

Звіт про результати діяльності КНПФ НБУ станом на 29.02.2024 р. (1/9)

Інвестиційний коментар станом на 29 лютого 2024 року

У лютому 2024 року фінансовий результат КНПФ НБУ становив 22,9 млн грн. Доходи звітного місяця було сформовано з нарахованих та отриманих відсотків портфелю депозитів та облігацій внутрішніх державних позик (далі – ОВДП). Див. також нижче коментар щодо воєнного стану в Україні.

Облігації внутрішньої державної позики (ОВДП)

У звітному місяці ціни на ринку ОВДП були майже незмінними. Ставки дохідності вторинного ринку залишалися близькими до рівнів первинного ринку ОВДП, де найбільшим попитом користувалися папери із залишковим строком обігу від 1 до 2 років. Через стабілізацію цін на ринку переоцінка портфелю ОВДП, які належать КНПФ НБУ, була незначною і становила 2,2 млн грн. Відсоткові доходи за ОВДП у лютому склали 12,2 млн грн. Таким чином, сукупні доходи портфелю ОВДП у звітному місяці становили 14,4 млн грн.

Інформацію щодо відповідної кривої безкупонної дохідності, побудованої за гривневими ОВДП, а також офіційні дані щодо справедливої вартості цінних паперів, які використовуються для щоденного розрахунку справедливої вартості (переоцінки) портфелю ОВДП фонду, можна знайти на порталі Національного банку України за [посиланням](#).

Депозити

У лютому відсоткові ставки за короткостроковими банківськими вкладами в сегменті великих корпоративних вкладників залишилися на рівні 10-12% річних. Відтак, у звітному місяці відсоткові доходи портфелю депозитів КНПФ НБУ становили 11,3 млн грн, а переоцінка депозитів за справедливою вартістю склала -2,7 млн грн. Таким чином, загальний дохід від операцій з банківськими вкладами у звітному місяці становив 8,6 млн грн.

Інвестиційна нерухомість

Фінансовий результат від здавання в оренду інвестиційної нерухомості, з урахуванням сплачених податків, становив у лютому 90 тис. грн.

Коментар щодо воєнного стану в Україні

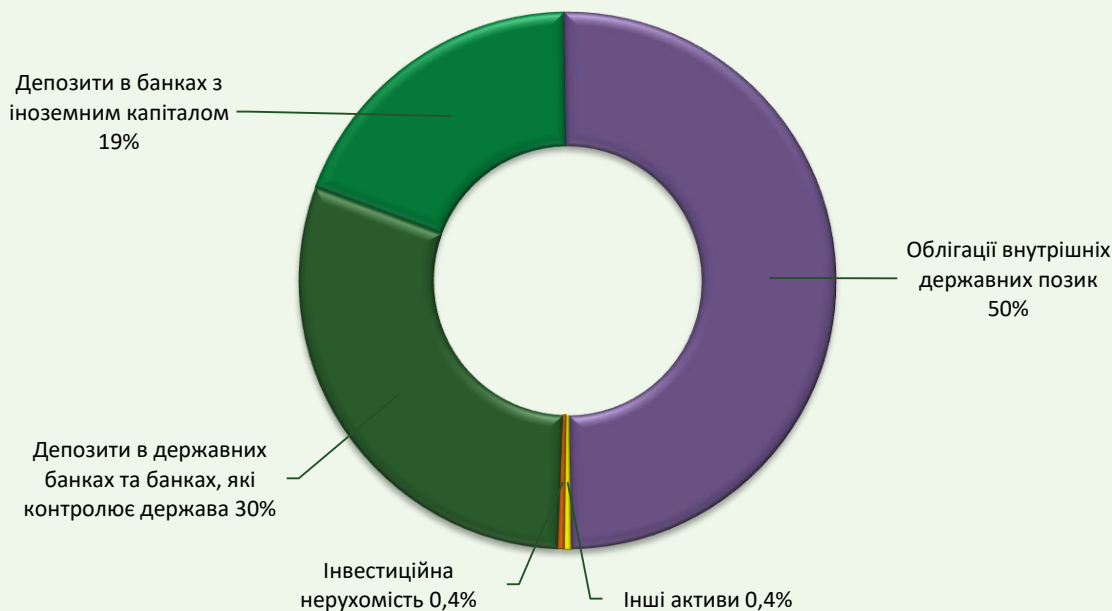
Повідомляємо, що з огляду на запровадження воєнного стану, при інвестуванні пенсійних активів Фонду перевага надається розміщенню коштів на короткострокові депозитні вклади, а також інвестуванню в короткострокові та середньострокові ОВДП, із дотриманням законодавчих обмежень щодо складу та структури активів, а також лімітів фінансових ризиків Системи управління ризиками КНПФ НБУ.

