

Щомісячний звіт

30 вересня 2020 року



Відкритий недержавний пенсійний фонд "ФріФлайт"

Інформація про фонд

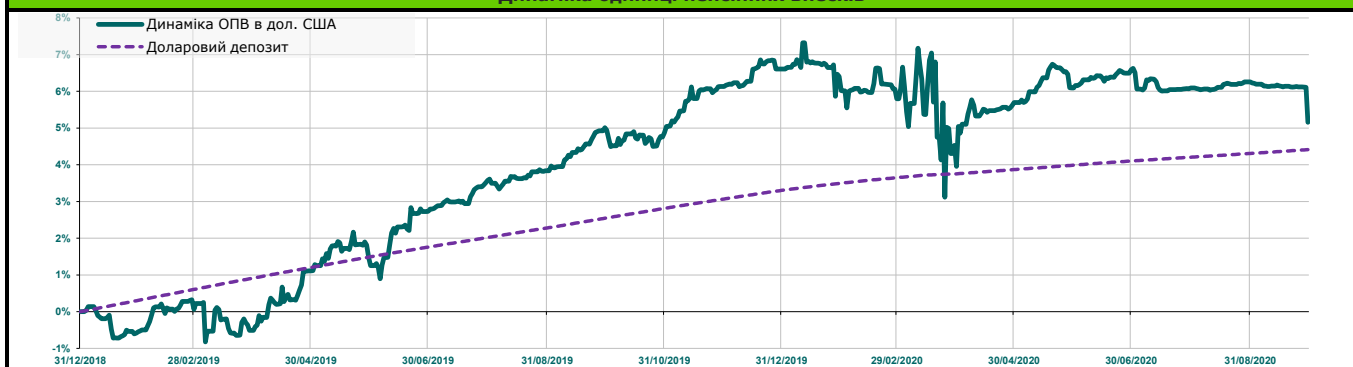
| | | |
|--------------------------------|-------------------------|---|
| Дата створення | Березень 2007 р. | Стратегія фонду спрямована на формування консервативного інвестиційного портфеля з максимальним захистом накопичених коштів в валютних інструментах. Основні складові: банківські депозити та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

Показники діяльності

Дохідність фонду

| | Грн. | Валюта | За період | | У річних | |
|---|----------------|----------------------|-----------|--------|----------|---------|
| | | | € | \$ | € | \$ |
| Чиста вартість активів | 8 638 957 грн. | | | | | |
| Сума внесків під управлінням за період | 638 413 грн. | 1 місяць | 1.93% | -1.04% | 25.77% | -11.74% |
| Сума виплат з активів під управлінням за період | 0 грн. | 3 місяці | 4.60% | -1.34% | 19.69% | -5.26% |
| Кількість учасників | 1 411 | 6 місяців | 1.57% | 1.15% | 3.17% | 2.32% |
| Кількість вкладників - фіз. осіб | 1 285 | 1 рік | 17.67% | 0.14% | 17.67% | 0.14% |
| Кількість вкладників - юр. осіб | 7 | 3 початку року | 17.85% | -1.36% | 24.48% | -1.81% |
| Чиста вартість одиниці пенсійних внесків | 0.89363 грн. | 3 початку діяльності | 25.05% | 5.16% | 13.62% | 2.92% |

Динаміка одиниці пенсійних внесків



Портфель фонду

| Державні облігації (ОВДП) | 49.0% | |
|----------------------------------|--------------|--|
| ОЗДП з погашенням в 2028 р. | 18.4% | |
| ОВДП з погашенням в 2021 р. | 16.8% | |
| ОВДП з погашенням в 2020 р. | 13.9% | |
| Депозити та грошові кошти | 50.5% | |
| ПАТ "Укргазбанк" | 8.4% | |
| ПАТ "Приватбанк" | 8.1% | |
| ПАТ "ПУМБ" | 8.2% | |
| ПАТ "Таскомбанк" | 8.0% | |
| ПАТ "Ідея Банк" | 8.0% | |
| ПАТ "Ощадбанк" | 4.3% | |
| ПАТ "Альфа Банк" | 3.1% | |
| ПАТ "Кредитвест Банк" | 0.9% | |
| ПАТ "УкрСиббанк" | 1.6% | |
| Інші | 0.5% | |

| Валюта | Активи в валюті | 90.4% |
|--------|-----------------|-------|
| € | Активи в гривні | 9.6% |

