

Щомісячний звіт

30 листопада 2020 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 облигації, облигації гарантовані державою. До 80% активів можуть бути інвестовані в найбільш дохідний сегмент грошового ринку - банківські депозити і облигації; до 50% активів - в державні облигації, 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 | ПАТ "УкрСиббанк" | |

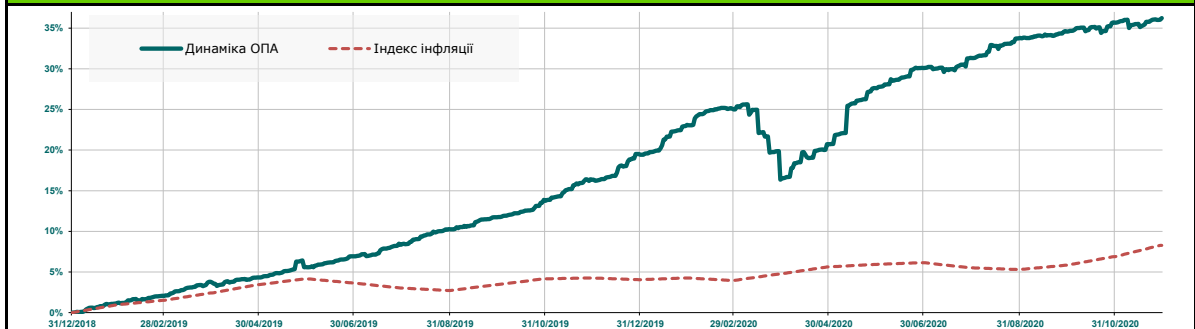
Показники діяльності

| | |
|--|------------------|
| Чиста вартість активів | 237 392 241 грн. |
| Сума пенсійних внесків за період | 3 959 103 грн. |
| Сума пенсійних виплат за період | 633 963 грн. |
| Кількість учасників | 55 920 |
| Кількість вкладників - фіз. осіб | 32 653 |
| Кількість вкладників - юр. осіб | 54 |
| Чиста вартість одиниці пенсійних внесків | 5.38765 грн. |

Дохідність фонду

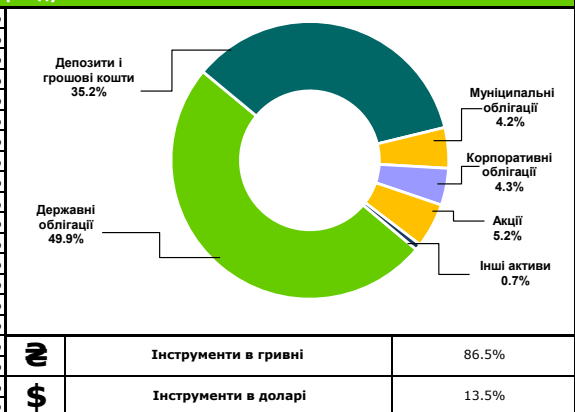
| | За період | У річних |
|----------------------|-----------|----------|
| 1 місяць | 0.4% | 5.1% |
| 3 місяці | 1.8% | 7.5% |
| 6 місяців | 6.8% | 14.0% |
| 1 рік | 17.1% | 17.1% |
| 3 початку року | 14.1% | 15.5% |
| 3 початку діяльності | 438.8% | 15.9% |

Динаміка одиниці пенсійних внесків



Портфель фонду

| | |
|----------------------------------|--------------|
| Державні облигації (ОВДП) | 49.9% |
| ОВДП з погашенням в 2021 р. | 17.5% |
| ОВДП з погашенням в 2025 р. | 16.6% |
| ОВДП з погашенням в 2023 р. | 9.9% |
| ОВДП з погашенням в 2022 р. | 6.0% |
| Муніципальні облигації | 4.7% |
| Облігації м. Львів | 4.7% |
| Корпоративні облигації | 4.3% |
| ПАТ "Укрпошта" | 4.3% |
| Депозити та грошові кошти | 35.2% |
| ПАТ "Альфа Банк" | 9.5% |
| ПАТ "Таскомбанк" | 9.3% |
| ПАТ "Укргазбанк" | 7.8% |
| ПАТ "Ідея Банк" | 4.6% |
| ПАТ "Прокредит Банк" | 3.2% |
| ПАТ "УкрСиббанк" | 0.7% |
| Акції | 5.2% |
| ПАТ "Райффайзенбанк Аваль" | 4.5% |
| ПАТ "Укрнафта" | 0.7% |
| Інші | 0.7% |



| | | |
|----|----------------------|-------|
| ₴ | Інструменти в гривні | 86.5% |
| \$ | Інструменти в доларі | 13.5% |

