

Щомісячний звіт

31 жовтня 2022 року



Відкритий недержавний пенсійний фонд "ФріФлайт"

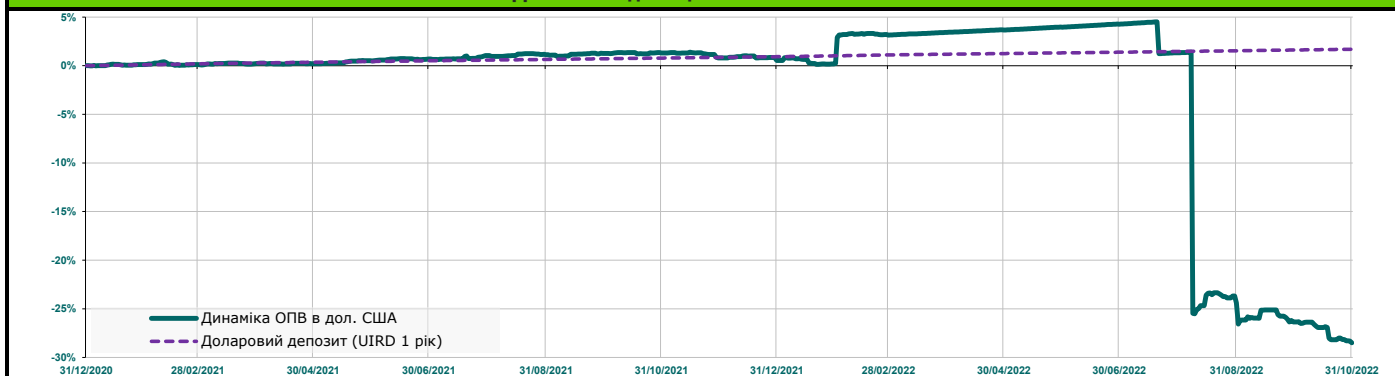
Інформація про фонд

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

			За період		У річних	
Чиста вартість активів	25 656 469 грн.	Валюта	₹	\$	₹	\$
Сума внесків під управлінням за період	639 018 грн.	1 місяць	-2.9%	-2.9%	-29.8%	-29.8%
Сума виплат з активів під управлінням за період	2 015 грн.	3 місяці	-29.4%	-29.4%	-75.2%	-75.2%
Кількість учасників	2 492	6 місяців	-13.8%	-31.0%	-25.7%	-52.4%
Кількість вкладників - фіз. осіб	2 353	1 рік	-2.0%	-29.4%	-2.0%	-29.4%
Кількість вкладників - юр. осіб	8	3 початку року	-4.6%	-28.9%	-5.5%	-33.6%
Чиста вартість одиниці пенсійних внесків	0.85494 грн.	3 початку діяльності	19.6%	-22.1%	4.8%	-6.3%

Динаміка одиниці пенсійних внесків



Портфель фонду

Державні облігації	48.9%							
ОВДП з погашенням в 2023 р.	39.9%							
ОЗДП з погашенням в 2023 р.	9.0%							
Корпоративні облігації	2.6%							
ТОВ "Манівео ШФД"	2.6%							
Депозити та грошові кошти	47.5%							
АТ "Укргазбанк"	8.4%							
АТ "Таскомбанк"	9.5%							
АТ "Кредивест Банк"	11.5%							
АТ "Агропросперіс Банк"	9.7%							
АТ "Кредобанк"	7.2%							
АТ "Піреус Банк"	2.9%							
Інші	1.0%	<table> <tr> <td>\$</td><td>Активи в валюті</td><td>97.2%</td></tr> <tr> <td>€</td><td>Активи в гривні</td><td>2.8%</td></tr> </table>	\$	Активи в валюті	97.2%	€	Активи в гривні	2.8%
\$	Активи в валюті	97.2%						
€	Активи в гривні	2.8%						

Коментар

Юрій Олексієнко,
Керівник департаменту з питань інвестиційної діяльності

otp Capital

На початку жовтня було звільнено голову НБУ Кирила Шевченка, а на його місце призначено Андрія Пишного. Зміна керівника настільки важливого органу завжди супроводжується додатковими ризиками, адже вплив головного фінансового регулятора, як на фінансовий ринок, так і на економіку загалом є дуже значимим. Вже з новим головою, Монетарний комітет НБУ залишив незмінною облікову ставку на рівні 25%, вважаючи даний рівень достатнім для стримування інфляції та забезпечення економічного відновлення в поточних умовах. В свою чергу, інфляція продовжує рухатися вгору. В вересні ріст цін дійшов до позначки в 25%. До кінця року очікується зростання інфляції до 28%-30%, що відповідає рівням прогнозу НБУ та аналітиків ринку. Міністерство фінансів почало більш активніше піднімати відсоткові ставки на первинних аукціонах ОВДП. Зокрема на 1,5 річні ОВДП було запропоновано ставку 18.5%, на річні 16%.

Вторинний ринок ОВДП суттєво знизив активність через наслідки бомбардувань енергетичної інфраструктури України. Однак, варто відзначити, що незначне зростання відсоткових ставок таки відбулося. Наразі ОВДП торгуються в діапазоні 20-22%.

Ринок єврооблігацій негативно відреагував на руйнування енергетичної системи і, як наслідок, значного зменшення економічної активності, що може призвести до негативних макроекономічних наслідків. Саме такі ризики закладалися іноземними інвесторами в ціни ОЗДП: українські єврооблігації втратили біля 20% вартості в жовтні місяці.

Натомість готівковий валютний ринок позитивно для гривні спрацював у жовтні. Причиною є стабілізація надходжень допомоги від західних партнерів та зменшення обсягів «друкування» гривні з боку НБУ. Готівковий курс USD/UAH знизився з 42 до 40.

В жовтні, в портфель фонду було придбано валютних доларових ОВДП на суму 6 млн. грн., що вирішило одну з складних завдань – перекладання гривні в доларові активи. За допомогою складного механізму вдалося вкласти гривневі залишки в доларові ОВДП за курсом 39.5 USD/UAH. В свою чергу в депозитній частині 31 тис. дол. було перерозміщено на депозити в "Укргазбанк".

В структурі портфелю фонду присутні ОЗДП, з часткою 10%, інша частка належить ОВДП номінованих в доларах. Як зазначалося вище, ОЗДП в жовтні піддалися негативним тенденціям через обстріли енергетичної системи України. Ще однією негативним фактором для фонду стало те, що 6 млн. гривневих залишків було розміщено в валютні активи за курсом в 39.5, хоча облік даних активів здійснюється по курсу офіційному, а саме 36.6 USD/UAH. Таким чином, операція конвертації в дол. США сформувала збиток для фонду. Відповідно негативні тенденції на ринку облігацій та технічні збитки між готівковим та офіційним курсом спричинили негайний результат роботи фонду «ОТП Валютний» у жовтні місяці, який знизився на 2.9%.

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