

Звіт про результати діяльності КНПФ НБУ

Підсумки місяця

У грудні 2016 року інвестиційний дохід КНПФ НБУ склав 17,9 млн.грн. Основним чинником збільшення доходу від середньомісячного стало зростання курсу долара США до гривні. Цього місяця завершено річну оцінку активів Фонду, вартість активів суттєво не змінилася.

Ринок облігацій внутрішньої державної позики (ОВДП)

Незважаючи на падіння споживчої інфляції (12,4% у річному вимірі) та зниження облікової ставки центрального банку до 14% річних в останньому кварталі 2016 р., ринкові ціни на ОВДП залишаються сталими: середня дохідність складає 16-16,2% річних до погашення. Очікуючи поступове зниження дохідності, ми збільшили портфель ОВДП у грудні 2016 р. на 15 млн.грн. до 415 млн.грн., що в результаті склало 40 % від активів КНПФ НБУ. Протягом грудня загалом отримано доходів від портфелю ОВДП на суму 4,9 млн.грн.

Депозити

Зі зростанням у грудні курсу долара США до гривні, зросла вартість валютних депозитів і їх дохідність. Так, частка банківських вкладів у доларах США у активах КНПФ НБУ зросла до 37%, а їх дохідність у гривні за результатами 2016 р. склала 22,2% річних, що суттєво перевищило дохідність гривневих депозитів у надійних банках. На початку грудня укладено новий договір банківського вкладу у доларах США з АТ «Укресімбанк» та продовжено дію договору банківського вкладу у доларах США з ПАТ «Ощадбанк» з відсотковою ставкою 5,5% річних. Позитивний результат від операцій з банківськими депозитами у грудні 2016 р. склав 14,6 млн.грн.

Корпоративні облігації

Портфель корпоративних облігацій приніс у грудні з врахуванням річної переоцінки 1,1 млн.грн. доходу.

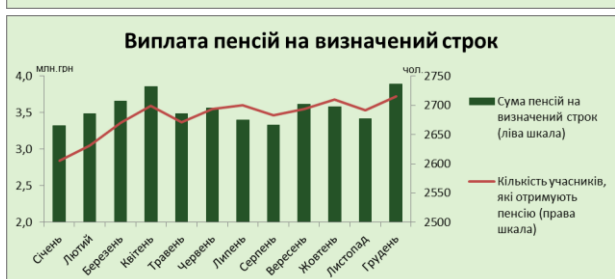
Нерухомість

З метою підвищення ставок оренди у грудні переукладено на рік відповідні договори з орендарями у Харкові, Стрию та Івано-Франківську. Відтепер середньозважена орендна ставка складає 15,6% річних. Сукупний дохід від такого виду інвестування у грудні склав 0,3 млн.грн.

Головні показники діяльності

Стаття доходів	Грудень	Наростаючим підсумком
ОВДП	4 897	66 339
Зміна справедливої вартості депозитів за рахунок курсової різниці	22 653	45 442
Зміна справедливої вартості депозитів за рахунок нарахованих доходів	2 218	36 487
Корпоративні облігації	474	(3 977)
% дохід від реструктуризації	521	8 904
Дохід від оренди нерухомості	(64)	1 727

Вид активу	Валюта	Вартість активу	Питома вага у портфелі
Поточний рахунок НБУ	UAH	14	0,0%
Депозити в державних банках та банках, що контролюються державою	UAH	8 399	0,8%
Депозити в інших банках з іноземним капіталом	USD	388 327	37,3%
Депозити в комерційних банках	UAH	21 174	2,0%
Всього грошові кошти		430 322	41,3%
Облігації внутрішньої державної позики	UAH	414 746	39,8%
Облігації корпоративні українських емітентів	UAH	135 260	13,0%
Всього облігації		550 005	52,8%
Всього акції		4 472	0,4%
Всього нерухомість		44 090	4,2%
Всього дебіторська заборгованість		2 060	0,2%
Всього інші активи		10 077	1,0%
Всього активи		1 041 026	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 одиниць пенсійних активів** - розрахункова вартість одиниць пенсійних активів, що визначається шляхом ділення чистої вартості активів на загальну кількість одиниць пенсійних активів на день підрахунку.