

Звіт про результати діяльності КНПФ НБУ

Підсумки місяця

У березні 2017 р. інвестиційний дохід КНПФ НБУ (далі - Фонд) склав 16 млн. грн. Незважаючи на прискорення споживчої інфляції у березні у річному вимірі до 15,1% та незмінної облікової ставки в розмірі 14% річних, такий, досить високий інвестиційний дохід, був досягнутий переважно за рахунок зростання цін на облигації внутрішньої державної позики (ОВДП).

Ринок облигацій внутрішньої державної позики (ОВДП)

Близько 42% активів Фонду розміщено у ОВДП з терміном погашення від одного місяця до трьох років. За останній час цей клас активів був найдохіднішим серед активів доступних для пенсійних фондів. Зокрема, у березні середньозважена дохідність портфелю ОВДП Фонду знизилась з 15,8% до 15,1% річних до погашення. Таким чином, цього місяця за рахунок сплачених відсотків та росту цін дохід від ОВДП склав 9,3 млн. грн.

Депозити

Кошти Фонду, що розміщені на депозитних рахунках в комерційних банках, переважно - це долари США, складають приблизно 40% від сукупних активів Фонду. В березні 2017 р. відсотковий дохід від депозитів склав 1,1 млн. грн.

Корпоративні облигації

13% активів Фонду складають корпоративні облигації. Емітенти цих облигацій демонструють позитивну динаміку фінансових показників: операційний прибуток зростає як рік до року, так і місяць до місяця. Це знаходить своє відображення в доході Фонду від таких інвестицій – в березні портфель корпоративних облигацій заробив 5,3 млн. грн. доходу.

Нерухомість

Дещо зріс дохід Фонду від здавання в оренду нерухомості, цього місяця він склав 0,33 млн. грн.

Головні показники діяльності

Стаття доходів	Березень	Наростаючим підсумком
Облигації внутрішньої державної позики	9 319	20 439
Зміна справедливої вартості депозитів за рахунок курсової різниці	(1 099)	(3 075)
Зміна справедливої вартості депозитів за рахунок нарахованих доходів	2 255	6 671
Корпоративні облигації	5 310	8 344
Відсотковий дохід від реструктуризації	-	5 090
Дохід від оренди нерухомості	329	894

Вид активу	Валюта	Вартість активу	Питома вага у портфелі
Поточний рахунок НБУ	UAH	186	0,0%
Депозити в державних банках та банках, що контролюються державою	UAH USD	4 146 385 755	0,4% 36,0%
Депозити в інших банках з іноземним капіталом	UAH	20 954	2,0%
Депозити в комерційних банках	UAH	12 408	1,2%
Всього грошові кошти		423 449	39,5%
Облигації внутрішньої державної позики	UAH	447 215	41,7%
Облигації корпоративні українських емітентів	UAH	143 603	13,4%
Всього облигації		590 819	55,1%
Всього акції		4 472	0,4%
Всього нерухомість		44 090	4,1%
Всього дебіторська заборгованість		39	0,0%
Всього інші активи		10 060	0,9%
Всього активи		1 072 928	100%



*Примітки:

• **чиста вартість активів пенсійного фонду** - різниця між вартістю активів пенсійного фонду на день проведення підрахунку та сумою зобов'язань пенсійного фонду, що підлягають виконанню на день проведення підрахунку.

* **чиста вартість одиниць пенсійних активів** – розрахункова вартість одиниці пенсійних активів, що визначається шляхом ділення чистої вартості активів на загальну кількість одиниць пенсійних активів на день підрахунку.