

Звіт про результати діяльності КНПФ НБУ

Підсумки місяця

У квітні 2020 року фінансовий результат КНПФ НБУ (далі - Фонд) склав 59,5 млн грн. Такого показнику було досягнуто завдяки зростанню справедливої вартості портфелю облігацій внутрішньої державної позики.

Облігації внутрішньої державної позики (ОВДП)

Після різкого падіння в березні, у квітні ціни на ОВДП почали зростати, передусім через поступове збільшення попиту на вторинному ринку. Протягом звітнього місяця позитивна переоцінка портфелю ОВДП Фонду склала 43,5 млн грн, при відсотковому доході в розмірі 8,4 млн грн. Протягом року ми очікуємо подальше відновлення вартості портфелю ОВДП.

Депозити

Доходи від операцій з банківськими вкладками у квітні склали 6,6 млн грн. Ця частина доходів є найбільш сталою, депозити розміщено в державних банках та банках з іноземним капіталом. При цьому майже половина депозитів є відкличними, що дозволяє підтримувати ліквідність активів Фонду на високому рівні.

Корпоративні облігації

У квітні портфель корпоративних облігацій заробив 643 тис. грн відсоткового доходу.

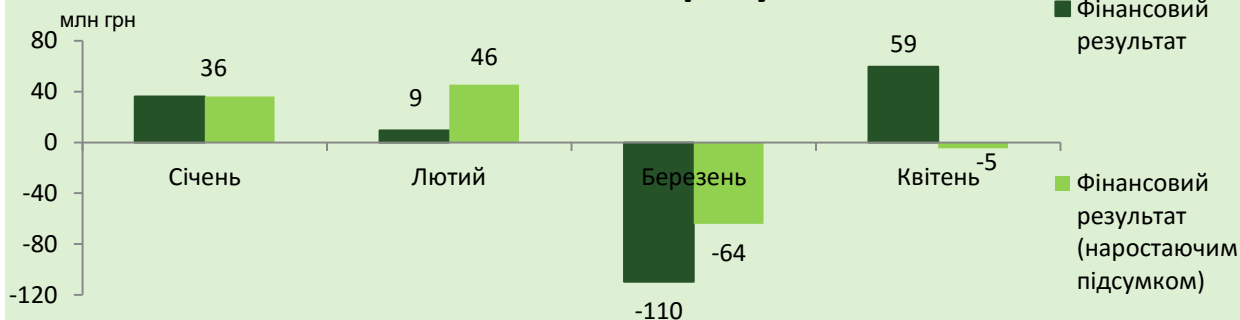
Нерухомість

Дохід Фонду від здавання в оренду нерухомості з урахуванням майнових податків цього місяця склав 94 тис. грн.