Звіт про результати діяльності КНПФ НБУ станом на 29.02.2024 р. (2/9)

Стаття доходів/витрат	Лютий	Наростаючим підсумком
<i>Зміна справедливої вартості депозитів за рахунок використання методу ДГП</i>	(2 706)	(3 305)
<i>Зміна справедливої вартості депозитів за рахунок нарахованих доходів</i>	11 344	23 563
Депозити	8 638	20 258
<i>Зміна справедливої вартості ОДВП за рахунок переоцінки</i>	2 151	5 693
<i>Зміна справедливої вартості ОДВП за рахунок нарахованих доходів</i>	12 205	25 083
ОВДП	14 357	30 775
<i>Доходи від оренди інвестиційної нерухомості</i>	120	240
<i>Майнові податки</i>	(30)	(30)
Інвестиційна нерухомість	90	210
Інші активи	-	-
Інвестиційний дохід	23 085	51 243
<i>Аудиторські послуги</i>	(197)	(407)
Адміністративні витрати	(197)	(407)
Прибуток (збиток)	22 888	50 836

Звіт про результати діяльності КНПФ НБУ станом на 29.02.2024 р. (3/9)

Структура активів



Вид активу	Валюта	Номінальна вартість активів*	Вартість активів	Питома вага у портфелі
Поточний рахунок	UAH	1 998	1 998	0,1%
Депозити в державних банках та банках, які контролює держава	UAH	640 392	642 304	30,1%
Депозити в банках з іноземним капіталом	UAH	407 976	408 663	19,1%
Всього грошові кошти		1 050 367	1 052 966	49,3%
Облігації внутрішніх державних позик	UAH	1 099 856	1 066 875	50,0%
Всього облігації		1 099 856	1 066 875	50,0%
Всього акції		6 987	6 987	0,3%
Всього інвестиційна нерухомість		7 678	7 678	0,4%
Всього дебіторська заборгованість		-	-	-
Всього активи		2 164 887	2 134 506	100%

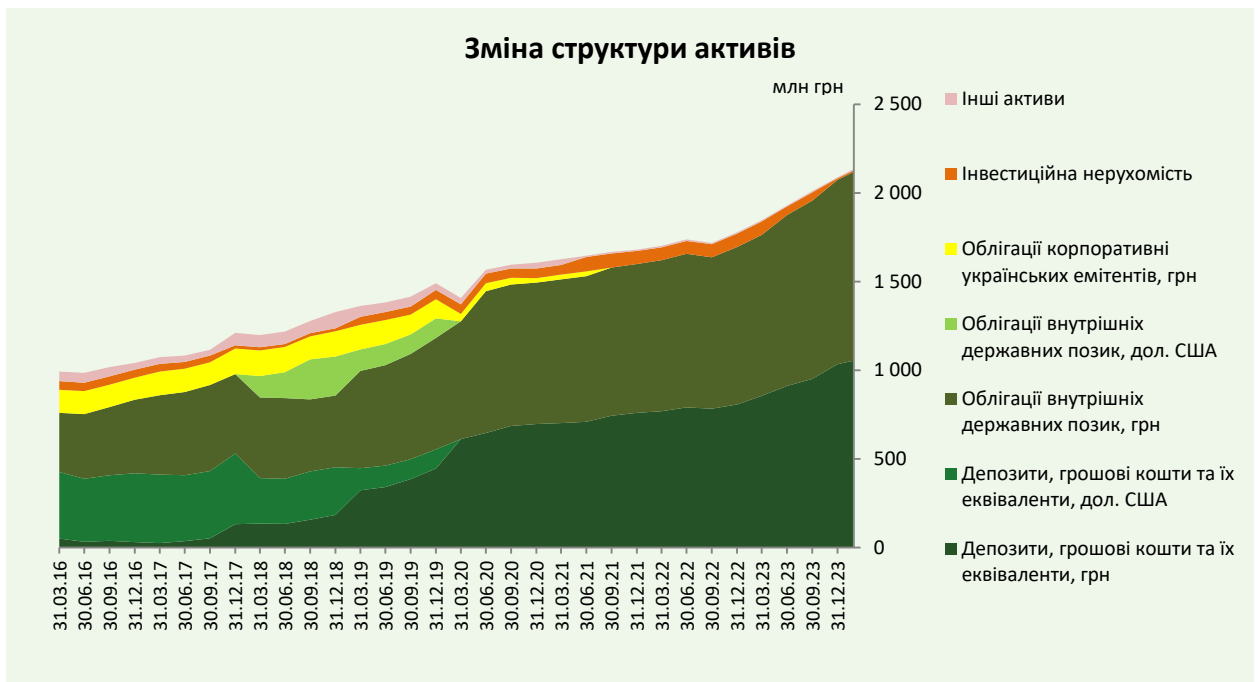
Примітки:

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

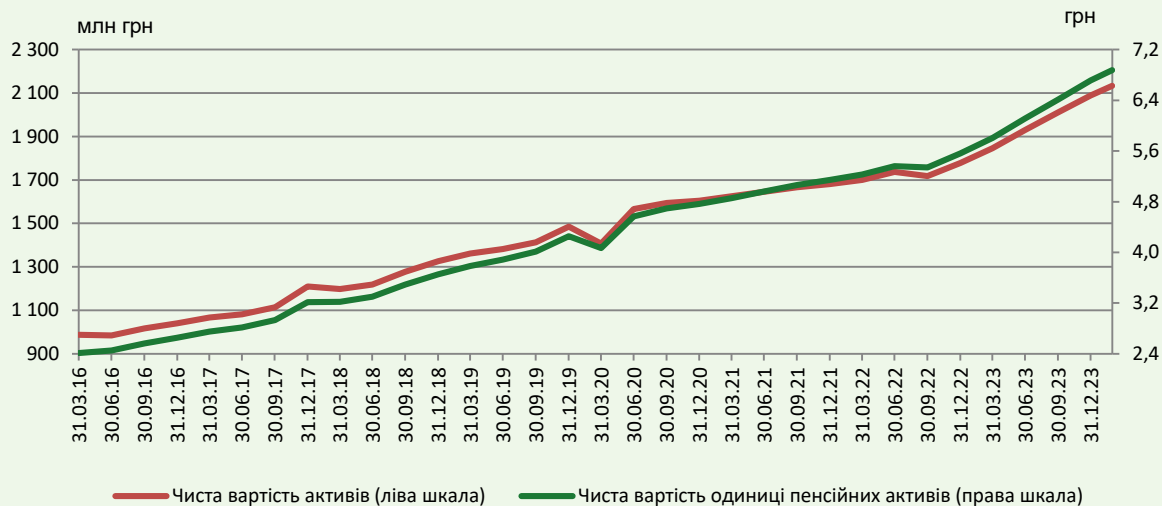
Джерело: Департамент з управління діяльністю КНПФ НБУ. Дані у тис. грн, станом на 29.02.2024.

