

Щомісячний звіт

30 вересня 2022 року



Відкритий недержавний пенсійний фонд "ОТП Пенсія"

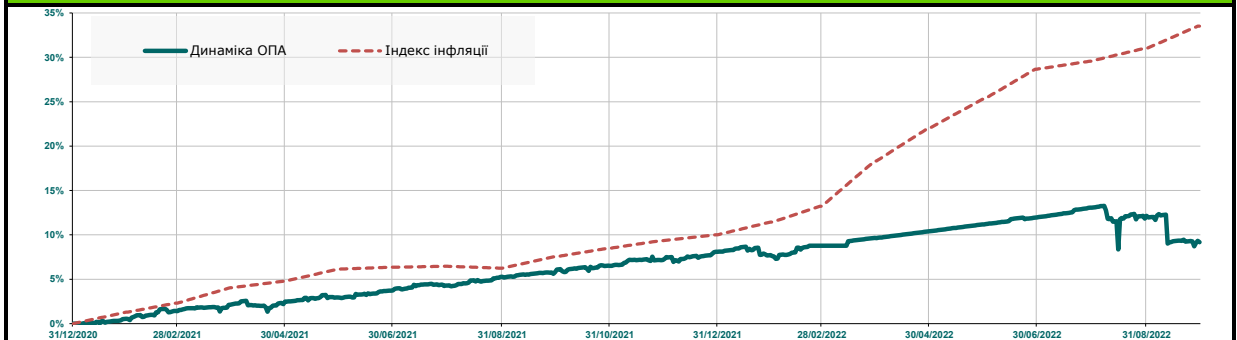
Інформація про фонд

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

Чиста вартість активів	364 529 073 грн.	Дохідність фонду		
Сума пенсійних внесків за період	2 621 173 грн.		За період	У річних
Сума пенсійних виплат за період	476 123 грн.	1 місяць	-2.7%	-27.6%
Кількість учасників	63 436	3 місяці	-2.5%	-9.6%
Кількість вкладників - фіз. осіб	39 781	6 місяців	-0.4%	-0.8%
Кількість вкладників - юр. осіб	73	1 рік	3.2%	3.2%
Чиста вартість одиниці пенсійних внесків	5.95026 грн.	3 початку року	1.0%	1.3%
		3 початку діяльності	495.0%	14.4%

Динаміка одиниці пенсійних внесків



Портфель фонду

Державні облігації (ОВДП)	49.2%		
ОВДП з погашенням в 2023 р.	25.3%		
ОВДП з погашенням в 2025 р.	12.0%		
ОВДП з погашенням в 2024 р.	10.8%		
ОВДП з погашенням в 2027 р.	1.1%		
Муніципальні облігації	4.8%		
Облігації м. Львів	4.8%		
Корпоративні облігації	12.6%		
ТОВ "Манівео ШФД"	2.8%		
ТОВ "Альфа-Лізинг"	4.1%		
ТОВ "Нова пошта"	4.9%		
ТОВ "СС Лоун"	0.9%		
Депозити та грошові кошти	29.6%		
АТ "Таскомбанк"	9.8%		
АТ "Кредобанк"	5.1%		
АТ "Піреус Банк"	7.7%		
АТ "Укргазбанк"	2.0%		
АТ "Агропросперіс Банк"	2.7%		
АТ "Альфа Банк"	1.4%		
Акції	3.3%	₵	Інструменти в гривні
АТ "Райффайзенбанк Аваль"	2.7%		
ПАТ "Укрнафта"	0.6%		
Інші	0.5%		
		\$	Інструменти в доларі
			1.0%

Коментар



Юрій Олексієнко,
Керівник департаменту з питань інвестиційної діяльності



В вересні ринок цінних паперів України, після серпневого відкриття, показав певні ознаки стабілізації та зрівноваження. Ключовим сегментом ринку цінних паперів є ОВДП. Ціни на державні облігації продовжуються залишатися достатньо волатильними, однак вже проглядається рівновага в області 17-21% дохідності. В свою чергу, Мінінфін не зважає на вторинний ринок і рівні відсоткових ставок та продовжує пропонувати на первинних аукціонах ОВДП з дохідністю в 12%-16%, залучаючи при цьому достатньо мало коштів. Дохідність доларових ОВДП не змінилася та залишилася на рівні 4.5%. Єврооблігації України позитивно відреагували на військові перемоги України в харківській області піднявшись на 10-20%. Однак, після оголошення про мобілізацію ціна знову знизилася до своїх мінімумів. Корпоративні облігації торгуються з премією до дохідності гривневих ОВДП в області 2%-4%. В вересні ринок акцій продовжив поступово відновлювати активність, однак спреди залишаються достатньо широкими відтак поодинокі торгівля супроводжується високою волатильністю і динамікою в діапазоні до 10% протягом однієї торгової сесії.

Процентні ставки по банківським депозитам під впливом бажання банків накопичувати пасиви демонстрували достатньо тривалий зростаючий тренд з моменту підняття облікової ставки до 25%. Однак в вересні можна було спостерігати зменшення апетитів банківських установ, що призвело навіть до зниження відсоткових ставок по депозитам в деяких банків. Наразі банки приймають кошти під 12%-18% річних.

Готівковий валютний ринок, розпочавши вересень в області 40 UAH/USD, вже під завершення місяця досяг максимальних значень в 43-44 UAH/USD під впливом інформації про старт мобілізації в росії. Однак під завершення звітної періоду, курс відкоригувався до 42 UAH/USD.

Управління фондом НПФ "ОТП Пенсія" в вересні відбувалося в напрямку акумулювання ліквідності, та перекладання коштів в короткострокові депозити по ставках 15%-18%. Інша частина коштів направлялася на купівлю короткострокових ОВДП та корпоративних облігацій за ставками в області 20%.

Повноцінний запуск ринку цінних паперів та відновлення торгів на вторинному ринку протягом серпня та вересня створило підґрунтя для нормалізації оцінювання за справедливою вартістю активів фондів під управлінням «ОТП Капітал». Таким чином, в поточному звіті результати роботи фонду включають корегування ринку та відображають поточну справжню вартість портфеля. Іншими словами, в поточній вартості портфелю фонду вже закладені та враховані усі негативні наслідки які існують в даний час на фінансовому ринку. Відтак, в вересні фонд НПФ "ОТП Пенсія" продемонстрував негативну динаміку в -2.7%.

Контакти

Відкритий пенсійний фонд "ОТП Пенсія" 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.	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