

Звіт про результати діяльності КНПФ НБУ

Підсумки місяця

У липні 2022 року фінансовий результат КНПФ НБУ склав 16,9 млн грн. Його головними складовими стали, приблизно в однакових долях, відсоткові доходи портфелю облігацій внутрішньої державної позики (далі – ОВДП) та відсоткові доходи за банківськими вкладками. Див. також нижче коментар щодо впровадження воєнного стану в Україні.

Облігації внутрішньої державної позики (ОВДП)

Протягом липня Міністерство фінансів України збільшило ставки дохідності за середньостроковими ОВДП (до 16% за 14-місячними цінними паперами), натомість відсоткові ставки за тримісячними облігаціями залишалися сталими й склали 9,5% річних. Зважаючи на поступове зменшення дюрації портфелю ОВДП, який належить КНПФ НБУ, таке зростання ставок не мало суттєвого впливу на переоцінку за ринковими цінами: остання була відносно незначною, склавши в липні 0,1 млн грн. Відсоткові доходи за ОВДП становили 7,9 млн грн, а загальний результат від операцій з цими цінними паперами у звітному місяці склав 8 млн грн.

Депозити

У звітному місяці тривало поступове підвищення ставок за банківськими вкладками. Завдяки цьому зросли й відсоткові доходи портфелю депозитів КНПФ НБУ, склавши в липні 7,9 млн грн.

Акції

У липні було отримано дивіденди за акціями корпоративного емітента в розмірі 871 тис. грн.

Нерухомість

Фінансовий результат від здавання в оренду інвестиційної нерухомості, з урахуванням сплачених податків, становив у липні 86 тис. грн.

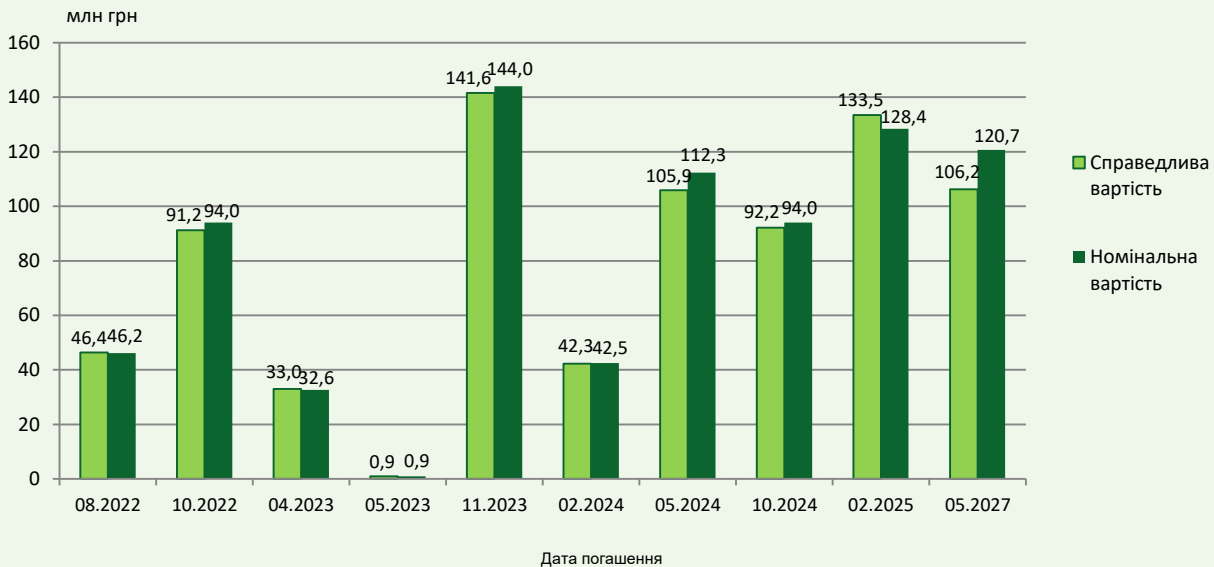
Коментар щодо впровадження воєнного стану в Україні

Повідомляємо, що з огляду на впровадження воєнного стану в Україні, при інвестуванні пенсійних активів Фонду перевага надається розміщенню коштів на короткострокові депозитні вклади, а також інвестуванню в ОВДП, операції з якими дозволені на період дії воєнного стану Національною комісією з цінних паперів та фондового ринку, із дотриманням законодавчих обмежень щодо складу та структури активів, а також лімітів фінансових ризиків Системи управління ризиками КНПФ НБУ.

