

Щомісячний звіт

31 Серпня 2022 року



Відкритий недержавний пенсійний фонд "ФріФлайт"

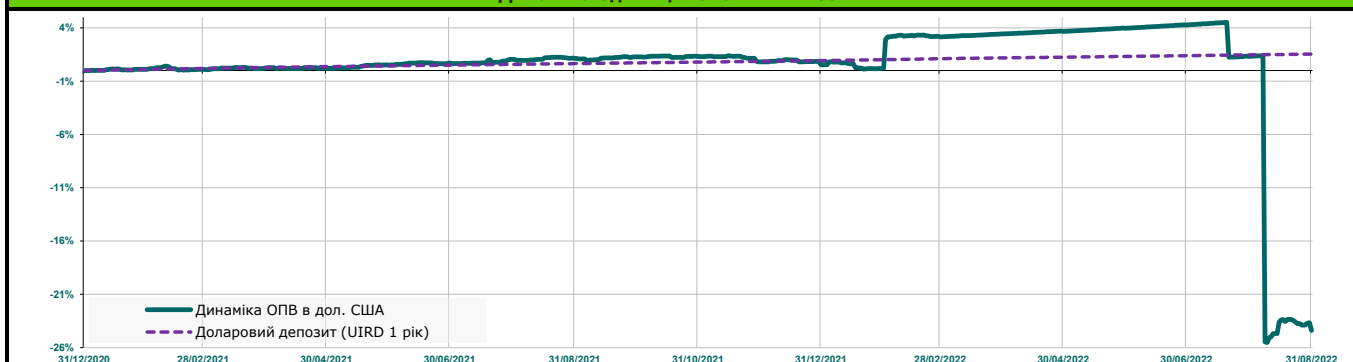
Інформація про фонд

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

		Дохідність фонду			
		За період	У річних		
Чиста вартість активів	25 865 043 грн.	Валюта	€	\$	€
Сума внесків під управлінням за період	1 578 424 грн.	1 місяць	-25.4%	-25.4%	-97.0%
Сума виплат з активів під управлінням за період	2 094 грн.	3 місяці	-9.1%	-27.3%	-31.7%
Кількість учасників	2 490	6 місяців	-8.4%	-26.7%	-16.0%
Кількість вкладників - фіз. осіб	2 349	1 рік	1.8%	-25.2%	1.8%
Кількість вкладників - юр. осіб	8	3 початку року	0.8%	-24.8%	1.2%
Чиста вартість одиниці пенсійних внесків	0.90399 грн.	3 початку діяльності	26.5%	-17.7%	6.6%

Динаміка одиниці пенсійних внесків



Портфель фонду

Державні облігації	41.9%	Депозити і грошові кошти 55.3% Корпоративні облігації 2.2% Інші активи 0.7% Державні облігації 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 "Кредивест Банк"	9.1%			
АТ "Агропросперіс Банк"	7.7%			
АТ "Кредобанк"	5.6%			
АТ "Приватбанк"	1.1%			
АТ "Піреус Банк"	11.3%			
Інші	0.7%			
		\$	Активи в валюті	88.4%
		грн	Активи в гривні	11.6%

Коментар

Юрій Олексієнко,
Керівник департаменту з питань інвестиційної діяльності

В серпні, головною і довгоочікуваною подією, стало відкриття ринку цінних паперів. 8 серпня, після довготривалої перерви з 24 лютого, НКЦПФР відновила роботу ринку. За час заблокованого ринку сформувалися нові економічні умови: новий рівень відсоткових ставок, значне зниження економічної активності, падіння експорту, висока інфляція та девальвація, тощо. В таких умовах природною є реакція, після відкриття ринку, в сторону зниження вартості активів.

Ринок ОВДП отримав низхідні стимули з блоку нового рівня відсоткових ставок, зокрема облікова ставка 25% супроводжується 27% вартістю рефінансування банків з боку НБУ, та 23% дохідністю розміщення коштів на депозитні сертифікати. З іншого боку, в країні високий очікуваний рівень девальвації та інфляції, що теж тисне на відсоткові ставки ОВДП. Державні облігації до війни були основним фінансовим інструментом, відповідно тримаючи, після відкриття ринку, через потребу в ліквідності вийшли з пропозицією. Як наслідок, в зазначених умовах, рівень відсоткових ставок по ОВДП стрибнув з 13%-14% до 17%-20%, що і призвело до зниження їх цін. Однак, ринок гривневих ОВДП в серпні не встиг активізуватися на повну потужність та сформувати стійкий збалансований рівень, а валютні облігації не відреагували на відкриття ринку суттєвими рухами відсоткових ставок. Наразі державні облігації деноміновані в доларах торгуються з дохідністю в діапазоні 3%-5%.

Ринок корпоративних та муніципальних облігацій залишається не активним, однак рівень відсоткових ставок по даним інструментам сформувався з певною премією до ОВДП, яка сягнула 3%-7%. В залежності від якості позичальника, дохідність корпоративних та муніципальних облігацій знаходиться на рівні 23%-30%.

Ринок акцій відреагував на відкриття значними просадками цін на усі основні акції українських емітентів, які ще торгуються на біржах. Зокрема, акції АТ "Райффайзен банк" -22%, акції ПАТ "Центрэнерго" -36.6%, акції ПАТ "Укрнафта" -16%.

На валютному ринку в серпні відбулася своєрідна стабілізація. Готівковий курс гривні, після значних коливань в липні, збалансувався на рівні 40.5 UAH/USD. В світлі стабілізації валютного ринку варто зауважити те, що в серпні в Україну надійшли значні суми фінансової допомоги з блоку західних партнерів. Також, після відновлення повноцінного оподаткування збільшилися надходження до бюджету, що дозволило зменшити темпи фінансування Уряду з боку НБУ новими емісіями гривні.

НПФ "Фрі Флайт" в серпні повністю увібрав негативний ефект відкриття ринку. Зокрема переоцінки активів відбулися в таких класах активів, як єврооблігації. Ми з свого боку окремо окреслювали причини, наслідки та подальше відновлення НПФ "Фрі Флайт" в матеріали, який ви можете знайти за посиланням - <https://www.otpcapital.com.ua/2022/08/10/vidkryttya-fondovogo-rynku-abo-shho-sprychynylo-vid-yemnu-dohidnist-npf-friflajt/>

НПФ "Фрі Флайт" за результатами серпня показав негативну динаміку у 25.4% в доларах.

Контакти

Відкритий пенсійний фонд "ФРІФЛАЙТ"	Консультація: (044) 492 34 69
Свідцтво про реєстрацію фінансової установи: По №90 від 20.07.2007 р., реєстраційний номер: 12102011.	E-mail: pension@otpbank.com.ua
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.	Сайт: www.freeflight.com.ua
ТОВ "Компанія з управління активами "ОТП Капітал"	03150, м. Київ, вул. Фізкультури, 28Д
Ліцензія НКЦПФР АД №075876 від 28.09.2012 (безстрокова) на здійснення діяльності з управління активами інституційних інвесторів (діяльності з управління активами)	Тел./факс: (044) 492 34 69
	E-mail: capital@otpbank.com.ua
	Сайт: www.otpcapital.com.ua
ТОВ "Адміністратор пенсійного фонду "Центр персоналізованого обліку"	04080, м. Київ, вул. Кирилівська, 40
Ліцензія Нацфінпослуг на провадження діяльності з адміністрування недержавних пенсійних фондів АБ № 115988 від 07.02.2008 р. (безстрокова)	Тел./факс: (044) 537 66 57
	E-mail: info@acpo.com.ua
	Сайт: www.acpo.com.ua