

Звіт про результати діяльності КНПФ НБУ

Підсумки місяця

У жовтні 2016 року інвестиційний дохід КНПФ НБУ склав 5,7 млн. грн. Зміцнення гривні по відношенню до долара США протягом жовтня спричинило отримання не такого високого рівня інвестиційного доходу, як у попередні місяці.

Ринок облігацій внутрішньої державної позики (ОВДП)

Обсяг облігацій внутрішньої державної позики України в структурі активів КНПФ НБУ в жовтні 2016 року суттєво не змінився і залишається значним (376 млн. грн. або 37% від активів КНПФ НБУ). З уповільненням темпів падіння рівня споживчої інфляції у жовтні 2016 уповільнився й ріст ринкової вартості ОВДП. Всього дохід КНПФ НБУ від ОВДП у жовтні склав 4,6 млн. грн.

Депозити

36% активів КНПФ НБУ розміщено у доларах США, це спричиняє певну волатильність доходів від банківських вкладів у місячному розрізі. Та оскільки доларові депозити за результатами останніх років були найприбутковішими інвестиціями КНПФ НБУ, протягом 2016 року цей вид вкладень залишається одним з найвдаліших.

В результаті проведеної роботи з ФГВФО на відкритому аукціоні було реалізовано заставне майно (нерухомість у м. Києві і у м. Суми), що слугувало забезпеченням депозитів у АТ «Імексбанк». Всього на поточний рахунок КНПФ НБУ отримано 6,8 млн. грн. Оскільки сума продажу цієї нерухомості була вища за балансову вартість, інвестиційний прибуток від даної операції склав 2,9 млн. грн.

Корпоративні облігації

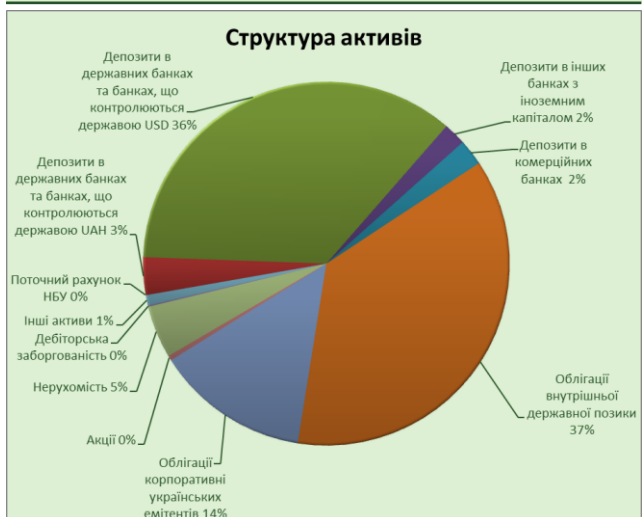
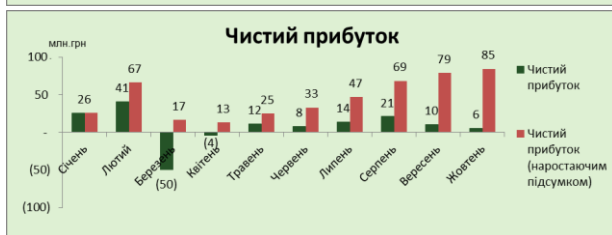
Портфель корпоративних облігацій приніс у жовтні 1,6 млн. грн. доходу.

Нерухомість

Сукупний дохід від здавання в оренду нерухомості склав у жовтні 266 тис. грн.

Головні показники діяльності

Стаття доходів	Жовтень	Наростаючим підсумком	Вид активу	Валюта	Вартість активу	Питома вага у портфелі
ОВДП	4 556	54 865	Поточний рахунок НБУ	UAH	82	0,0%
Зміна справедливої вартості депозитів за рахунок курсової різниці	(5 921)	21 310	Депозити в державних банках та банках, що контролюються державою	UAH	34 058	3,3%
Зміна справедливої вартості депозитів за рахунок нарахованих доходів	3 080	31 211	Депозити в інших банках з іноземним капіталом	USD	365 269	35,8%
Корпоративні облігації	1 593	(5 983)	Депозити в комерційних банках	UAH	20 312	2,0%
% дохід від реструктуризації	-	8 383	Всього грошові кошти		443 268	43,4%
Дохід від оренди нерухомості	266	1 534	Облігації внутрішньої державної позики	UAH	375 851	36,8%
			Облігації корпоративні українських емітентів	UAH	138 655	13,6%
			Всього облігації		514 507	50,4%
			Всього акції		4 411	0,4%
			Всього нерухомість		47 471	4,7%
			Всього дебіторська заборгованість		1 303	0,1%
			Всього інші активи		9 293	0,9%
			Всього активи		1 020 252	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 одиниці пенсійних активів, що визначається шляхом ділення чистої вартості активів на загальну кількість одиниць пенсійних активів на день підрахунку.