

Щомісячний звіт

31 Липня 2022 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"	

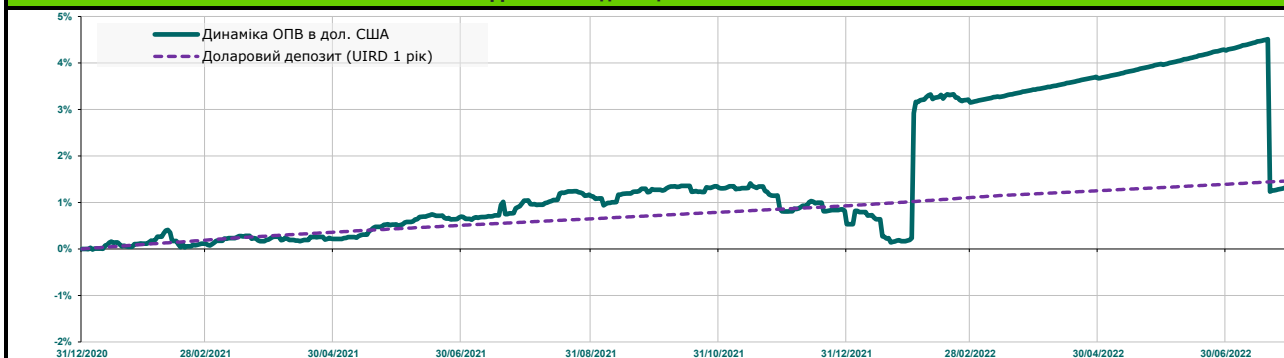
Показники діяльності

Чиста вартість активів	27 006 738 грн.
Сума внесків під управлінням за період	800 841 грн.
Сума виплат з активів під управлінням за період	5 850 грн.
Кількість учасників	2 480
Кількість вкладників - фіз. осіб	2 340
Кількість вкладників - юр. осіб	7
Чиста вартість одиниці пенсійних внесків	1.21145 грн.

Доходність фонду

	Валюта	За період		У річних	
		€	\$	€	\$
1 місяць		21.5%	-2.8%	932.2%	-29.1%
3 місяці		22.2%	-2.3%	122.8%	-8.7%
6 місяців		28.4%	1.1%	65.0%	2.2%
1 рік		36.4%	0.3%	36.4%	0.3%
3 початку року		35.1%	0.8%	67.5%	1.4%
3 початку діяльності		69.5%	10.3%	15.9%	2.8%

Динаміка одиниці пенсійних внесків



Портфель фонду

Державні облігації (ОВДП)	41.9%							
ОЗДП з погашенням в 2023 р.	36.1%							
ОВДП з погашенням в 2023 р.	5.8%							
Корпоративні облігації	2.2%							
ТОВ "Манівео ШФД"	2.2%							
Депозити та грошові кошти	55.3%							
АТ "Укргазбанк"	9.4%							
АТ "Таскомбанк"	9.2%							
АТ "Кредівест Банк"	9.1%							
АТ "Агропресперіс Банк"	7.7%							
АТ "Кредобанк"	5.6%							
АТ "Приватбанк"	1.1%							
АТ "Піреус Банк"	11.3%							
Інші	0.7%							
		<table> <tr> <td>\$</td><td>Активи в валюті</td><td>88.4%</td></tr> <tr> <td>€</td><td>Активи в гривні</td><td>11.6%</td></tr> </table>	\$	Активи в валюті	88.4%	€	Активи в гривні	11.6%
\$	Активи в валюті	88.4%						
€	Активи в гривні	11.6%						

Коментар

Юрій Олексієнко,
Керівник департаменту з питань інвестиційної діяльності

В липні фінансовий ринок вийшов на максимальну активність з лютого 2022 року. На первинному ринку ОВДП, нарешті, відбулось зростання відсоткових ставок. Міністерство фінансів України почало прислухатися до учасників ринку та перейшло в режим збільшення конкурентності відсоткових ставок ОВДП. На початку липня Мінфін збільшив доходність валютних ОВДП до 4%, а в другій половині липня, ріст ставок відбувався і по гривневим випускам. Зокрема, доходність по річних ОВДП збільшилася до 14%, а по півторарічним випускам доходність пропонувався на рівні 16%. Очікування ринку наразі є значно вищими, особливо в умовах 25% облікової ставки та рівня інфляції, який прямує в область 30%. Саме тому основні залучення уряду на первинних аукціоні липня були за рахунок валютних ОВДП.

Ще однією важливою тенденцією липня є максимальна активізація учасників ринку в напрямку впливу на регулятора НКЦПФР щодо відкриття ринку цінних паперів. З 24 лютого увесь ринок цінних паперів заблокований рішенням НКЦПФР у зв'язку з воєнним станом. Наразі заборонений обіг по усім старим випускам ОВДП, корпоративним, муніципальним, евро-облігаціям, акціям та іншим ЦП. Однак професійні учасники ринку, асоціації, приватні інвестори сходяться на тому, що ринок цінних паперів потрібно відкрити і відповідні бажання постійно ретранслюються на НКЦПФР. Відтак, з великою ймовірністю в серпні-вересні ринок цінних паперів буде відкритий в певному форматі.

В сегменті еврооблігацій теж максимальна активність. Україна, не зважаючи на усі попередні заяви Міністра фінансів та інших представників уряду, все таки вирішила йти шляхом реструктуризації еврооблігацій. Наразі параметри наступні: відтермінувати усі платежі по українським еврооблігаціям на 2 роки включаючи як тіло так і нараховані відсотки, відсотки продовжують нараховуватися на неоплачені суми і будуть сплачені після проходження 2-х річного періоду. Реакція ринку була нейтральною, адже даний сценарій вже був закладений в ціни ще в червні. Наразі українські еврооблігації торгуються в діапазоні 34%-18% від номіналу. Після активації процесу реструктуризації з боку держави за алогічним сценарієм пішли і усі державні компанії, зокрема, НАК «Нафтогаз», НЕК «Укренерго» та ДААДУ «Укравтодор». Тримачі еврооблігацій НАК «Нафтогаз» не підтримали реструктуризацію і компанія фактично потрапила в стан дефолту.

На валютному ринку теж багато зрушень, зокрема, 21 липня НБУ збільшив офіційний курс до 36.58 USD/UAH та 37.41 EUR/UAH. Готівковий ринок теж активізувався - за липень курс UAH/USD збільшився з 35 до 40, а на максимумах досягав 42.2 UAH/USD. Нажаль усі нові надходження в гривні ми не можемо трансформувати в доларові активи через обмеження з боку НБУ та закриття ринку ЦП. Відповідно усі нові надходження в фонд ми розміщуємо в короткострокові гривневі інструменти - депозити та військові облігації. Зокрема, 1 млн. грн. розміщено в АТ "Піреус Банк", 0.5 млн. грн. в АТ "Укргазбанк". Доларові депозити лонгуються.

За результатами липня НПФ "Фрі Флайт" в доларах знизився на 2.3% через вплив гривневої частини вкладень на портфель після зростання офіційного курсу USD/AUH до 36.7. В гривні за звітний місяць фонд продемонстрував ріст у 21.5%. З початку року фонд приніс вкладникам 0.8% в доларах та 35% в гривні.

Контакти

Відкритий пенсійний фонд "ФРІФЛАЙТ" Свідоцтво про реєстрацію фінансової установи: ПФ №90 від 20.07.2007 р., реєстраційний номер: 12102011. Вказана доходність не є прогнозом доходності чи гарантією збільшення доходів учасників недержавного пенсійного фонду в майбутньому, а лише показником вже отриманої історичної доходності 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