Звіт про результати діяльності КНПФ НБУ станом на 29.02.2024 р. (4/9)

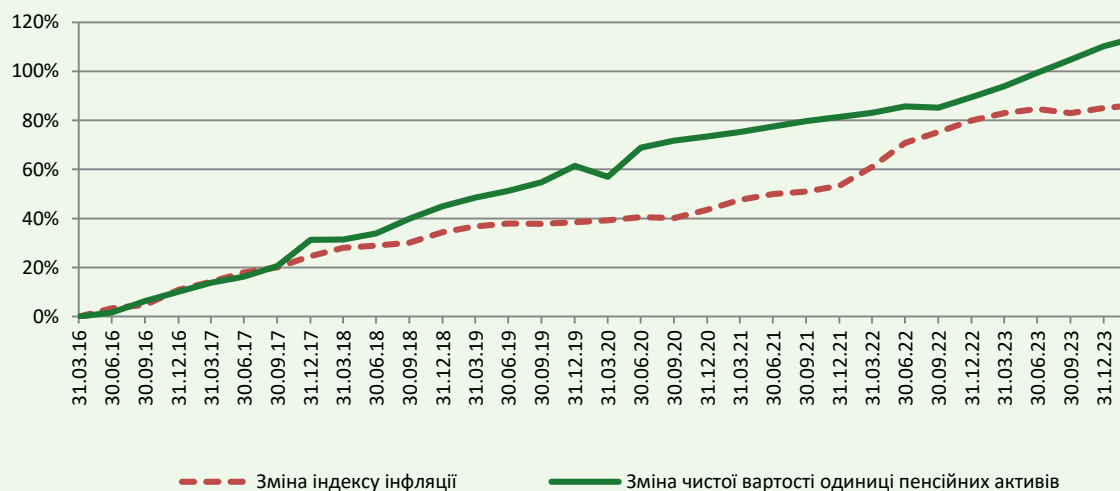


Звіт про результати діяльності КНПФ НБУ станом на 29.02.2024 р. (5/9)

Чиста вартість активів та одиниці пенсійних активів*



Зміна чистої вартості одиниці пенсійних активів



***Примітки:**

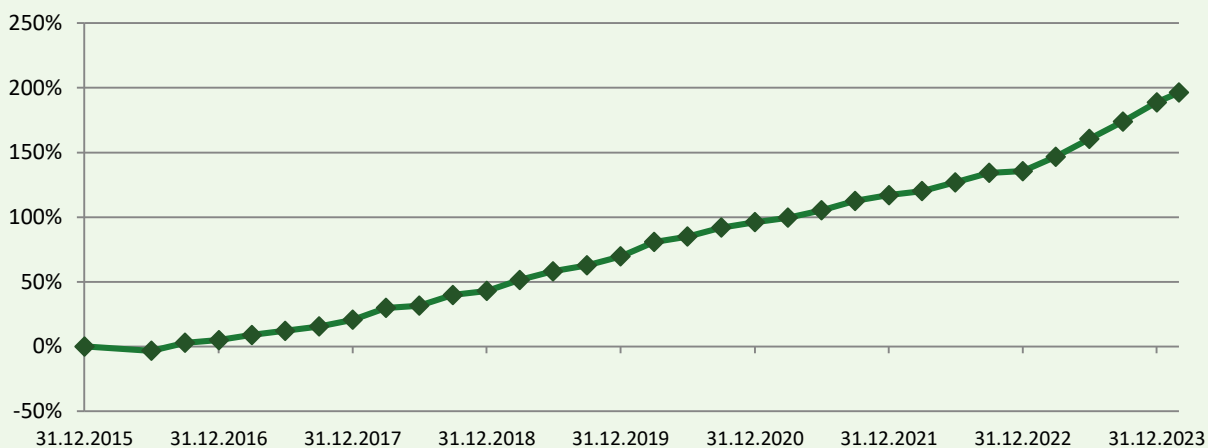
чиста вартість активів пенсійного фонду - різниця між вартістю активів пенсійного фонду на день проведення підрахунку та сумою зобов'язань пенсійного фонду, що підлягають виконанню на день проведення підрахунку.

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 29.02.2024.

