

Звіт про результати діяльності КНПФ НБУ

Підсумки місяця

У листопаді 2020 року фінансовий результат КНПФ НБУ склав 2,9 млн грн. Головним чинником зменшення дохідності став вплив переоцінки за справедливою вартістю портфелю облігацій внутрішньої державної позики (далі – ОВДП).

Облігації внутрішньої державної позики (ОВДП)

На тлі слабкого попиту, ціни на ОВДП у звітному місяці продовжили зниження. Внаслідок цього загальний результат від операцій з ОВДП, а саме нараховані та отримані відсотки, скориговані на переоцінку за справедливою вартістю склав -6,6 млн грн.

Нагадаємо, що портфель ОВДП Фонду сформовано переважно з короткострокових облігацій і він утримується до погашення, тому загальний дохід від ОВДП протягом терміну їхнього обігу залишається незмінним. В залежності від коливання цін змінюється лише його помісячний розподіл.

Депозити

Загальний дохід від операцій з банківськими вкладками у листопаді склав 9,1 млн грн. При цьому відсоткові доходи становили 7,9 млн грн, а переоцінка за справедливою вартістю 1,2 млн грн.

Корпоративні облігації

У звітному місяці портфель корпоративних облігацій заробив 644 тис. грн відсоткового доходу.

Нерухомість

Фінансовий результат від здавання в оренду нерухомості, з урахуванням сплачених податків, становив у листопаді 76 тис. грн.

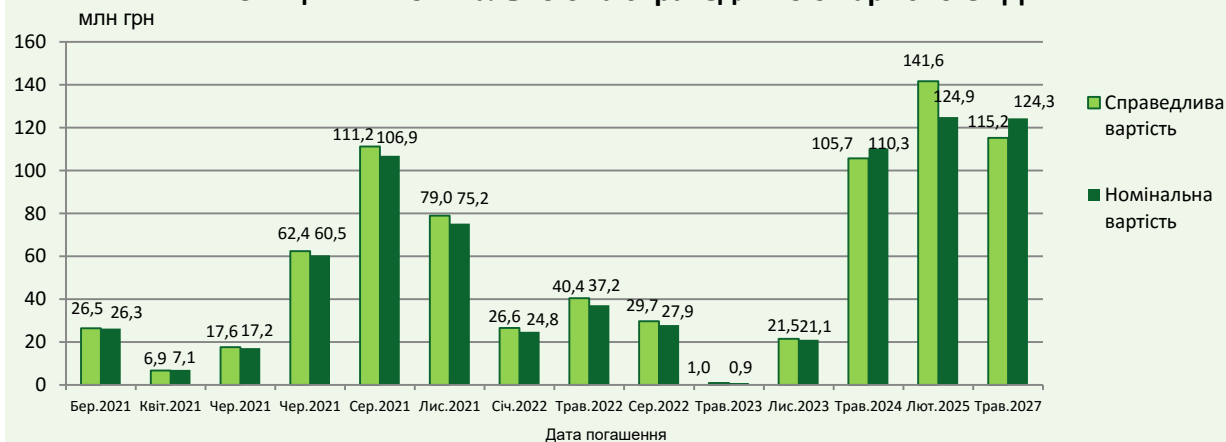
Стаття доходів/витрат	Листопад	Наростаючим підсумком
Зміна справедливої вартості депозитів за рахунок переоцінки	-	615
Зміна справедливої вартості депозитів за рахунок використання методу ДГП	1 258	2 579
Зміна справедливої вартості депозитів за рахунок курсової різниці	-	4 180
Зміна справедливої вартості депозитів за рахунок нарахованих доходів	7 871	85 577
Депозити	9 129	92 952
Зміна справедливої вартості ОВДП за рахунок курсової різниці	-	3 400
Зміна справедливої вартості ОВДП за рахунок переоцінки	(15 193)	(15 630)
Зміна справедливої вартості ОВДП за рахунок нарахованих доходів	8 600	88 856
Фінансовий результат від продажу ОВДП	-	(419)
ОВДП	(6 593)	76 207
Зміна справедливої вартості корпоративних облігацій за рахунок нарахованих доходів	644	7 781
Амортизація премії/дисконту при погашенні корпоративних облігацій	-	(2 816)
Зміна справедливої вартості корпоративних облігацій за рахунок переоцінки	-	(220)
Корпоративні облігації	644	4 745
Доходи від оренди нерухомості	106	1 120
Фінансовий результат від продажу нерухомості	-	(1 676)
Майнові податки	(31)	(270)
Нерухомість	76	(826)
Дивіденди	-	405
Інші активи	-	405
Інвестиційний дохід	3 256	173 483
Послуги з обслуговування активів	-	-
Аудиторські послуги	(123)	(591)
Послуги оцінювача	(212)	(241)
Юридичні послуги	-	(240)
Адміністративні витрати	(335)	(1 072)
Фінансовий результат від продажу обладнання	-	(9 413)
Доходи від переоцінки дебіторської заборгованості	-	4
Інші доходи/витрати	-	(9 409)
Прибуток (збиток)	2 921	163 002