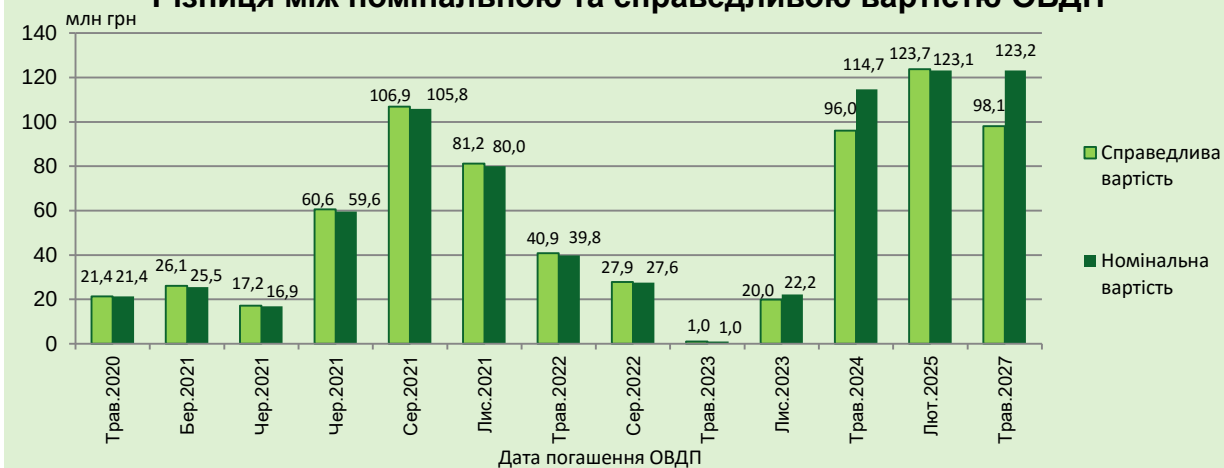
Стаття доходів/витрат	Квітень	Наростаючим підсумком
Зміна справедливої вартості депозитів за рахунок переоцінки	-	615
Зміна справедливої вартості депозитів за рахунок використання методу ДГП	(961)	5 116
Зміна справедливої вартості депозитів за рахунок курсової різниці	-	4 180
Зміна справедливої вартості депозитів за рахунок нарахованих доходів	7 555	29 770
Депозити	6 595	39 682
Зміна справедливої вартості ОВДП за рахунок курсової різниці	-	3 400
Зміна справедливої вартості ОВДП за рахунок переоцінки	43 544	(75 496)
Зміна справедливої вартості ОВДП за рахунок нарахованих доходів	8 401	27 784
Фінансовий результат від продажу ОВДП	-	(419)
ОВДП	51 945	(44 730)
Зміна справедливої вартості корпоративних облігацій за рахунок нарахованих доходів	643	3 190
Амортизація премії/дисконту при погашенні корпоративних облігацій	-	(2 983)
Зміна справедливої вартості корпоративних облігацій за рахунок переоцінки	-	110
Корпоративні облігації	643	317
Доходи від оренди нерухомості	99	398
Майнові податки	(5)	(68)
Нерухомість	94	330
Дивіденди	244	244
Доходи від переоцінки дебіторської заборгованості	-	(0)
Інші активи	244	244
Інвестиційний дохід	59 521	(4 157)
Послуги з обслуговування активів	-	-
Аудиторські послуги	(35)	(469)
Послуги оцінювача	-	-
Юридичні послуги	-	40
Адміністративні витрати	(35)	(429)
Уцінка/дооцінка дебіторської заборгованості	-	-
Інші доходи/витрати	-	-
Прибуток (збиток)	59 485	(4 586)