Коментар

Юрій Олексієнко,
Керівник департаменту з питань інвестиційної діяльності

В вересні фінансові ринки продовжили залишатися в достатньо стабільному стані. На ринку ОВДП незначне зниження продемонстрували ставки по короткостроковим облігаціям (до 1 року) зменшившись в на 0.2 в.п., до 9.6%. Ставки по середньостроковим та довгостроковим ОВДП залишилися практично незмінними у порівнянні з серпнем місяцем. Однак доларові ОВДП показали суттєво вищу волатильність, зокрема короткострокові (до 1 року) збільшилася на 0.2 в.п. до 3.9 %, а середньострокові на 0.3% до 4.41%. Ринок українських єврооблігацій особливо болісно реагує на відхилення антикорупційного курсу України, відтак голосування Верховної Ради скандальної поправки щодо формування комісії відбору кандидатів в антикорупційні органи дуже гостро сприйнялись західними партнерами. Додатковим негативним фактором стало голосування по бюджету з значним дефіцитом, який фактично унеможливило співпрацю з МВФ і іншими партнерами. Такий стан речей спровокував зростання дохідностей українських єврооблігацій. Середні ставки по депозитам теж не змінювались вересні та залишилися в діапазоні близькому до 8.5% по гривні та не більше 1% по долару.

А от валютний сегмент фінансового ринку України проявив себе як найяскравіше. Більш ліберальна політика присутності на ринку НБУ від нового голови, створила ситуацію, при якій регулятор в вересні взагалі не виходив з продажом валюти, а природна сезонна активність імпортерів створила перевагу попиту над пропозицією валюти. Таким чином, протягом всього вересня гривня поступово знижувалася по відношенню до долару, завершивши місяць на позначці 28.3, що є найнижчим значенням за майже 2 роки. Загалом вереснєве зниження гривні склало 3%.

У звітному періоді в портфель фонду "Фрі Флайт" були придбані доларові облігації Міністерства фінансів України на загальну суму 289 тис. грн., а вільні кошти було розміщено на депозит в ПАТ "Ідея Банк" у розмірі 291 тис. грн.

За результатами вересня доларова дохідність НПФ "Фрі Флайт" склала -1.0%. Негативний результат пов'язаний з переоцінкою (збільшенням дохідності) єврооблігацій (займають близько 19% портфелю фонду) з 7.5% до 8.4%, що зменшило вартість позиції в портфелі фонду, але одночасно збільшило її дохідність. Згідно міжнародних стандартів облікової політики, ми змушені враховувати ринкові тенденції та відобразити активи в портфелі за їх ринковою вартістю. Враховуючи дуже низьку дохідність доларових інструментів, частина коштів була розміщена в довгострокові єврооблігації з дохідністю 7.5% у розмірі близько 20% портфелю фонду. Так як пенсійний фонд проводить довгострокове інвестування, поточні коливання не здійснюють на дохідність фонду значного впливу в довгостроковій перспективі. З великою імовірністю, в подальшому доларова дохідність фонду демонструватиме значно кращу динаміку.

Тим не менше, в гривні фонд продовжує демонструвати високу дохідність, зокрема за вересень фонд приніс своїм вкладникам 1.9%, з початку року гривнева дохідність фонду склала 17.6%.

Контакти

| | |
|--|--|
| <p>Відкритий пенсійний фонд "ФРІФЛАЙТ" Свідоцтво 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.</p> | <p>Консультація: (044) 492 34 69 E-mail: pension@otpbank.com.ua Сайт: www.freeflight.com.ua</p> |
| <p>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)</p> | <p>03150, м. Київ, вул. Фізкультури, 28Д Тел./факс: (044) 492 34 69 E-mail: capital@otpbank.com.ua Сайт: www.otpcapital.com.ua</p> |
| <p>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)</p> | <p>04080, м. Київ, вул. Кирилівська, 40 Тел./факс: (044) 537 66 57 E-mail: info@acpo.com.ua Сайт: www.acpo.com.ua</p> |