

Звіт про результати діяльності КНПФ НБУ станом на 30.04.2024 р. (1/9)

Інвестиційний коментар станом на 30 квітня 2024 року

У квітні 2024 року фінансовий результат КНПФ НБУ становив 31,3 млн грн. Доходи звітного місяця було переважно сформовано завдяки нарахованим відсоткам та позитивній переоцінці портфелю облігацій внутрішніх державних позик (далі – ОВДП). Див. також нижче коментар щодо воєнного стану в Україні.

Облігації внутрішньої державної позики (ОВДП)

Цього місяця ціни на ОВДП несуттєво зросли. На тлі слабого попиту, відсоткові ставки за ОВДП із залишковим строком до погашення менше двох років дещо знизилися, що, у свою чергу, позитивно вплинуло на переоцінку портфелю ОВДП Фонду. Так, у звітному місяці переоцінка портфелю ОВДП, які належать КНПФ НБУ, становила 4,8 млн грн. Відсоткові доходи за ОВДП у квітні склали 12,9 млн грн. Таким чином, сукупні доходи портфелю ОВДП у звітному місяці становили 17,7 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 квітні відсоткові ставки за короткостроковими банківськими вкладками в сегменті великих корпоративних вкладників залишилися на рівні 10-12% річних. Відтак, у звітному місяці відсоткові доходи портфелю депозитів КНПФ НБУ становили 11,8 млн грн, а переоцінка депозитів за справедливою вартістю склала 1,7 млн грн. Таким чином, загальний дохід від операцій з банківськими вкладками у звітному місяці становив 13,6 млн грн.

Інвестиційна нерухомість

Фінансовий результат від здавання в оренду інвестиційної нерухомості, з урахуванням сплачених податків, становив у квітні 105 тис. грн.

Коментар щодо воєнного стану в Україні

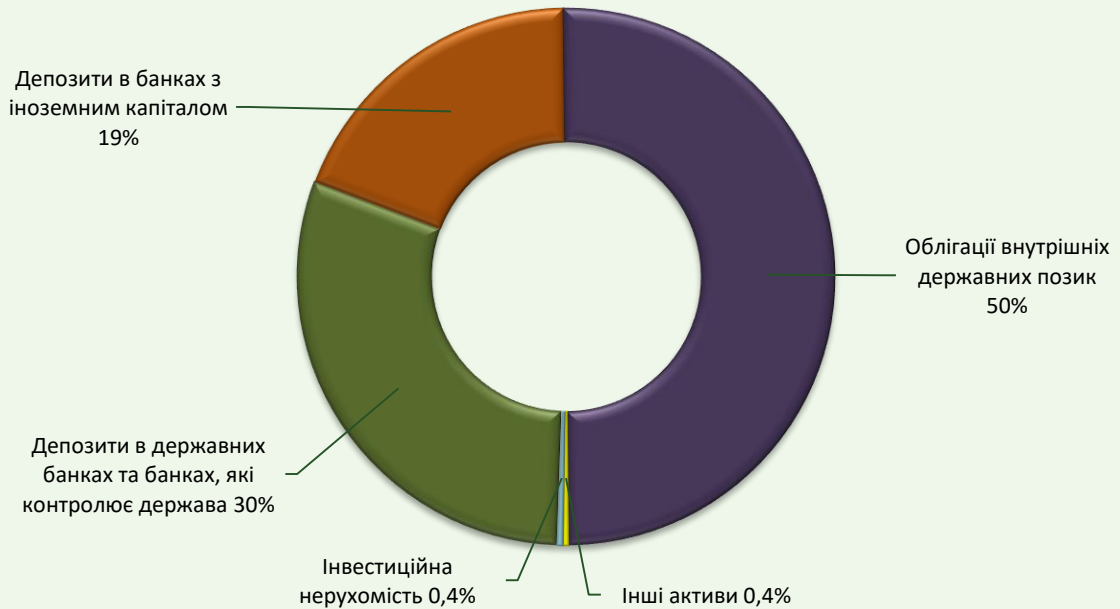
Повідомляємо, що з огляду на запровадження воєнного стану, при інвестуванні пенсійних активів Фонду перевага надається розміщенню коштів на короткострокові депозитні вклади, а також інвестуванню в короткострокові та середньострокові ОВДП, із дотриманням законодавчих обмежень щодо складу та структури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