Звіт про результати діяльності КНПФ НБУ

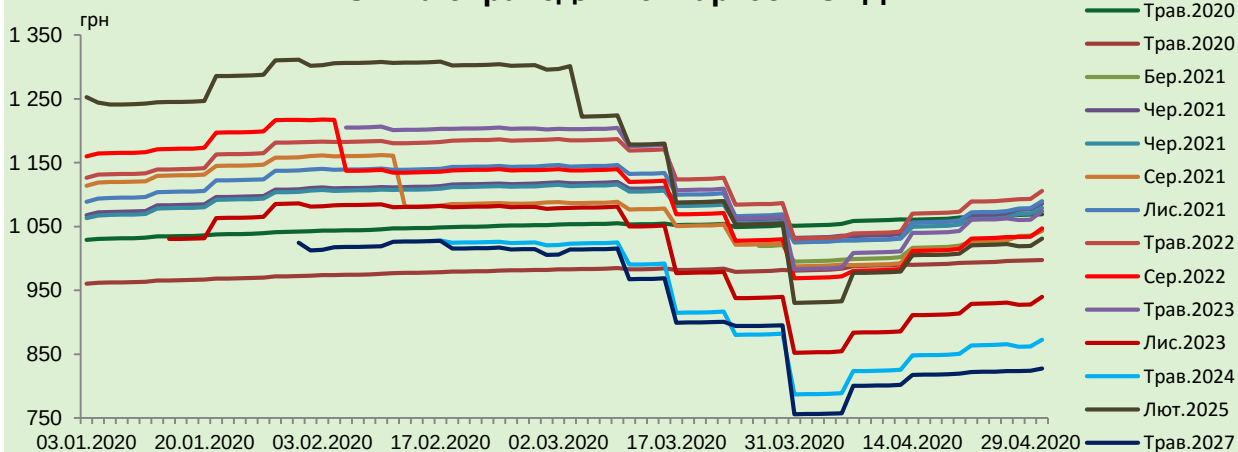
Фінансовий результат



Різниця між номінальною та справедливою вартістю ОВДП

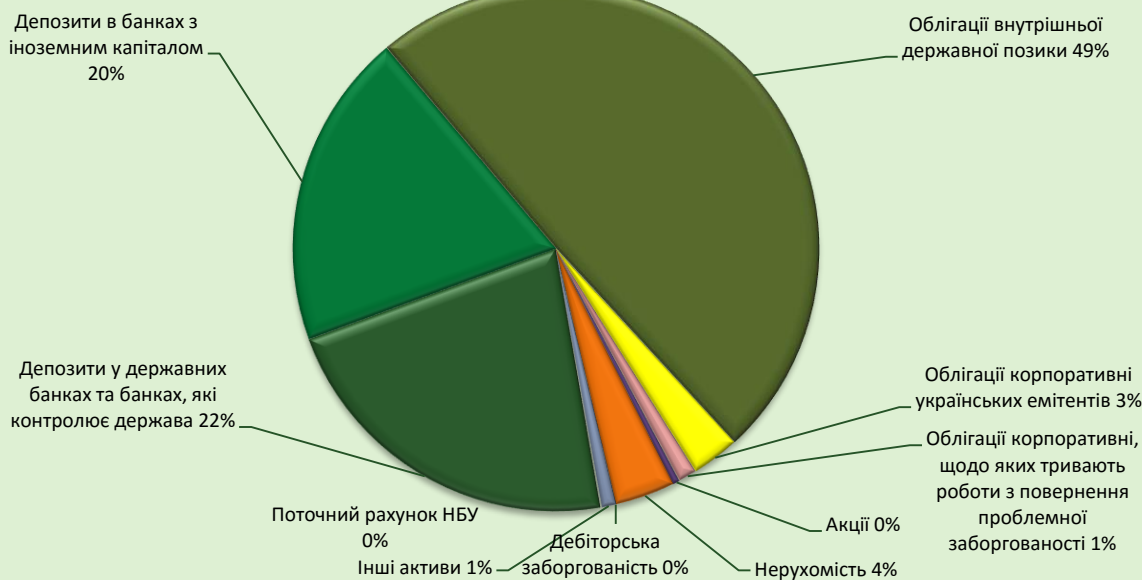


Зміна справедливої вартості ОВДП



Звіт про результати діяльності КНПФ НБУ

Структура активів



Вид активу	Валюта	Номинальна вартість активів	Вартість активів	Питома вага у портфелі
Поточний рахунок НБУ	UAH	856	856	0,1%
Депозити у державних банках та банках, які контролює держава	UAH	321 084	323 129	22,1%
Депозити у банках з іноземним капіталом	UAH	274 049	284 776	19,5%
Всього грошові кошти		595 988	608 760	41,6%*
Облігації внутрішньої державної позики	UAH	760 857	720 788	49,3%**
Облігації корпоративні українських емітентів	UAH	42 771	42 771	2,9%
Облігації корпоративні українських емітентів, щодо яких тривають роботи з повернення проблемної заборгованості	UAH	16 180	16 180	1,1%
Всього облігації		819 808	779 739	53,3%
Всього акції		6 475	6 475	0,4%
Всього нерухомість		54 014	54 014	3,7%
Всього дебіторська заборгованість		114	114	0,0%
Всього інші активи		12 828	12 828	0,9%
Всього активи		1 489 227	1 461 929	100%

*Примітки:

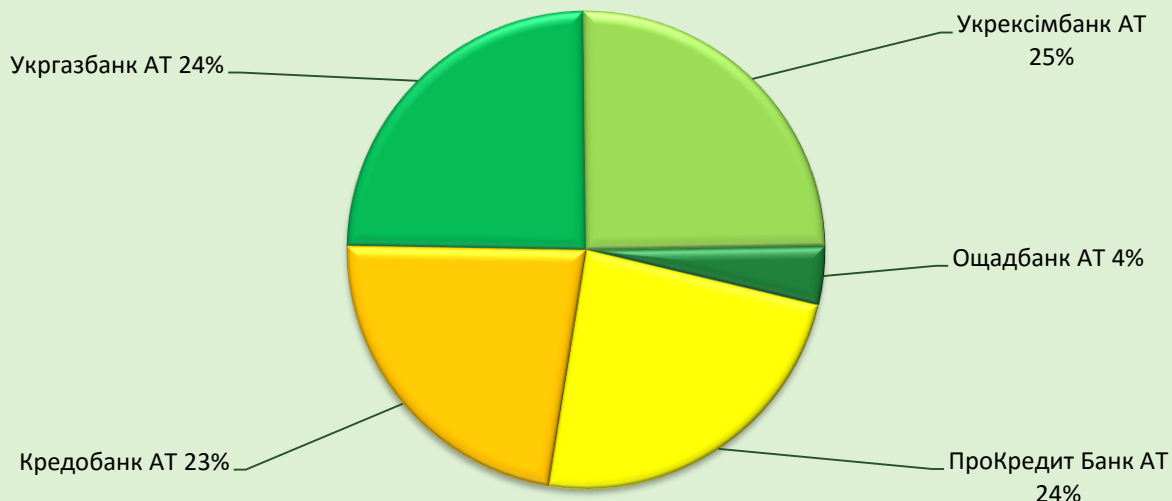
*згідно п.п.4 п.1 ст.49 ЗУ «Про недержавне пенсійне забезпечення» заборонено розміщувати на банківських депозитних рахунках у грошових коштах та в ощадних сертифікатах банків більш як 50% загальної вартості пенсійних активів