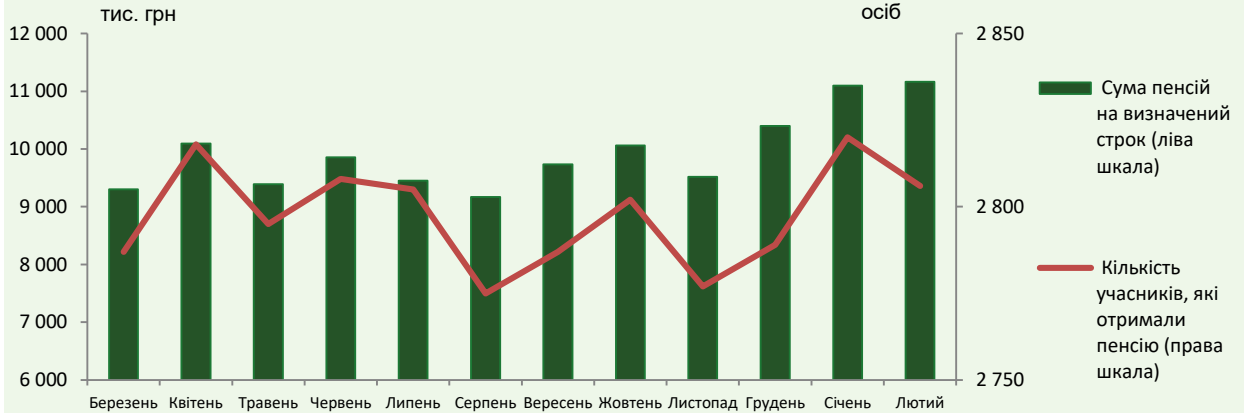
Звіт про результати діяльності КНПФ НБУ станом на 29.02.2024 р. (6/9)

Зміна розміру середньої щомісячної пенсії на визначений строк

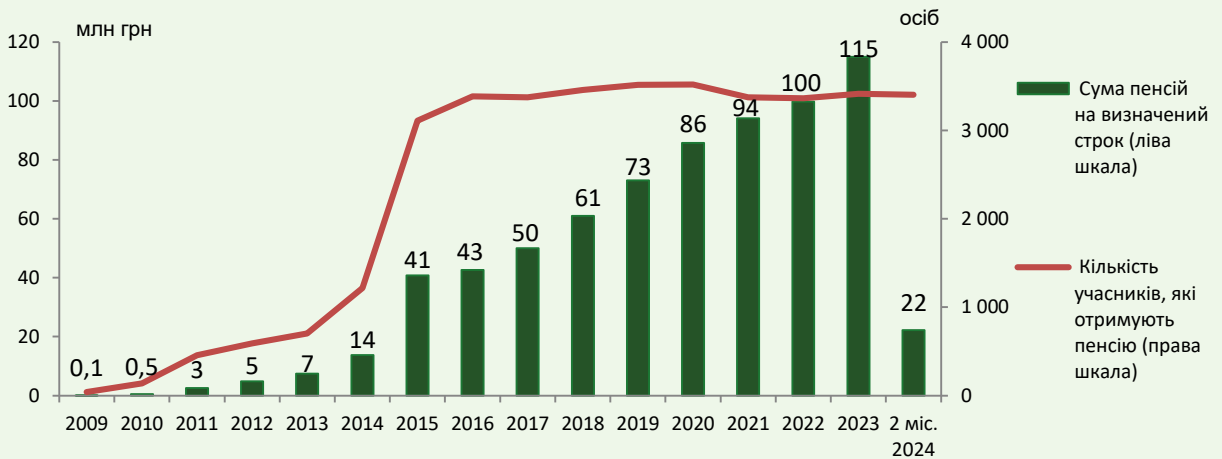


Звіт про результати діяльності КНПФ НБУ станом на 29.02.2024 р. (7/9)

Виплата пенсій на визначений строк (помісячно)

