

Звіт про результати діяльності КНПФ НБУ

Підсумки місяця

У вересні 2018 року інвестиційний прибуток КНПФ НБУ (далі - Фонд) склав 9,6 млн гривень. Оскільки впродовж вересня курс гривні до долара США залишався відносно стабільним, майже весь прибуток було отримано за рахунок відсоткового доходу.

Ринок облігацій внутрішньої державної позики (ОВДП)

Дохід від ОВДП у вересні склав 4,1 млн гривень, з них 4 млн гривень – відсотки та накопичений купонний дохід, 150 тис гривень – дохід за рахунок підвищення курсу долара США до гривні. Зважаючи на певну ринкову невизначеність та жорстку монетарну політику центрального банку середньозважена дюрація портфелю ОВДП Фонду планово знижується, на разі вона становить біля року, що дозволяє тримати доходність портфелю на високому рівні та убезпечуватися від зниження його вартості.

Депозити

Дохід від операцій з банківським вкладом у вересні склав 3,1 млн гривень. З них 2,9 млн гривень становив відсотковий дохід, 200 тис гривень доходу було отримано від переоцінки доларових депозитів.

Корпоративні облігації

У вересні портфель корпоративних облігацій заробив 3,1 млн гривень купонного доходу.

Нерухомість

Дохід Фонду від здавання в оренду нерухомості цього місяця склав 98 тисяч гривень.

Стаття доходів/витрат	Вересень	Наростаючим підсумком
<i>Зміна справедливої вартості депозитів за рахунок курсової різниці</i>	190	5 015
<i>Зміна справедливої вартості депозитів за рахунок нарахованих доходів</i>	2 890	22 896
Депозити	3 080	27 911
<i>Зміна справедливої вартості ОВДП за рахунок курсової різниці</i>	152	4 368
<i>Зміна справедливої вартості ОВДП за рахунок переоцінки</i>	(1 116)	(8 744)
<i>Зміна справедливої вартості ОВДП за рахунок нарахованих доходів</i>	5 078	50 812
ОВДП	4 114	46 435
<i>Зміна справедливої вартості корпоративних облігацій за рахунок нарахованих доходів</i>	3 062	26 703
<i>Зміна справедливої вартості корпоративних облігацій за рахунок погашення/продажу</i>	103	963
Корпоративні облігації	3 165	27 666
<i>Доходи від оренди нерухомості</i>	98	891
<i>Доходи від продажу нерухомості</i>	-	251
<i>Майнові податки</i>	(10)	(117)
Нерухомість	88	1 025
<i>Дивіденди</i>	-	609
<i>Доходи від продажу обладнання</i>	-	147
Інші активи	-	756
Інвестиційний дохід	10 447	103 793
<i>Послуги з обслуговування активів</i>	(877)	(877)
<i>Аудиторські послуги</i>	-	(337)
<i>Юридичні послуги</i>	(20)	(474)
Адміністративні витрати	(897)	(1 687)
Інші доходи/витрати	-	6
Прибуток (збиток)	9 551	102 112

