

Звіт про результати діяльності КНПФ НБУ

Підсумки місяця

У липні 2017 року інвестиційний дохід КНПФ НБУ (далі - Фонд) склав 12,3 млн. гривень, що більше за середньомісячне значення цього показника у 2017 році. Цей місяць був рекордним за обсягом отриманих купонних платежів за облігаціями внутрішньої державної позики (ОВДП), то ж найбільша частина доходу отримана завдяки ОВДП.

Ринок облігацій внутрішньої державної позики (ОВДП)

Останні місяці ціни ОВДП залишаються сталими: ціна трирічних ОВДП становить близько 15% річних до погашення. Дохід від ОВДП був сформований за рахунок відсоткових платежів та накопиченого купонного доходу і склав у липні 6 млн. гривень.

Депозити

Протягом липня були частково погашені зобов'язання банків, що знаходяться у стадії ліквідації: ПАТ «Імексбанк» та ПАТ «Єврогазбанк». Разом із процентними доходами загальний результат від операцій з депозитними рахунками становив 2,6 млн. гривень.

Корпоративні облігації

Накопичений купонний дохід облігацій підприємств, що знаходяться в активах Фонду, додали на пенсійні рахунки учасників Фонду майже 3,4 млн. гривень.

Нерухомість

Доходи від здавання в оренду нерухомості становили 270 тис. гривень.

Головні показники діяльності



| Стаття доходів | Липень | Наростаючим підсумком |
|--|---------|-----------------------|
| ОВДП | 5 990 | 44 278 |
| Корпоративні облігації | 3 431 | 25 728 |
| Зміна справедливої вартості депозитів за рахунок курсової різниці | (2 617) | (18 181) |
| Зміна справедливої вартості депозитів за рахунок нарахованих доходів | 2 325 | 16 046 |
| Дохід від відшкодованих активів (реалізація застави по депозиту) | 3 006 | 7 390 |
| Дохід від оренди нерухомості | 265 | 2 051 |

| Вид активу | Валюта | Вартість активу | Питома вага у портфелі |
|--|--------|------------------|------------------------|
| Поточний рахунок НБУ | UAH | 57 | 0,0% |
| Депозити в державних банках та банках, що контролюються державою | UAH | 10 687 | 1,0% |
| Депозити в інших банках з іноземним капіталом | USD | 370 590 | 34,0% |
| Депозити в комерційних банках | UAH | 9 295 | 0,9% |
| Всього грошові кошти | | 411 272 | 37,7% |
| Облігації внутрішньої державної позики | UAH | 483 498 | 44,3% |
| Облігації корпоративні українських емітентів | UAH | 143 535 | 13,2% |
| Всього облігації | | 627 033 | 57,5% |
| Всього акції | | 4 472 | 0,4% |
| Всього нерухомість | | 37 545 | 3,4% |
| Всього дебіторська заборгованість | | 47 | 0,0% |
| Всього інші активи | | 9 965 | 0,9% |
| Всього активи | | 1 090 334 | 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 одиниць пенсійних активів, що визначається шляхом ділення чистої вартості активів на загальну кількість одиниць пенсійних активів на день підрахунку.