

Підсумки місяця

Інвестиційний дохід КНПФ НБУ (далі - Фонд) у грудні 2017 року сягнув рекордних 80,1 млн. гривень. Такого показнику переважно було досягнуто завдяки врахуванню щорічної оцінки активів Фонду та зростанню вартості банківських вкладів у доларах США.

Ринок облігацій внутрішньої державної позики (ОВДП)

Протягом грудня 2017 року ціни на ОВДП залишалися сталими, в середньому ціни коливалися на рівні 16% річних до погашення. Портфель ОВДП Фонду цього місяця приніс 7,1 млн. грн, що склалися здебільшого з отриманих відсоткових доходів.

Депозити

Дохід від банківських вкладів у грудні становив 52,7 млн. гривень і складався з двох частин. Перша й найбільша частина доходу - 35,6 млн. гривень була сформована після врахування щорічної оцінки активів Фонду; оцінщиком було прийнято до уваги низку рішень судів на користь Фонду і відновлено вартість забезпечення депозитів. Друга частина (17,1 млн. гривень) була отримана завдяки переоцінці вкладів у доларах США та відсотковим доходам.

Корпоративні облігації

Емітенти корпоративних облігацій, що входять до активів фонду, демонстрували позитивні фінансові показники у 2017 році. Оцінщик підвищив справедливую вартість облігацій на 16 млн. гривень, у грудні сплачено відсоткового доходу на суму 5,2 млн. гривень. Таким чином, всього у грудні 2017 року портфель корпоративних облігацій Фонду заробив 21,2 млн. гривень.

Головні показники діяльності



Вид активу	Валюта	Вартість активу	Питома вага у портфелі
Поточний рахунок НБУ	UAH	5	0,0%
Ощадбанк ПАТ	USD	117 556	9,7%
Укресімбанк АТ	USD	109 462	9,0%
Прокредит Банк ПАТ	UAH	90 604	7,5%
Кредобанк ПАТ	USD	89 702	7,4%
Укргазбанк ПАТ	UAH	39 918	3,3%
КБ ПриватБанк ПАТ	USD	44 139	3,6%
Депозити у банках, у яких діє тимчасова адміністрація, та у банках, що ліквідуються	UAH	44 910	3,7%
Всього грошові кошти		575 945	47,6%
Облігації внутрішньої державної позики	UAH	446 456	36,9%
Облігації корпоративні Аксіома ТОВ	UAH	72 607	6,0%
Облігації корпоративні Новотех-Інвест ТОВ	UAH	38 566	3,2%
Облігації корпоративні Україна СТОВ	UAH	32 892	2,7%
Облігації корпоративні українських емітентів, щодо яких тривають роботи з повернення проблемної заборгованості	UAH	9 181	0,8%
Всього облігації		599 702	49,5%
Всього акції		4 673	0,4%
Всього нерухомість		18 788	1,6%
Всього дебіторська заборгованість		720	0,1%
Всього інші активи		10 624	0,9%
Всього активи		1 210 452	100%

*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.

Статті доходу	Грудень	Наростаючим підсумком
Зміна справедливої вартості депозитів згідно переоцінки/нової облікової політики	35 615	35 615
Зміна справедливої вартості депозитів за рахунок курсової різниці	14 995	12 466
Зміна справедливої вартості депозитів за рахунок нарахованих доходів	2 163	27 708
Зміна справедливої вартості депозитів за рахунок використання методу ДГП	-	(862)
ОВДП	7 093	71 340
Корпоративні облігації	21 222	61 383
Реалізація заставного майна	-	7 390
Оренда нерухомості	225	3 398
Інші статті інвестиційного доходу	(1 191)	(3 580)
Інвестиційний дохід	80 121	214 859