

Щомісячний звіт			31 жовтня 2023 року		otp Pension	
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				Дохідність фонду		
Чиста вартість активів		466 203 059 грн.		За період		У річних
Сума пенсійних внесків за період		4 351 679 грн.		1 місяць		18.3%
Сума пенсійних виплат за період		810 642 грн.		3 місяці		17.0%
Кількість учасників		63 672		6 місяців		17.6%
Кількість вкладників - фіз. осіб		39 986		1 рік		17.0%
Кількість вкладників - юр. осіб		77		3 початку року		17.3%
Чиста вартість одиниці пенсійних внесків		7.00192 грн.		3 початку діяльності		14.5%
Динаміка одиниці пенсійних внесків						
Портфель фонду						
Державні облігації (ОВДП)		49.9%				
ОВДП з погашенням в 2026 р.		32.0%				
ОВДП з погашенням в 2025 р.		16.0%				
ОВДП з погашенням в 2027 р.		1.9%				
Депозити та грошові кошти		46.6%				
АТ "СЕНС Банк"		9.5%				
АТ "Укресімбанк"		9.4%				
АТ "Прокредит Банк"		8.9%				
АТ "ПУМБ"		9.6%				
АТ "Таскомбанк"		2.4%				
АТ "Агропросперіс"		3.2%				
АТ "Ощадбанк"		3.5%				
АТ "Піреус Банк"		0.2%				
Акції		2.2%				
АТ "Райффайзенбанк Аваль"		2.2%				
Інші		1.4%				
Коментар						
		Монетарний комітет НБУ (МК- далі) здивував ринок своїм рішенням у жовтні, знизивши облікову ставку відразу на 4%, з 20% до 16%, що було всупереч своїх прогнозів: до 18% на кінець 2023 та 16% на кінець 2024 року. В той же час, дизайн монетарної системи регулятор залишив без змін, обґрунтовуючи це збереженням привабливості гривневих інструментів, переважно депозитів, – без змін залишилися ставки по депозитним сертифікатам овернайт, 16%, по депозитним сертифікатам 3м, 20%, та ставка рефінансування для банків – 22%. І якщо депозитні ставки в банках залишилися без змін після рішення МК, то дохідності по ОВДП знизилися як на первинному ринку так і на вторинному. На первинному аукціоні від Мінфіна зниження відбулось по всій лінійці ОВДП: з погашенням 36 місяців – з 19.21% в вересні до 18.82% в жовтні, з погашенням 17-26 місяців та до 15 місяців – з 18.3% до 18.05% та з 17.8% до 17.08% відповідно. Ставки по строковим депозитам залишилися без змін в жовтні та знаходилися на рівнях 11%-15.5% в залежності від терміну. Дохідності ОВДП номінованих в валюті залишаються на сталому рівні на первинних аукціонах на рівнях 4.7%-4.8% в доларі та 3.1%-3.15% в євро. Проте, вводячи обмеження на об'єм розміщення, Мінфін змушує інвесторів конкурувати за рахунок дохідності до погашення. На вторинному ринку дохідності по валютним ОВДП не перевищують 4% в доларі та 2.75% в євро. Запровадження гнучкого курсу гривні від НБУ не мало негативного впливу на курс гривні, завдяки професійним діям регулятора, який задовільнив шалений попит в перші тижні жовтня, і вже до кінця місяця пропозиція переважала над попитом. Як наслідок, офіційний та готівкові курси гривні зміцнілися на 0.88% на 1.05% відповідно. На 31.10 офіційний курс склав 36.25 грн./дол., а готівковий - 37.8 грн./дол. Після шаленого зростання у вересні, на 36.1%, за рахунок акцій ПАТ «Центренерго», + 95.9%, та ПАТ «Донбасенерго», + 52.9%, індекс акцій (UX від УБ) продемонстрував незначну корекцію, знизившись на 8.7%. Відсутність ліквідності ми мусимо констатувати вже котрий місяць поспіль. Головними чинниками падіння були наступні тіж самі акції індексного кошика – ПАТ «Донбасенерго», -30%, та ПАТ «Центренерго», -16.7%. У жовтні НПФ «ОТП Пенсія» продовжував активно перевкладав свої активи з короткострокових в середньострокові, збільшуючи дохідність активів. З портфеля фонду "ОТП Пенсія" були продані ОВДП на суму 128.4 млн. грн., а придбано ОВДП з кращою дохідністю на 128.8 млн. грн. В депозитний частині кошти перевклалися в наступні банки: 5.1 млн. грн. в АТ "Укресімбанк" та 3.7 млн. грн. в АТ "ПУМБ". Поступове зниження дохідностей середньострокових ОВДП та активне управління портфелем допомогли зрости активам фонду протягом місяця. У жовтні, «ОТП Пенсія» заробив для своїх учасників 1.4% (або 18.3% річних), та 14.3% (або на 17.3% річних) з початку року.				
Контакти						
Відкритий пенсійний фонд "ОТП Пенсія"				Консультація: (044) 492 34 69		
Свідцтво про реєстрацію фінансової установи: ПФ № 116 від 26.03.2009.				E-mail: pension@otpbank.com.ua		
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.				Сайт: www.otppension.com.ua		
ТОВ "Компанія з управління активами "ОТП Капітал"				03150, м. Київ, вул. Фізкультури, 28Д		
Ліцензія НКЦПФР АД №075876 від 28.09.2012 (безстрокова) на здійснення діяльності з управління активами інституційних інвесторів (діяльності з управління активами)				Тел./факс: (044) 492 34 69		
				E-mail: capital@otpbank.com.ua		
				Сайт: www.otpcapital.com.ua		
ТОВ "Адміністратор пенсійного фонду "Центр персоналізованого обліку"				04080, м. Київ, вул. Кирилівська, 40		
Ліцензія Нацфінпослуг на провадження діяльності з адміністрування недержавних пенсійних фондів АБ № 115988 від 07.02.2008 р. (безстрокова)				Тел./факс: (044) 537 66 57		
				E-mail: info@acpo.com.ua		
				Сайт: www.acpo.com.ua		