Звіт про результати діяльності КНПФ НБУ

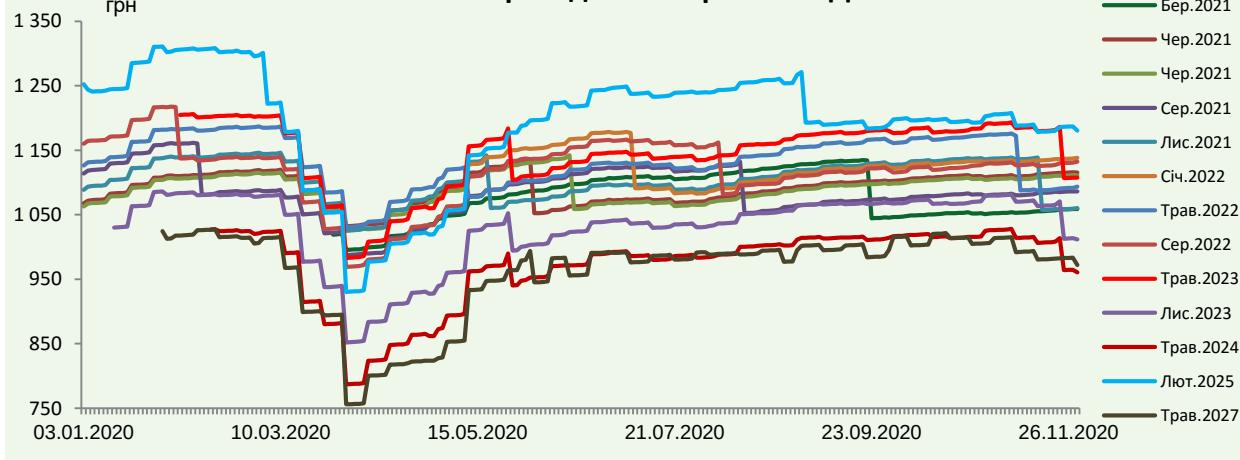
Фінансовий результат (наростаючим підсумком)