Коментар



Юрій Олексієнко,
Керівник департаменту з питань інвестиційної діяльності



Серед тенденцій українського фінансового ринку, що мали місце в листопаді, варто виділити поступове і не значне зростання відсоткових ставок на первинних аукціонах Мінфіну. Уряд ще необхідно запозичити на ринку достатньо значні суми коштів до кінця року і, для того щоб конкурувати з пропозицією ОВДП на вторинному ринку, Мінфін вирішив частково збільшити дохідності ОВДП, які він пропонує на аукціонах. Вторинний ринок ОВДП в листопаді, навпаки, рухався в сторону зниження дохідностей, що було продиктоване попитом від закордонних інвесторів. В жовтні крім внутрішніх проблем України, на закордонних інвесторів тиснули і загальна невизначеність щодо пандемії Коронавірусу та президентських виборів в США. Однак в листопаді, переміг максимально проукраїнський кандидат, з'явилось декілька позитивних анонсів щодо появи вакцини, в Україні розвіявся резонанс навколо рішення конституційного суду. Сукупність цих подій позитивно вплинула на наміри учасників ринку, що і позначилось в тенденціях дохідностей по ОВДП на вторинному ринку.

Загалом справедлива оцінка ОВДП з боку НБУ наразі складає по річним облигаціям - 10.6%, 3-х річним - 11.6%, 5-ти річним - 11.7%. Дохідності ОВДП номінованих в валюті залишилися на незмінних рівнях.

Найбільше позитиву від відновлення апетиту до ризиків на фоні перемоги Бадейна та потенційної вакцини увібрив себе ринок українських Єврооблігацій, який в листопаді показав карколомне падіння ставок. Зокрема єврооблігації з погашенням в 2023 році знизилися з 6.5% до 4.8%, а на кінці кривої з погашенням 32-го року з 8.2% до 6.7%.

Валютний ринок в листопаді місяці виявився достатньо збалансованим. Однак, на початку звітного періоду спостерігались активні девальваційні тенденції, які зупинилися на рівні 28.6 UAH/USD. Саме на цьому рівні увімкнулися експортери і почали активно продавати валюту, яку притримували раніше, що спровокувало зниження UAH/USD до 28.1. В подальшому відбувалось поступове повернення до рівня 28.45 UAH/USD з чого і фактично був розпочатий звітний місяць.

В частині інвестицій в акції варто відзначити ріст вартості акцій "Укрнафти". Ключовим фактором зростання став проголосований законопроект про врегулювання тривалого корпоративного конфлікту між "Укрнафтою" та "Нафтогазом". Який передбачає повернення великого боргу "Нафтогазу" "Укрнафті", та як наслідок, виплату податкових зобов'язань "Укрнафти" державі. Таким чином, Укрнафта в перспективі суттєво покращує свої фінансові показники, відкриває вікно для нормальної прибуткової роботи та найголовніше, з'являється імовірність виплати дивідендів за минулі прибуткові роки, що робить дану акцію надзвичайно привабливою. Відтак відбулась відповідна реакція на ринку, акції Укрнафти піднялися в листопаді на 28.4%. Цінні папери "Райффайзен Банк Аваль" теж прожовували рух догори на фоні зростання прибутку та перспективних високих дивідендів - +12,3% в листопаді.

У звітному періоді з портфеля фонду "ОТП Пенсія" були продані облигації Міністерства фінансів України на загальну суму 2.1 млн. грн. Взаєм були придбані облигації Міністерства фінансів України на загальну суму 6.6 млн. грн. В листопаді також була збільшена позиція в "Райффайзен Банк аваль" на 1.1 млн. грн. Вільні кошти було розміщено на депозити: 1.7 млн. грн. в ПАТ "Альфа Банк", 1.5 млн. грн. в ПАТ "Таскомбанк", 7.5 млн. грн. в ПАТ "Укргазбанк".

НПФ "ОТП Пенсія" за результатами жовтня продемонстрував дохідність 0.4%, або 5.1% в річному відображенні. Загалом, з початку року фонд приніс свої вкладникам 14.1% (15.5% річних).

Контакти

| | |
|--|--|
| Відкритий пенсійний фонд "ОТП Пенсія" Свідоцтво про реєстрацію фінансової установи: ФФ № 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 (діяльність 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 |