** згідно п.п.6 п.1 ст.49 ЗУ «Про недержавне пенсійне забезпечення» заборонено придбавати або додатково інвестувати в цінні папери, доходи за якими гарантовано Кабінетом Міністрів України, більш як 50% загальної вартості пенсійних активів

Джерело: Департамент з управління діяльністю КНПФ НБУ. Дані у тис. грн, станом на 30.04.2020.

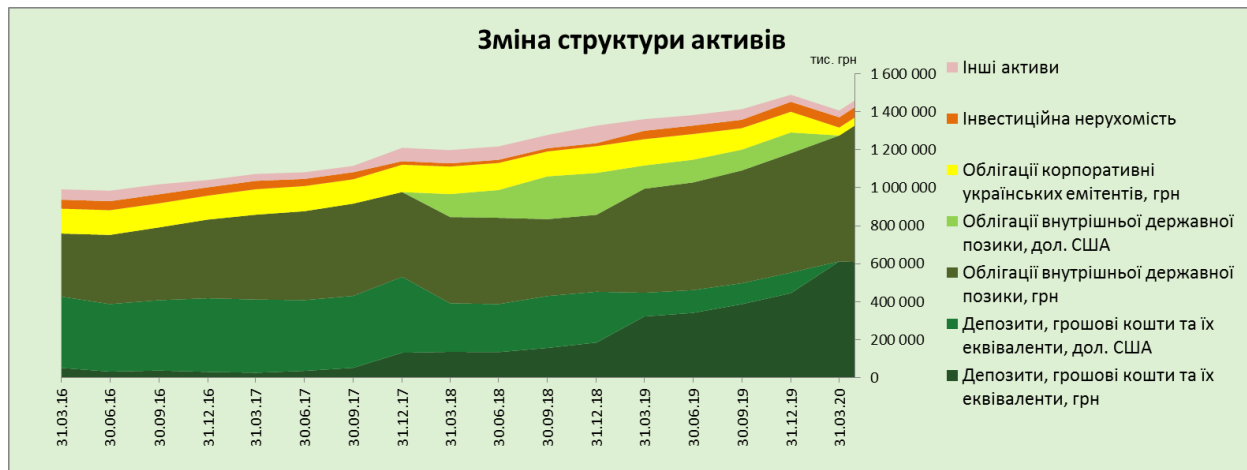
Звіт про результати діяльності КНПФ НБУ

Структура портфелю депозитів



Назва банку	Розмір активів банку станом на 31.12.2019, млн грн	Місце за розміром активів	Належність до переліку системно важливих банків	Частка державної власності	Найменування материнської групи	Рейтинг материнської групи	Розмір активів материнської групи станом на 31.12.2019, млн євро	Географічна належність материнської групи
Ощадбанк АТ	314 296	2	+	100%	-	-	-	-
Укресімбанк АТ	202 922	3	+	100%	-	-	-	-
Укргазбанк АТ	127 564	4	+	94,9%	-	-	-	-
ПроКредит Банк АТ	24 322	15	-	13,2%	ProCredit Holding AG&Co. KGaA	BBB (Fitch)	6 698	Німеччина
Кредобанк АТ	19 868	18	+	31,4%	Powszechna Kasa Oszczednosci Bank Polski Spolka Akcyjna	A2 (Moody's)	81 463	Польща

Звіт про результати діяльності КНПФ НБУ



Звіт про результати діяльності КНПФ НБУ



*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.

Джерело: Департамент з управління діяльністю КНПФ НБУ, НБУ. Дані станом на 30.04.2020.