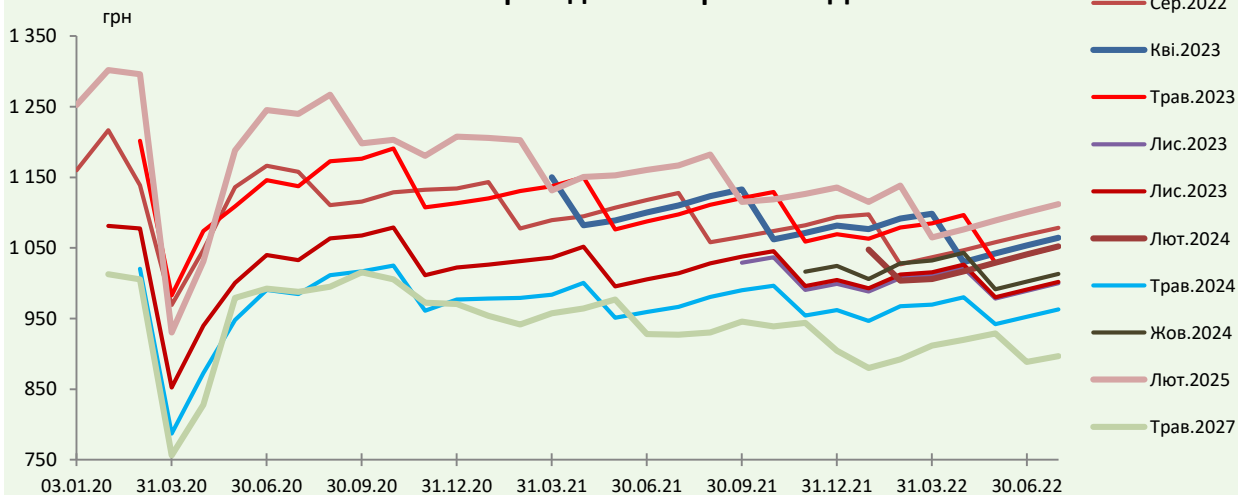
| Стаття доходів/витрат | Липень | Наростаючим підсумком |
|---|---------------|-----------------------|
| <i>Зміна справедливої вартості депозитів за рахунок нарахованих доходів</i> | 7 928 | 41 759 |
| Депозити | 7 928 | 41 759 |
| <i>Зміна справедливої вартості ОВДП за рахунок переоцінки</i> | 139 | (12 465) |
| <i>Зміна справедливої вартості ОВДП за рахунок нарахованих доходів</i> | 7 868 | 57 938 |
| ОВДП | 8 007 | 45 474 |
| <i>Доходи від оренди інвестиційної нерухомості</i> | 129 | 904 |
| <i>Майнові податки</i> | (43) | (303) |
| Інвестиційна нерухомість | 86 | 601 |
| <i>Дивіденди</i> | 871 | 871 |
| Інші активи | 871 | 871 |
| Інвестиційний дохід | 16 892 | 88 705 |
| <i>Аудиторські послуги</i> | - | (417) |
| Адміністративні витрати | - | (417) |
| Інші доходи/витрати | - | - |
| Прибуток (збиток) | 16 892 | 88 288 |

