	63 599
Кількість вкладників - фіз. осіб	39 904
Кількість вкладників - юр. осіб	73
Чиста вартість одиниці пенсійних внесків	6.61164 грн.

Дохідність фонду

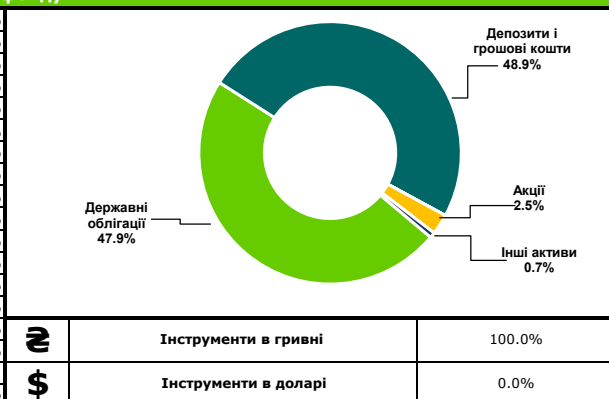
	За період	У річних
1 місяць	0.5%	6.7%
3 місяці	4.7%	20.3%
6 місяців	7.9%	16.4%
1 рік	8.3%	8.3%
3 початку року	7.9%	16.4%
3 початку діяльності	561.2%	14.4%

Динаміка одиниці пенсійних внесків



Портфель фонду

Державні облігації (ОВДП)	47.9%
ОВДП з погашенням в 2024 р.	28.7%
ОВДП з погашенням в 2025 р.	16.9%
ОВДП з погашенням в 2026 р.	1.5%
ОВДП з погашенням в 2027 р.	0.8%
Депозити та грошові кошти	48.9%
АТ "ПУМБ"	9.6%
АТ "Укресімбанк"	9.4%
АТ "Агропресперіс"	3.5%
АТ "Південний"	8.3%
АТ "Таскомбанк"	2.8%
АТ "Прокредит Банк"	9.1%
АТ "Кредобанк"	1.2%
АТ "Піреус Банк"	5.0%
Акції	2.5%
АТ "Райффайзенбанк Аваль"	2.5%
Інші	0.7%



Коментар



Юрій Олексієнко,
Керівник департаменту з питань інвестиційної діяльності



Макроекономічні показники за червень, переважно уповільнення інфляції та стабільний курс гривні, демонструють всі передумови до пом'якшення монетарної політики з боку НБУ. І хоча члени монетарного комітету НБУ в червні залишили облікову ставку на тому ж рівні, 25%, дискусія, яка виникла під час обговорення макроекономічної ситуації в Україні, продемонструвала наміри регулятора розпочати зниження облікової ставки значно раніше ніж в четвертому кварталі. Ринку ОВДП знайшов свою рівновагу, яка сформувалась ще травні, на наступних рівнях: до 1 року 13%-18.5%, ОВДП до 2 років - 18.5%-20.15%, ОВДП від 2 років - 20%-20.5%. На первинному ринку попит на ОВДП був помірний від банків, що дозволило Міністерству фінансів поступово піднімати дохідності ОВДП номінованих в валюті та пропонувати їх на первинному аукціоні по 4.8%. Проте вводячи обмеження на об'єм розміщення, змушує інвесторів конкурувати за рахунок дохідності до погашення. На вторинному ринку дохідності по валютним ОВДП не перевищують 4.7%.

Банки знайшли рівновагу по депозитним ставкам в червні та залучали як гривневу ліквідність по 16%-18%, так і доларову під 1.5%-2%, що відповідає рівням квітня-травня.

Гривня знайшла збалансований рівень між пропозицією та попитом на готівковому валютному ринку на рівні 37.2- 37.4 грн/дол протягом звітного місяця. Причини не змінні: стабілізація надходжень допомоги від західних партнерів та повне припинення «друкування» гривні з боку НБУ задля фінансування бюджету.

На ринку акцій все залишається без суттєвих змін і в червні - кволий об'ємів торгів та відсутність інвестиційних ідей серед акцій індексного кошика. Індекс Української Біржі (UX) обвалився на 17.3%, де головними чинниками падіння були наступні акції - ПАТ «Донбасенерго» на 78.2%, ПАТ «Центренерго» на 27.5%, Kernel Holding S.A на 12.4%.

В червні НПФ «ОТП Пенсія» активно перекладав свої активи. З портфеля фонду «ОТП Пенсія» були продані ОВДП на суму 16.3 млн. грн., а придбано ОВДП з кращою дохідністю на 13.4 млн. грн. В депозитній частині кошти перекладалися в наступні банки: 17.3 млн. грн. в АТ "Таскомбанк", 20.1 млн. грн. в АТ "Піреус Банк", 41.1 млн. грн. в АТ "ПУМБ", 17.5 млн. грн. в АТ "Прокредит Банк", 9.9 млн. грн. в АТ "Укресімбанк", 21.2 млн. грн. в АТ "Укргазбанк" та 15 млн. грн. в АТ "Агропресперіс".

Сталі дохідності по середньостроковим ОВДП допомогли зрости активам фонду протягом місяця. Проте, переоцінка від НБУ в останній день місяця знизила ціни по двох ОВДП, що мають значні частки в портфелі, та зменшила позитивний результат в цілому. «ОТП Пенсія» заробив для своїх учасників 0.5% в червні (або 6.7% річних).

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 НКЦПФР 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