Звіт про результати діяльності КНПФ НБУ

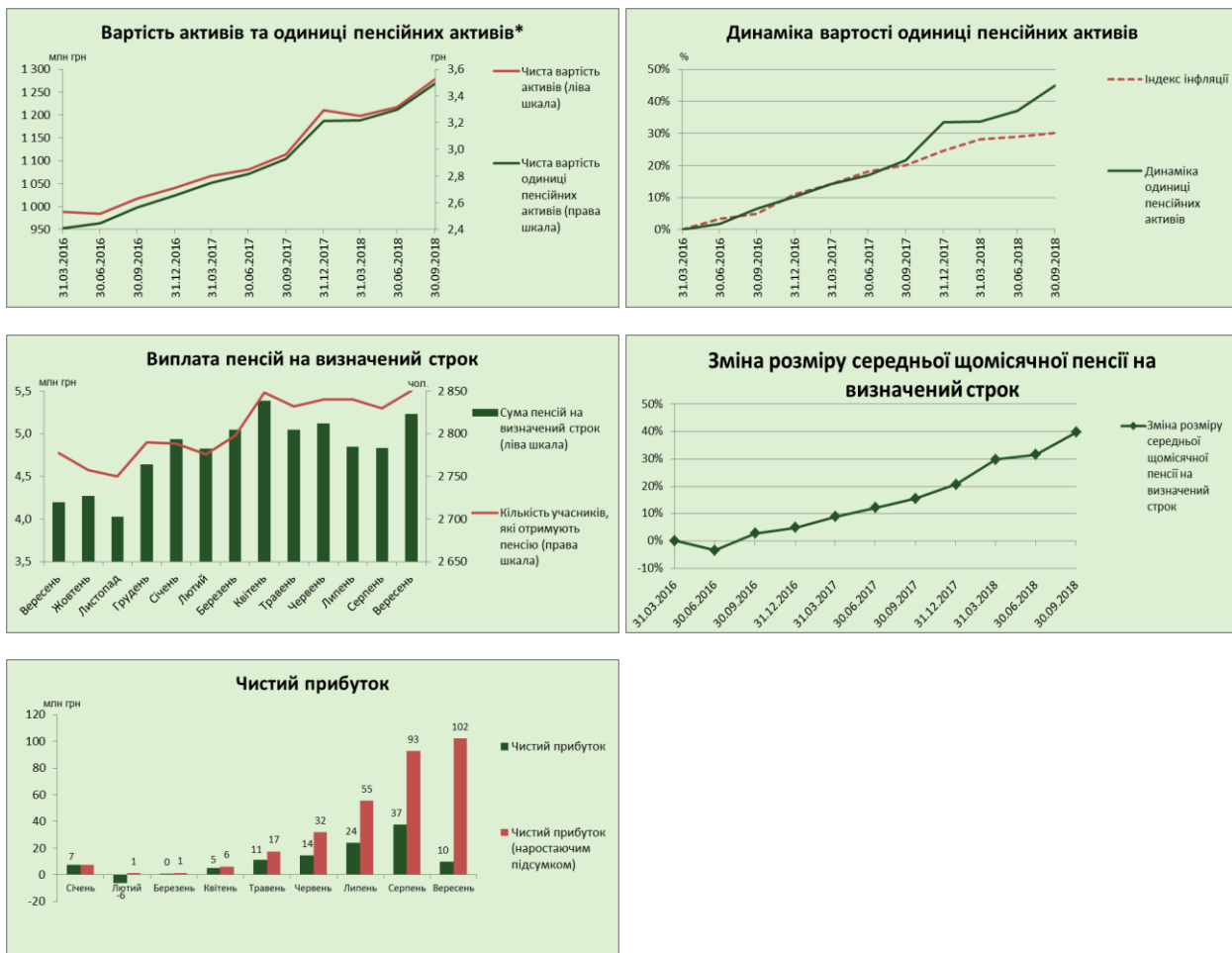
Головні показники діяльності



Вид активу	Валюта	Вартість активів	Питома вага у портфелі
Поточний рахунок НБУ	UAH	79	0,0%
Депозити у державних банках та банках, що контролюються державою	UAH	14 374	1,1%
Депозити у банках з іноземним капіталом	USD	273 671	21,4%
Депозити у банках, у яких діє тимчасова адміністрація, та у банках, що ліквідуються	UAH	44 910	3,5%
Всього грошові кошти		474 570	37,1%
Облігації внутрішньої державної позики	UAH	405 100	31,7%
Облігації внутрішньої державної позики, USD	USD	225 539	17,6%
Облігації корпоративні українських емітентів	UAH	131 564	10,3%
Облігації корпоративні українських емітентів, щодо яких тривають роботи з повернення проблемної заборгованості	UAH	9 181	0,7%
Всього облігації		771 385	60,3%
Всього акції		4 673	0,4%
Всього нерухомість		16 839	1,3%
Всього дебіторська заборгованість		553	0,0%
Всього інші активи		10 421	0,8%
Всього активи		1 278 441	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.

Джерело: КНПФ НБУ. Дані у тис. грн., станом на 30.09.2018.

Звіт про результати діяльності КНПФ НБУ

Головні показники діяльності