Звіт про результати діяльності КНПФ НБУ

Справедлива та номінальна вартість ОВДП

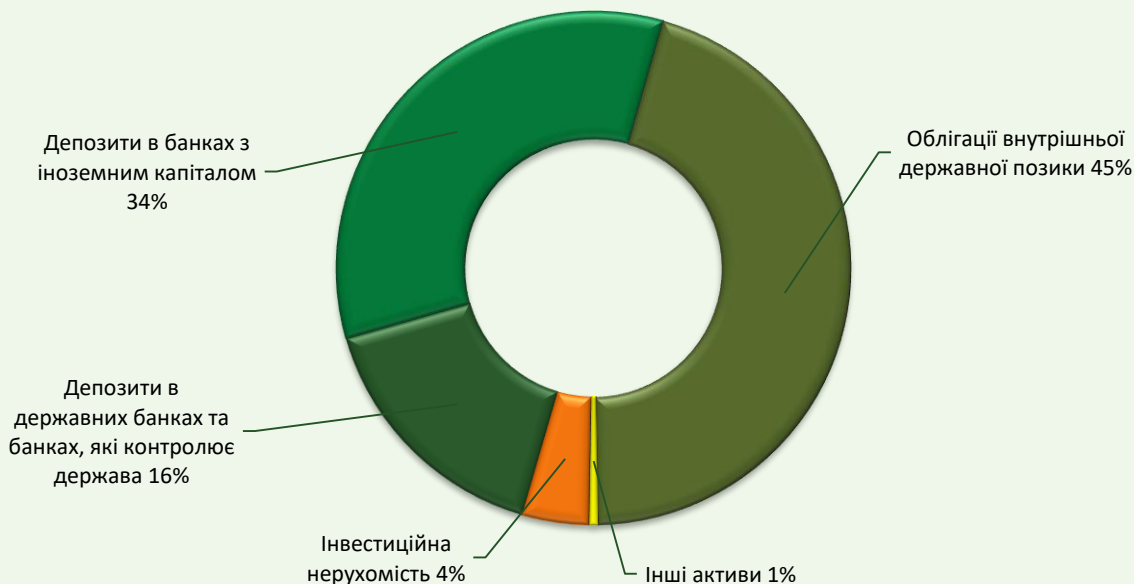


Зміна справедливої вартості ОВДП



Звіт про результати діяльності КНПФ НБУ

Структура активів



| Вид активу | Валюта | Номінальна вартість активів | Вартість активів | Питома вага у портфелі |
|--|--------|-----------------------------|------------------|------------------------|
| Поточний рахунок | UAH | 1 263 | 1 263 | 0,1% |
| Депозити в державних банках та банках, які контролює держава | UAH | 282 576 | 282 576 | 16,1% |
| Депозити в банках з іноземним капіталом | UAH | 592 024 | 592 024 | 33,8% |
| Всього грошові кошти | | 875 862 | 875 862 | 50,0% |
| Облігації внутрішньої державної позики | UAH | 815 554 | 793 237 | 45,3% |
| Всього облігації | | 815 554 | 793 237 | 45,3% |
| Всього акції | | 8 092 | 8 092 | 0,5% |
| Всього інвестиційна нерухомість | | 73 155 | 73 155 | 4,2% |
| Всього дебіторська заборгованість | | 118 | 118 | 0,0% |
| Всього активи | | 1 772 782 | 1 750 464 | 100% |

*Примітки:

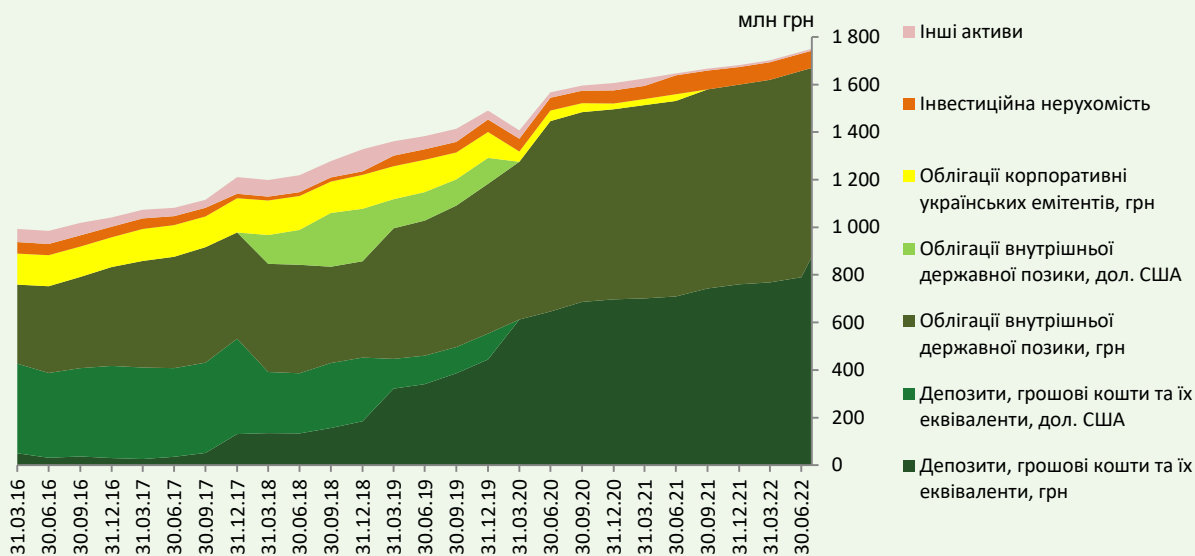
*згідно п.п.4 п.1 ст.49 ЗУ «Про недержавне пенсійне забезпечення» заборонено розміщувати на банківських депозитних рахунках у грошових коштах та в ощадних сертифікатах банків більш як 50% загальної вартості пенсійних активів

** 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

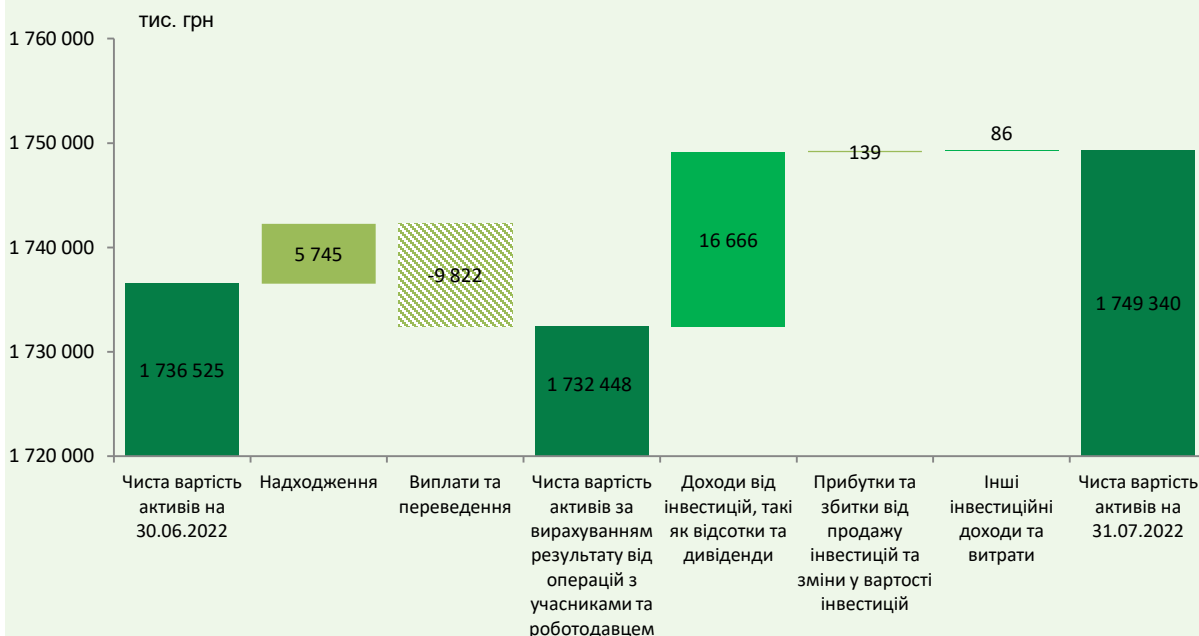
Джерело: Департамент з управління діяльністю КНПФ НБУ. Дані у тис. грн, станом на 31.07.2022.

Звіт про результати діяльності КНПФ НБУ

Зміна структури активів



Зміна чистої вартості активів



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 31.07.2022.