

Щомісячний звіт

31 січня 2023 року



Відкритий недержавний пенсійний фонд "ОТП Пенсія"

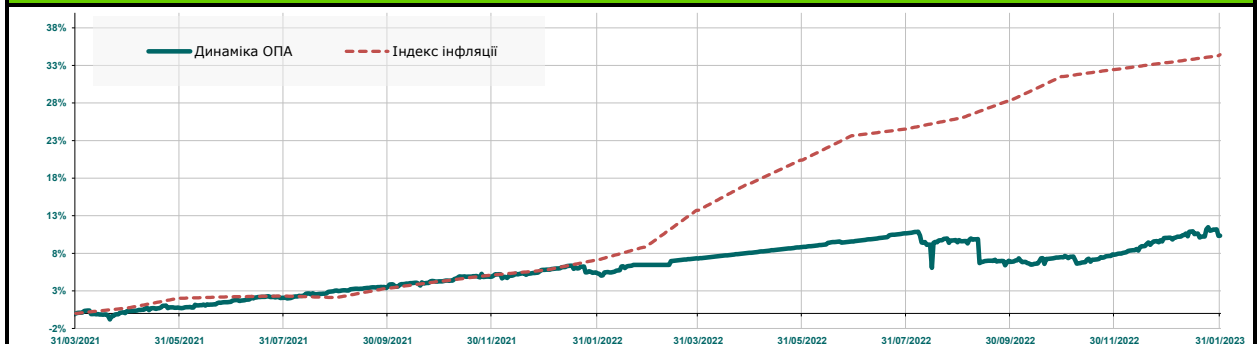
Інформація про фонд

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	384 196 381 грн.			
Сума пенсійних внесків за період	2 927 191 грн.	1 місяць	0.3%	3.1%
Сума пенсійних виплат за період	655 277 грн.	3 місяці	2.7%	11.1%
Кількість учасників	63 467	6 місяців	-0.3%	-0.6%
Кількість вкладників - фіз. осіб	39 818	1 рік	4.8%	4.8%
Кількість вкладників - юр. осіб	74	3 початку року	0.3%	3.1%
Чиста вартість одиниці пенсійних внесків	6.14390 грн.	3 початку діяльності	514.4%	14.3%

Динаміка одиниці пенсійних внесків



Портфель фонду

Державні облігації (ОВДП)	49.6%			
ОВДП з погашенням в 2023 р.	21.7%			
ОВДП з погашенням в 2025 р.	15.2%			
ОВДП з погашенням в 2024 р.	11.9%			
ОВДП з погашенням в 2027 р.	0.8%			
Корпоративні облігації	4.7%			
ТОВ "Нова пошта"	4.7%			
Депозити та грошові кошти	42.6%			
АТ "Укргазбанк"	8.0%			
АТ "Таскомбанк"	9.8%			
АТ "Піреус Банк"	8.7%			
АТ "Прокредит Банк"	9.8%			
АТ "Ощадбанк"	3.0%			
АТ "Агропросперіс Банк"	2.6%			
АТ "Кредобанк"	1.4%			
АТ "Альфа Банк"	0.1%			
Акції	2.5%		Інструменти в гривні	100.0%
АТ "Райффайзенбанк Аваль"	2.5%		Інструменти в доларі	0.0%
Інші	0.6%			

Коментар

Юрій Олексієнко,
Керівник департаменту з питань інвестиційної діяльності

Монетарний комітет НБУ, на черговому засіданні в січні місяці, залишив незмінною облікову ставку на рівні 25%, вважаючи даний рівень достатнім для стримування інфляції та забезпечення економічного відновлення в поточних умовах. Зростання інфляції зупинилось в останні два місяці 2022 року, що дало змогу НБУ поліпшити її прогноз на 2023 рік, до 18%-19%.

Міністерство фінансів почало більш активніше піднімати відсоткові ставки на первинних аукціонах ОВДП, з огляду на попит зі сторони банків, які прагнуть купити їх задля формування резервів. Зокрема на 2,5 річні ОВДП було запропоновано ставку 19.75%, на 2 річні 19.6%. Вторинний ринок ОВДП збільшив активність на початку року з огляду на привабливі ціни: 6 місячні ОВДП продавались по 18%-18.5%, 10 місячні - по 20%, а 2 річні - по 25% дохідності. Загальний обсяг угод за номінальною вартістю на вторинному ринку ОВДП склав 36.3 млрд грн в січні (29 млрд. грн. в грудні). Зростання об'єму угод на вторинному ринку відбулось завдяки попиту від нерезидентів на ОВДП з погашенням в квітні та травні. Справа в тому, що нерезиденти очікують можливість репатріювати свої інвестиції після 1 квітня.

Банки тримали ставки по депозитах без змін протягом звітного місяця, на рівні 16%-18.5%, в залежності від строку розміщення. Зростання дохідностей ОВДП в область 19.5%-19.75% на первинних аукціонах Мінфіну може спонукати банки до підняття депозитних ставок в боротьбі за ліквідність ринку.

Гривна зміцнилась на готівковому валютному ринку в січні з 40.7 до 40- 40.5 грн/дол. Причиною є стабілізація надходжень допомоги від західних партнерів та зменшення обсягів «друкування» гривні з боку НБУ.

Ринок акцій залишився кволим щодо об'ємів торгів в січні місяці. Індекс Української Біржі (UX), після оновлення індексного кошика в грудні, впав на 16.3%. Лідерами падіння були акції ПАТ «Центренерго» -57.5%, «Kernel Holding S.A.» -11.1% та АТ «Райффайзен Банк» -10%.

В перший місяць 2023 року ННПФ «ОТП Пенсія» активно перебалансовував структуру своїх активів. Кошти від погашення корпоративних облігацій були розміщені на депозити та в високодохідні середньострокові ОВДП. Частка ОВДП досягла 50%, а депозитів - 42.5%. В січні, з портфеля фонду "ОТП Пенсія" були продані ОВДП на суму 24.7 млн. грн., придбано ОВДП на 35.6 млн. грн. В депозитній частині кошти перевклалися в наступні банки: 10.3 млн. грн. в АТ "Таскомбанк", 30 млн. грн. в АТ "Піреус банк", 11.8 млн. грн. в АТ "Прокредит Банк", 17,3 млн. в АТ "Ощадбанк".

Зниження ціни акцій АТ «Райффайзен Банк» та тимчасове падіння цін на середньострокові ОВДП в останній день місяця призвели до зменшення сукупної дохідності фонду в звітному місяці. Незважаючи на високу волатильність активів, що перебувають у портфелі ННПФ, «ОТП Пенсія» заробив для своїх учасників 0.3% в січні місяці (або 3.1% річних).

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 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