

Щомісячний звіт

30 вересня 2023 року



Відкритий недержавний пенсійний фонд "ФріФлайт"

Інформація про фонд

Дата створення	Березень 2007 р.	Стратегія фонду спрямована на формування консервативного інвестиційного портфеля з максимальним захистом накопичених коштів в валютних інструментах. Основні складові: банківські депозити та облігації гарантовані державою. Цільова частка інструментів в іноземній валюті - до 100% активів.
Код ЄДРПОУ	34985916	
Компанія з управління активами	ТОВ "КУА "ОТП Капітал"	
Адміністратор	ТОВ "АЦПО"	
Банк-зберігач	АТ "Піреус Банк"	

Показники діяльності

Дохідність фонду

		Валюта	За період		У річних	
			€	\$	€	\$
Чиста вартість активів	35 027 326 грн.					
Сума внесків під управлінням за період	313 448 грн.	1 місяць	0.7%	0.7%	8.2%	8.2%
Сума виплат з активів під управлінням за період	1 547 грн.	3 місяці	2.8%	2.8%	11.8%	11.8%
Кількість учасників	2 529	6 місяців	5.0%	5.0%	10.2%	10.2%
Кількість вкладників - фіз. осіб	2 389	1 рік	2.1%	2.1%	2.1%	2.1%
Кількість вкладників - юр. осіб	9	3 початку року	3.5%	3.5%	4.7%	4.7%
Чиста вартість одиниці пенсійних внесків	0.89898 грн.	3 початку діяльності	25.8%	-18.1%	5.0%	-4.1%

Динаміка одиниці пенсійних внесків



Портфель фонду

Державні облігації	44.6%	Державні облігації 44.6% Депозити і грошові кошти 54.9% Інші активи 0.4%
ОВДП з погашенням в 2024 р.	28.0%	
ОВДП з погашенням в 2023р.	5.7%	
ОЗДП з погашенням в 2025 р.	10.9%	
Депозити та грошові кошти	54.9%	
АТ "Агропросперіс Банк"	9.3%	
АТ "Ощадбанк"	8.3%	
АТ "Укресімбанк"	8.0%	
АТ "Таскомбанк"	8.6%	
АТ "ПУМБ"	7.5%	
АТ "СЕНС банк"	7.7%	
АТ "Піреус Банк" (ПР)	5.6%	
Інші	0.4%	
\$	Активи в валюті	96.6%
€	Активи в гривні	3.4%

Коментар

Юрій Олексієнко,
Керівник департаменту з питань інвестиційної діяльності

Цикл зниження ставок панував і у вересні в стінах НБУ, монетарний комітет (МК- далі) якого знизив вдруге в цьому році облікову ставку - з 22% до 20%. Поточні макроекономічні показники значно краще очікують регулятора, що дозволяє йому запроваджувати пом'якшення монетарної політики аж до кінця 2023 року. Як ми і наголошували в попередніх звітах, такі дії НБУ будуть спонукати попит на середньострокові та довгострокові ОВДП, які мають найкращу дохідність на первинному та вторинному ринках. Хоча попит на первинних аукціонах був стабільний, проте це вплинуло на дохідності ОВДП, які залишилися на тих же рівнях, як і до зниження облікової ставки: ОВДП з погашенням 36 місяців - 19.21%, з погашенням 17-26 місяців та до 15 місяців - 18.3% та 17.8% відповідно.

Низхідний рух ставок по депозитним сертифікатам з 18% до 16% вплинув і на ставки по строковим депозитам, які відреагували відповідно на 1%-2%, до 11%-15% вже в вересні.

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 4.3% в доларі та 2.5% в євро.

Очікування запровадження гнучкого курсу гривні від НБУ спровокувало попит на валюту на готівковому ринку, що призвело до її девальвації на 0.8% з 37.9 до 38.2 грн./дол. Очікуємо коливання готівкового курсу гривні до офіційного повідомлення від НБУ про пом'якшення валютних обмежень.

Попит на ОЗДП був підвищеним на початку вересня на тлі очікувань візиту Президента України в США та можливого розширенню номенклатури зброї для захисту країни. Проте в кінці вересня бажаних активно купувати українські єврооблігації не було через що ціни знизились від своїх максимумів. Загалом, ринок знайшов певну рівновагу на плі відсутності новин, а ціни ОЗДП зафіксували зростання на 1.8%-5.6% по всій лінійці випусків у вересні. ОЗДП з погашенням 2025 році, що перебувають в портфелі НПФ «Фрі Флайт» з часткою в 10.3% зросли на 5.6%.

В вересні, в портфель фонду «Фрі Флайт» були придбані валютні ОВДП на загальну суму 4.5 млн. грн. В частині депозитів були розміщення активів в наступні банки: 28 тис. дол. в АТ «Сенс Банк».

Зростання вартості ОЗДП в вересні допомогло отримати позитивного результату для фонду за звітний місяць. «Фрі Флайт» зріс на 0.7% в доларах (або на 8.2% річних) в вересні, та на 3.5% в доларах (або на 4.7% річних) з початку року.

Контакти

Відкритий пенсійний фонд "ФРІФЛАЙТ" Свідцтво про реєстрацію фінансової установи: ПФ №90 від 20.07.2007 р., реєстраційний номер: 12102011. 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.freeflight.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