Звіт про результати діяльності КНПФ НБУ станом на 30.04.2024 р. (2/9)

Стаття доходів/витрат	Квітень	Наростаючим підсумком
<i>Зміна справедливої вартості депозитів за рахунок використання методу ДГП</i>	1 727	(3 235)
<i>Зміна справедливої вартості депозитів за рахунок нарахованих доходів</i>	11 839	47 663
Депозити	13 566	44 429
<i>Зміна справедливої вартості ОДВП за рахунок переоцінки</i>	4 757	18 259
<i>Зміна справедливої вартості ОДВП за рахунок нарахованих доходів</i>	12 898	51 210
ОВДП	17 655	69 469
<i>Доходи від оренди інвестиційної нерухомості</i>	120	480
<i>Майнові податки</i>	(15)	(60)
Інвестиційна нерухомість	105	420
Інші активи	-	-
Інвестиційний дохід	31 326	114 318
<i>Аудиторські послуги</i>	(10)	(567)
Адміністративні витрати	(10)	(567)
Прибуток (збиток)	31 315	113 751

Звіт про результати діяльності КНПФ НБУ станом на 30.04.2024 р. (3/9)

Структура активів



Вид активу	Валюта	Номінальна вартість активів*	Вартість активів	Питома вага у портфелі
Поточний рахунок	UAH	711	711	0,0%
Депозити в державних банках та банках, які контролює держава	UAH	657 306	659 840	30,2%
Депозити в банках з іноземним капіталом	UAH	416 695	416 832	19,1%
Всього грошові кошти		1 074 713	1 077 382	49,3%
Облігації внутрішніх державних позицій	UAH	1 114 113	1 093 267	50,0%
Всього облігації		1 114 113	1 093 267	50,0%
Всього акції		6 987	6 987	0,3%
Всього інвестиційна нерухомість		7 678	7 678	0,4%
Всього дебіторська заборгованість		-	-	-
Всього активи		2 203 491	2 185 314	100%

Примітки:

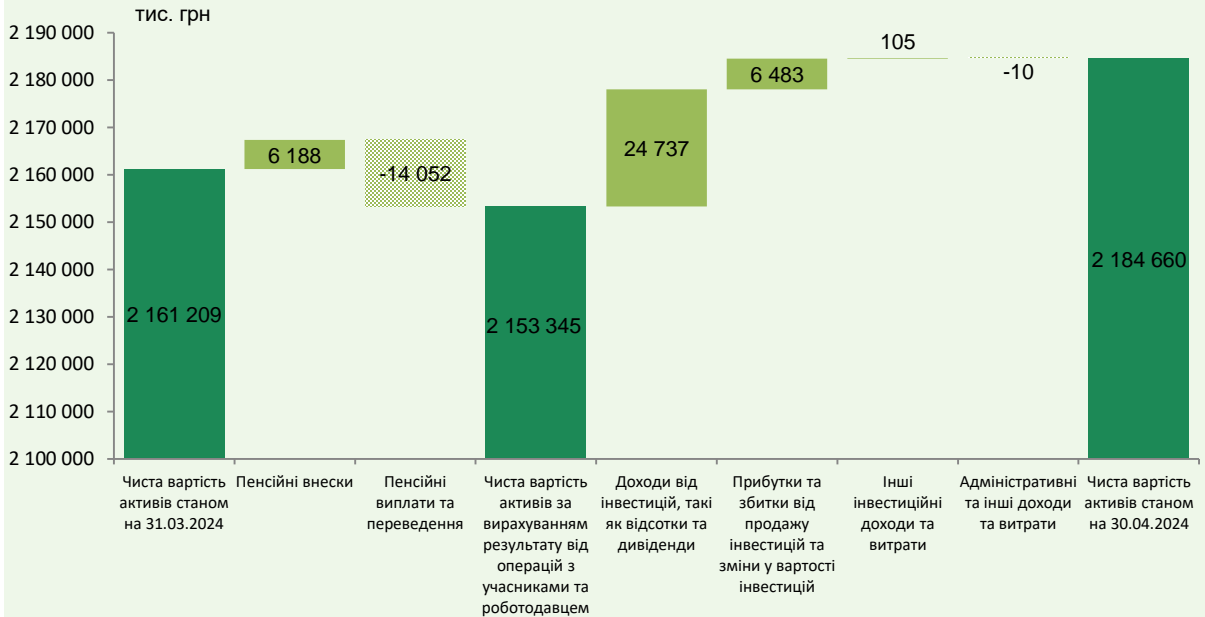
згідно п.п.4 п.1 ст.49 ЗУ «Про недержавне пенсійне забезпечення» заборонено розміщувати на банківських депозитних рахунках у грошових коштах та в ощадних сертифікатах банків більш як 50% загальної вартості пенсійних активів