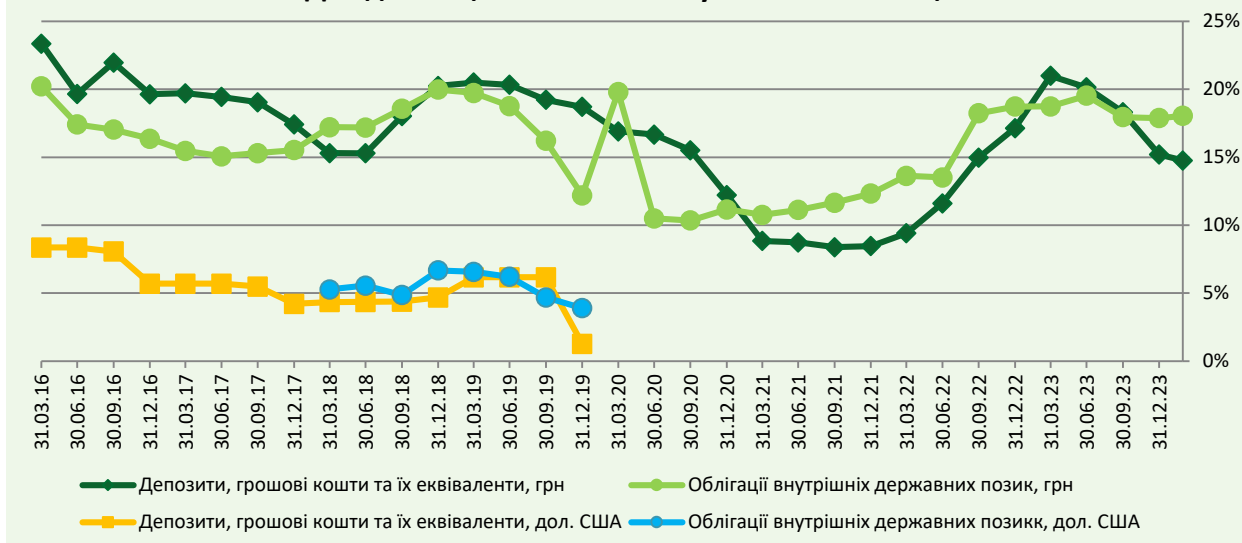


Виплата пенсій на визначений строк (за роками діяльності Фонду)

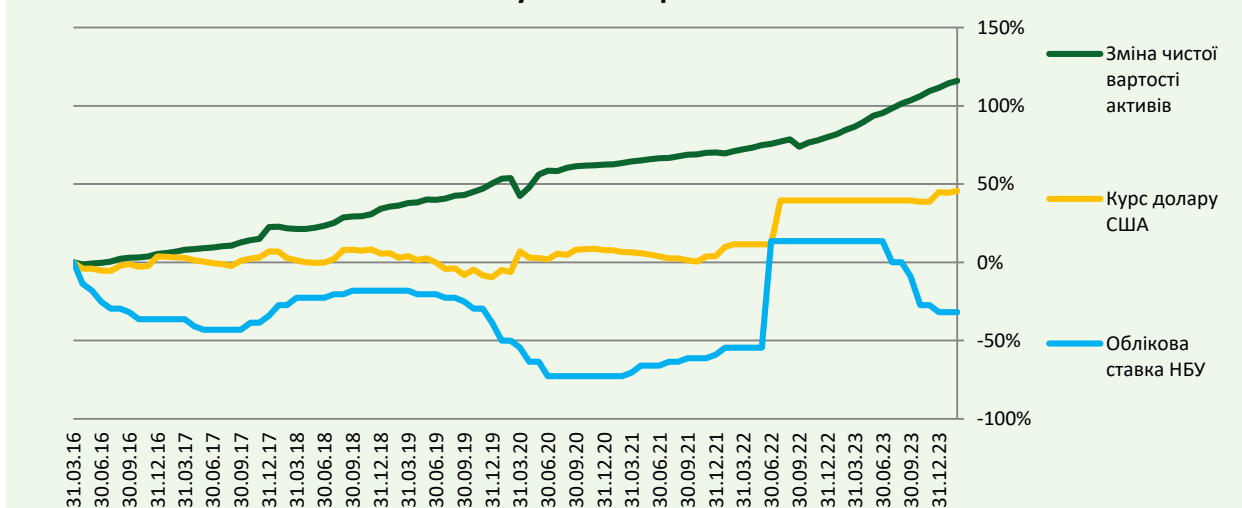


Звіт про результати діяльності КНПФ НБУ станом на 29.02.2024 р. (8/9)

Дохідність цільових активів у валюті інвестиції



Вплив ключових макроекономічних показників на зміну чистої вартості активів



Звіт про результати діяльності КНПФ НБУ станом на 29.02.2024 р. (9/9)

