

# Звіт про результати діяльності КНПФ НБУ

## Підсумки місяця

У лютому 2017 року інвестиційний дохід КНПФ НБУ (далі - Фонд) склав 12,9 млн. грн. Цього місяця дохід був більшим ніж у попередньому місяці за рахунок погашення частини боргу у розмірі 5,1 млн. грн. емітентом корпоративних облігацій (ТОВ «Аксіома»), що знаходяться у портфелі Фонду.

### Ринок облігацій внутрішньої державної позики (ОВДП)

Протягом лютого відбулось поступове здорожчання ОВДП, так середня дохідність перетнула позначку у 16% річних до погашення і сягнула 15,8% річних. Враховуючи цей тренд, ми плануємо збільшувати питому вагу ОВДП у пенсійних активах Фонду. Цього місяця дохід від ОВДП склав 5,2 млн. грн.

### Депозити

Більша частина банківських вкладів Фонду розміщена у доларах США, тому вартість активів Фонду є чутливою до обмінного курсу гривня/долар США. У лютому курс долара США до гривні незначно знизився. Враховуючи наявні ризики та певну невизначеність, пов'язану з прогнозуванням надходжень від експорту, ми залишаємо розмір валютної позиції незмінним. Банківські вклади у лютому 2017 року принесли дохід у розмірі 1,1 млн. грн.

### Корпоративні облігації

В результаті тривалої роботи з корпоративними емітентами нам вдалося досягти плану реструктуризації заборгованості. Складено чіткий графік погашення боргу. Згідно з цим графіком у лютому отримано платежів на суму 5,1 млн. грн. Всього портфель корпоративних облігацій заробив у лютому 6,5 млн. грн. доходу.

### Нерухомість

Незначним, але сталим є дохід від здавання в оренду нерухомості, цього місяця він склав 0,3 млн. грн.

## Головні показники діяльності

Стаття доходів	Лютий	Наростаючим підсумком
ОВДП	5 228	11 119
Зміна справедливої вартості депозитів за рахунок курсової різниці	(937)	(1 977)
Зміна справедливої вартості депозитів за рахунок нарахованих доходів	2 082	4 416
Корпоративні облігації	1 440	3 034
Відсотковий дохід від реструктуризації	5 090	5 090
Дохід від оренди нерухомості	274	566

Вид активу	Валюта	Вартість активу	Питома вага у портфелі
Поточний рахунок НБУ	UAH	60	0,0%
Депозити в державних банках та банках, що контролюються державою	UAH USD	10 009 386 689	0,9% 36,6%
Депозити в інших банках з іноземним капіталом	UAH	21 001	2,0%
Депозити в комерційних банках	UAH	12 408	1,2%
<b>Всього грошові кошти</b>		<b>430 166</b>	<b>40,7%</b>
Облігації внутрішньої державної позики	UAH	428 711	40,6%
Облігації корпоративні українських емітентів	UAH	138 293	13,1%
<b>Всього облігації</b>		<b>567 004</b>	<b>53,7%</b>
<b>Всього акції</b>		<b>4 472</b>	<b>0,4%</b>
<b>Всього нерухомість</b>		<b>44 090</b>	<b>4,2%</b>
<b>Всього дебіторська заборгованість</b>		<b>30</b>	<b>0,0%</b>
<b>Всього інші активи</b>		<b>10 060</b>	<b>1,0%</b>
<b>Всього активи</b>		<b>1 055 821</b>	<b>100%</b>



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