Різниця між номінальною та справедливою вартістю ОВДП

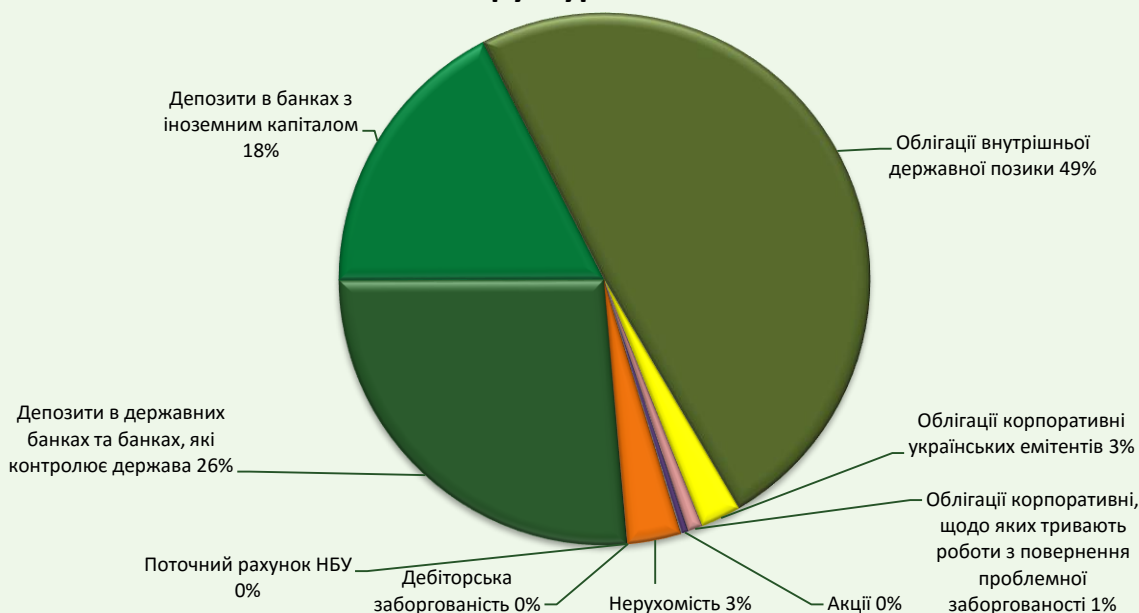


Зміна справедливої вартості ОВДП



Звіт про результати діяльності КНПФ НБУ

Структура активів



Вид активу	Валюта	Номинальна вартість активів	Вартість активів	Питома вага у портфелі
Поточний рахунок НБУ	UAH	342	342	0,0%
Депозити в державних банках та банках, які контролює держава	UAH	416 113	420 985	26,3%
Депозити в банках з іноземним капіталом	UAH	275 025	280 387	17,5%
Всього грошові кошти		691 479	701 713	43,9%
Облігації внутрішньої державної позики	UAH	764 461	785 166	49,1%
Облігації корпоративні українських емітентів	UAH	39 522	39 522	2,5%
Облігації корпоративні українських емітентів, щодо яких тривають роботи з повернення проблемної заборгованості	UAH	14 420	14 420	0,9%
Всього облігації		818 403	839 108	52,4%
Всього акції		6 475	6 475	0,4%
Всього нерухомість		52 464	52 464	3,3%
Всього дебіторська заборгованість		359	359	0,0%
Всього активи		1 569 180	1 600 119	100%

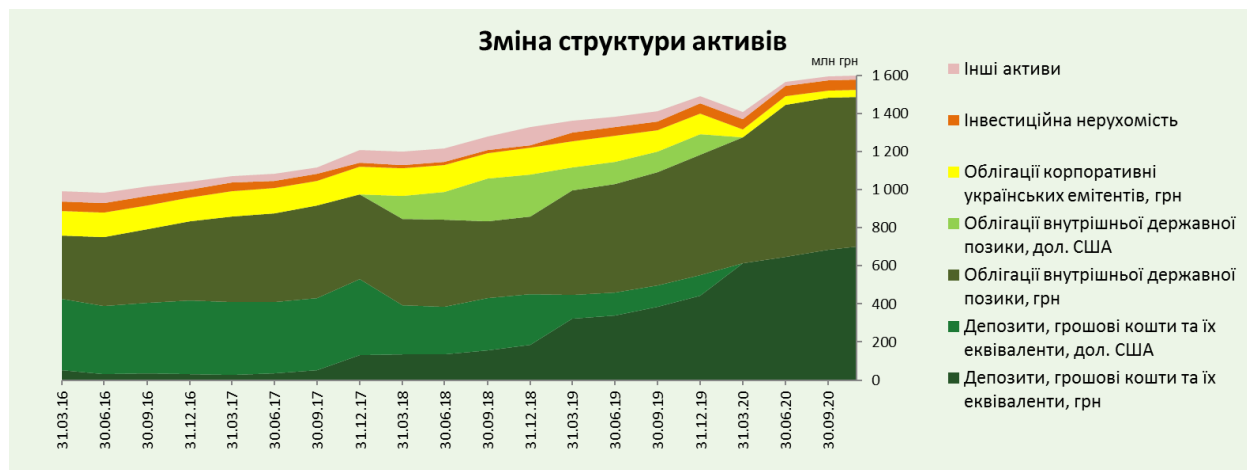
*Примітки:

*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

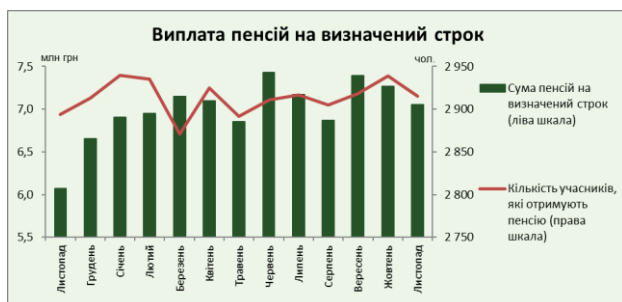
** згідно п.п.6 п.1 ст.49 ЗУ «Про недержавне пенсійне забезпечення» заборонено придбавати або додатково інвестувати в цінні папери, доходи за якими гарантовано Кабінетом Міністрів України, більш як 50% загальної вартості пенсійних активів

Джерело: Департамент з управління діяльністю КНПФ НБУ. Дані у тис. грн, станом на 30.11.2020.

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 одиниці пенсійних активів – розрахункова вартість одиниці 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 30.11.2020.