

Щомісячний звіт

30 листопада 2022 року



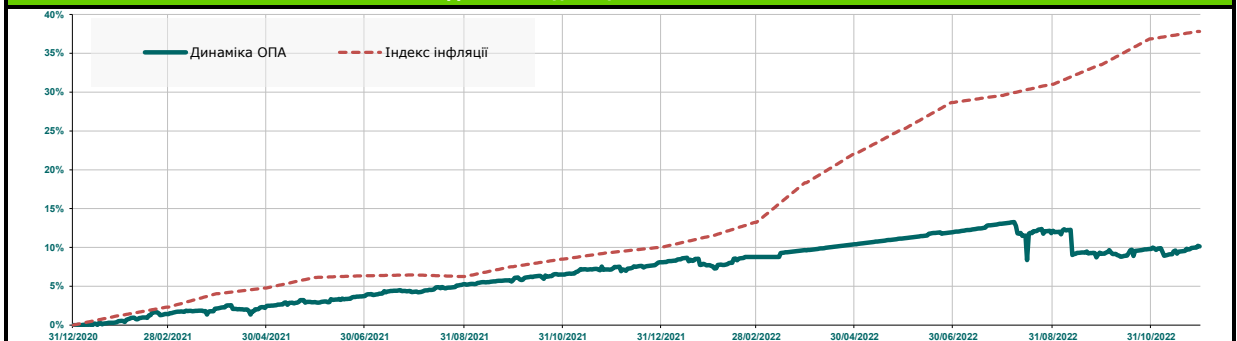
Відкритий недержавний пенсійний фонд "ОТП Пенсія"

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		Дохідність фонду		
Чиста вартість активів	370 971 281 грн.		За період	У річних
Сума пенсійних внесків за період	2 669 870 грн.	1 місяць	0.3%	3.7%
Сума пенсійних виплат за період	696 183 грн.	3 місяці	-1.8%	-7.0%
Кількість учасників	63 447	6 місяців	-0.9%	-1.9%
Кількість вкладників - фіз. осіб	39 792	1 рік	2.8%	2.8%
Кількість вкладників - юр. осіб	74	3 початку року	1.9%	2.1%
Чиста вартість одиниці пенсійних внесків	6.00250 грн.	3 початку діяльності	500.3%	14.3%

Динаміка одиниці пенсійних внесків



Портфель фонду

Державні облігації (ОВДП)	45.5%	
ОВДП з погашенням в 2023 р.	22.4%	
ОВДП з погашенням в 2025 р.	11.9%	
ОВДП з погашенням в 2024 р.	10.2%	
ОВДП з погашенням в 2027 р.	0.8%	
Муніципальні облігації	4.9%	
Облігації м. Львів	4.9%	
Корпоративні облігації	11.9%	
ТОВ "Манівео ШФД"	2.9%	
ТОВ "Альфа-Лізинг"	4.0%	
ТОВ "Нова пошта"	4.7%	
ТОВ "СС Лоун"	0.3%	
Депозити та грошові кошти	35.1%	
АТ "Укргазбанк"	9.8%	
АТ "Таскомбанк"	5.4%	
АТ "Піреус Банк"	11.4%	
АТ "Агропросперіс Банк"	2.7%	
АТ "Кредобанк"	1.8%	
АТ "Альфа Банк"	1.0%	
Акції	2.1%	₴ Інструменти в гривні 99.0% \$ Інструменти в доларі 1.0%
АТ "Райффайзенбанк Аваль"	2.1%	
Інші	0.5%	

Коментар

Юрій Олексієнко,
Керівник департаменту з питань інвестиційної діяльності

На первинному ринку ОВДП в листопаді, уряд продовжив поступово піднімати відсоткові ставки, однак їх поточний рівень все одно залишається суттєво нижчим порівняно з вторинним ринком. В такій ситуації бюджет продовжує недотримувати фінансування з ринку та перекидає дефіцит за рахунок емісії НБУ. Наразі найбільш популярними ОВДП є короткострокові, з погашенням до одного року, а їх дохідність на вторинному ринку може досягати 17%-19%, однак уряд на первинних аукціонах пропонує їх на рівні 12%-14%.

