

Звіт про результати діяльності КНПФ НБУ

Підсумки місяця

Інвестиційний прибуток КНПФ НБУ (далі - Фонд) у грудні 2018 року склав 39,4 млн грн. Суттєву частину прибутку сформував фінансовий результат щорічної незалежної оцінки справедливої вартості нецільових активів Фонду.

Облігації внутрішньої державної позики (ОВДП)

Протягом грудня 2018 року ціни на ОВДП залишалися сталими. Дохід від інвестицій в ОВДП цього місяця склав 133 тис грн, переважно через зниження вартості ОВДП, номінованих у доларах США, внаслідок зміцнення протягом місяця курсу гривні до долара США.

Депозити

Дохід від банківських вкладів у грудні був від'ємним (-23,7 млн грн) і складався з трьох частин. Першу і найбільшу частину (-20,3 млн грн) було сформовано після врахування результату оцінки: оцінювач визнав знецінення частини депозитів у банках, що ліквідуються, внаслідок зниження вартості забезпечення. Другу частину (-5,6 млн грн) сформував від'ємний результат переоцінки вкладів у доларах США. Третю частину (3,4 млн грн) склав відсотковий дохід.

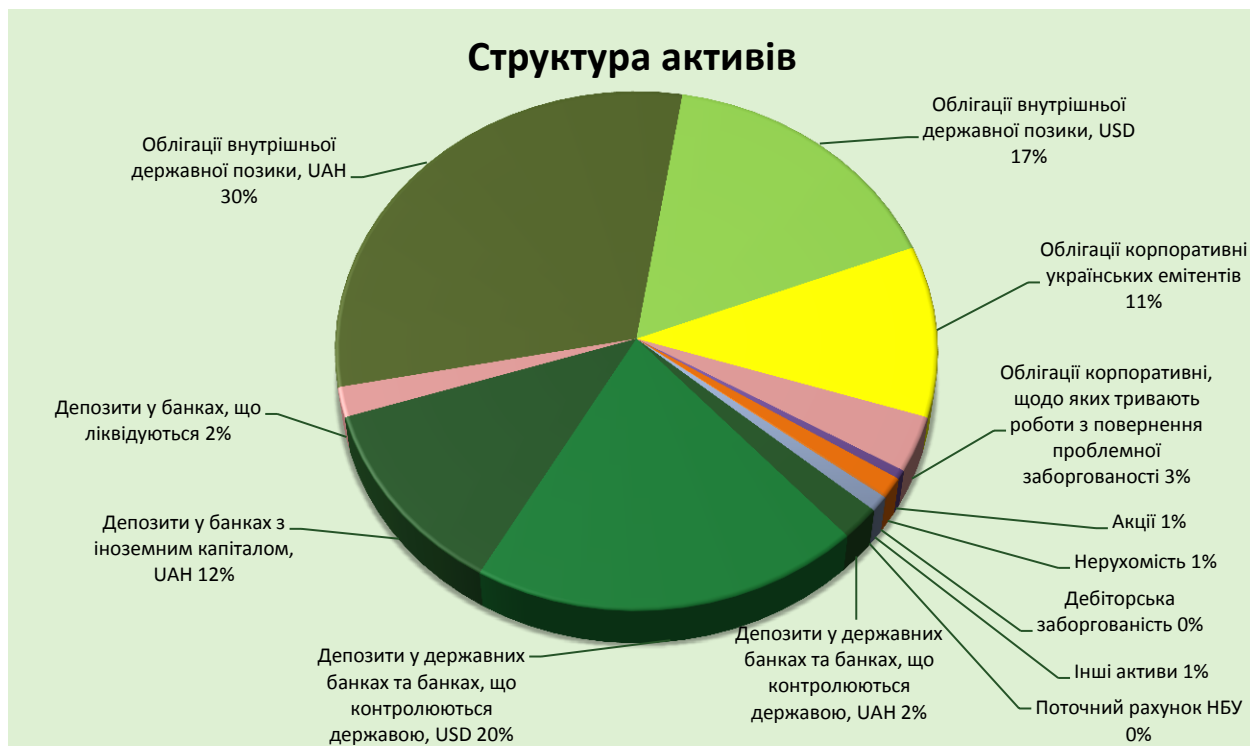
Корпоративні облігації

Емітенти корпоративних облігацій, що входять до активів Фонду, у 2018 році демонстрували позитивні фінансові показники. Враховуючи це, а також часткове відновлення вартості забезпечення за дефолтними облігаціями, оцінювач підвищив справедливу вартість портфелю облігацій на 51 млн грн. Також протягом місяця отримано купонних доходів на суму 2,9 млн грн. Таким чином, всього у грудні 2018 року фінансовий результат за портфелем корпоративних облігацій становив 54,1 млн грн.