В свою чергу, вторинний ринок ОВДП вже знайшов свою точку рівноваги і торгується з кривою дохідності від 16% (погашення на початку 2023 року) до 23% (погашення в 2025 році) залежно від терміну погашення.

Ринок українських єврооблігацій демонстрував яскраві висхідний тренд протягом декількох тижнів на фоні успіхів ЗСУ, а саме - визволення міста Херсон та Правобережної частини Херсонської області. В листопаді єврооблігації піднялися в ціні на 20%. Готівковий валютний ринок як розпочав місяць в області 40 USD/UAH, так його і завершив на тому ж рівні.

Ринок акцій отримав чергову «ін'єкцію» негативу через примусову конфіскацію в державну власність низки компаній, які були присутні на ринку та мали велику кількість дрібних інвесторів-тримачів цих акцій. Конфісковані були частки в наступних компаніях: "Укрнафта", "Укртатнафта", АвтоКРАЗ, "Мотор Січ" і "Запоріжтрансформатор". Серед даних підприємств найбільш впливовими на ринку акцій були "Укрнафта" і "Мотор Січ". Однак, акції "Мотор Січ" вже декілька років заблоковані, тому найбільший резонанс викликала, все таки, конфіскація акцій ПАТ "Укрнафта". Причому, негатив не полягає в тому, що дане підприємство було відчужене в акціонерів на користь держави, а в тому, що акцій на українському ринку стає все менше. Відчуження відбувалося в межах Закону України «Про передачу, примусове відчуження або вилучення майна в умовах правового режиму воєнного чи надзвичайного стану», який передбачає компенсацію з боку держави за вилучення майна.

В портфелі "ОТП Пенсія" на момент вилучення знаходилося 9 950 акцій "Укрнафта" на загальну суму близько 2 млн. грн. (0,5% активів фонду). КУА «ОТП Капітал» наразі працює над організацією механізму компенсації з боку держави фонду "ОТП Пенсія" за вилученні акції.

В листопаді з портфеля фонду "ОТП Пенсія" були продані ОВДП на суму 12.7 млн. грн., придбано ОВДП на 1.4 млн. грн. В депозитній частині кошти перевклалися в наступні банки: 3.3 млн. грн. в АТ "Таскомбанк", 30 млн. грн. в АТ "Піреус банк", 15.5 млн. грн. в АТ "Укргазбанк", 1.3 млн. грн. в АТ "Кредобанк".

За результатами листопада фонд "ОТП Пенсія" зріс на 0.3%. Незначний позитивний результат зумовлений вилученням акцій "Укрнафта".

Контакти

Відкритий пенсійний фонд "ОТП Пенсія"	Консультація: (044) 492 34 69 E-mail: pension@otpbank.com.ua Сайт: www.otppension.com.ua
Свідство 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.	
ТОВ "Компанія з управління активами "ОТП Капітал"	03150, м. Київ, вул. Фізкультури, 28Д Тел./факс: (044) 492 34 69 E-mail: capital@otpbank.com.ua Сайт: www.otpcapital.com.ua
Ліцензія НКЦПФР АД №075876 від 28.09.2012 (безстрокова) на здійснення діяльності з управління активами інституційних інвесторів (діяльності з управління активами)	
ТОВ "Адміністратор пенсійного фонду "Центр персоналізованого обліку"	04080, м. Київ, вул. Кирилівська, 40 Тел./факс: (044) 537 66 57 E-mail: info@acpo.com.ua Сайт: www.acpo.com.ua
Ліцензія Нацфінпослуг на провадження діяльності з адміністрування недержавних пенсійних фондів АБ № 115988 від 07.02.2008 р. (безстрокова)	