Стаття доходів/витрат	Грудень	Наростаючим підсумком
<i>Зміна справедливої вартості депозитів за рахунок переоцінки</i>	(20 310)	(20 310)
<i>Зміна справедливої вартості депозитів за рахунок курсової різниці</i>	(6 785)	(866)
<i>Зміна справедливої вартості депозитів за рахунок нарахованих доходів</i>	3 421	32 941
Депозити	(23 674)	11 765
<i>Зміна справедливої вартості ОВДП за рахунок курсової різниці</i>	(5 579)	(489)
<i>Зміна справедливої вартості ОВДП за рахунок переоцінки</i>	243	(10 057)
<i>Зміна справедливої вартості ОВДП за рахунок нарахованих доходів</i>	5 469	66 791
<i>Зміна справедливої вартості ОВДП за рахунок продажу</i>	-	(0)
ОВДП	133	56 245
<i>Зміна справедливої вартості корпоративних облігацій за рахунок нарахованих доходів</i>	2 605	35 020
<i>Зміна справедливої вартості корпоративних облігацій за рахунок погашення/продажу</i>	308	1 409
<i>Зміна справедливої вартості корпоративних облігацій за рахунок переоцінки</i>	51 193	51 193
Корпоративні облігації	54 107	87 622
<i>Доходи від оренди нерухомості</i>	92	1 176
<i>Доходи від продажу нерухомості</i>	(308)	(1 893)
<i>Майнові податки</i>	(9)	(146)
<i>Зміна справедливої вартості нерухомості за рахунок переоцінки</i>	3 225	3 225
Нерухомість	3 000	2 363
<i>Дивіденди</i>	-	609
<i>Доходи від продажу обладнання</i>	-	147
<i>Доходи від переоцінки обладнання</i>	2 383	2 383
<i>Доходи від переоцінки акцій</i>	2 692	2 692
<i>Доходи від переоцінки дебіторської заборгованості</i>	934	934
Інші активи	6 009	6 765
Інвестиційний дохід	39 574	164 759
<i>Послуги з обслуговування активів</i>	-	(1 015)
<i>Аудиторські послуги</i>	(162)	(620)
<i>Послуги оцінювача</i>	7	(953)
<i>Юридичні послуги</i>	26	(638)
Адміністративні витрати	(129)	(3 226)
Інші доходи/витрати	-	6
Прибуток (збиток)	39 445	161 539

Звіт про результати діяльності КНПФ НБУ

Головні показники діяльності



Вид активу	Валюта	Вартість активів	Питома вага у портфелі
Поточний рахунок НБУ	UAH	15	0,0%
Депозити у державних банках та банках, що контролюються державою	UAH	27 119	2,0%
Депозити у банках з іноземним капіталом	UAH	157 274	11,8%
Депозити у банках, що ліквідуються	UAH	24 600	1,9%
Всього грошові кошти		476 820	35,9%
Облігації внутрішньої державної позики	UAH	405 415	30,5%
Облігації корпоративні українських емітентів	UAH	141 547	10,7%
Облігації корпоративні українських емітентів, щодо яких тривають роботи з повернення проблемної заборгованості	UAH	45 740	3,4%
Всього облігації		813 197	61,3%
Всього акції		7 365	0,6%
Всього нерухомість		15 583	1,2%
Всього дебіторська заборгованість		1 778	0,1%
Всього інші активи		12 804	1,0%
Всього активи		1 327 547	100%

Звіт про результати діяльності КНПФ НБУ

Головні показники діяльності



*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.

Звіт про результати діяльності КНПФ НБУ

Головні показники діяльності