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

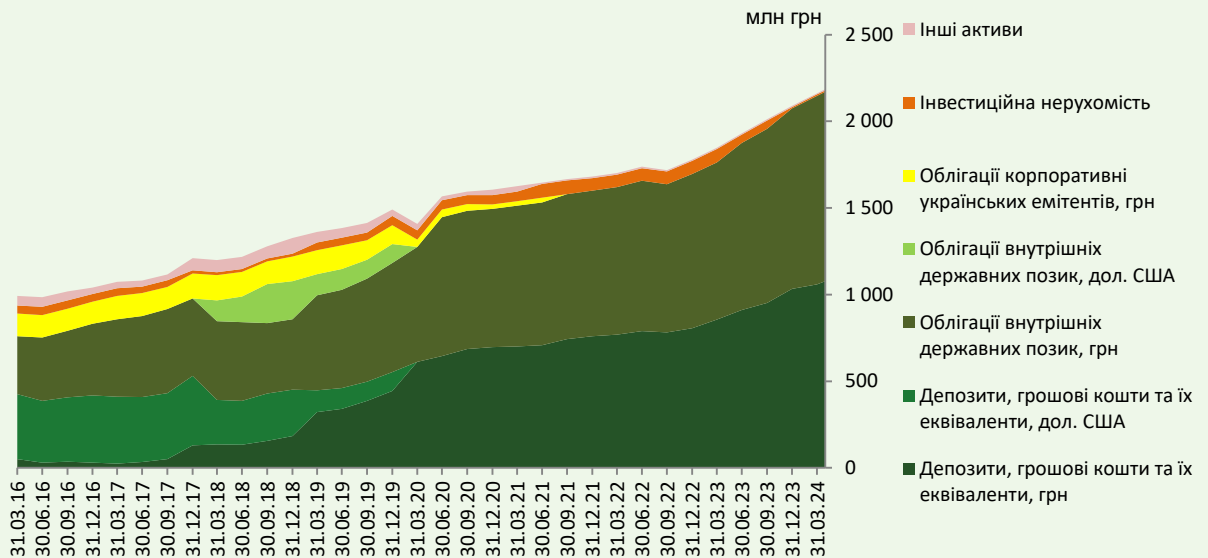
Джерело: Департамент з управління діяльністю КНПФ НБУ. Дані у тис. грн, станом на 30.04.2024.

Звіт про результати діяльності КНПФ НБУ станом на 30.04.2024 р. (4/9)

Зміна чистої вартості активів

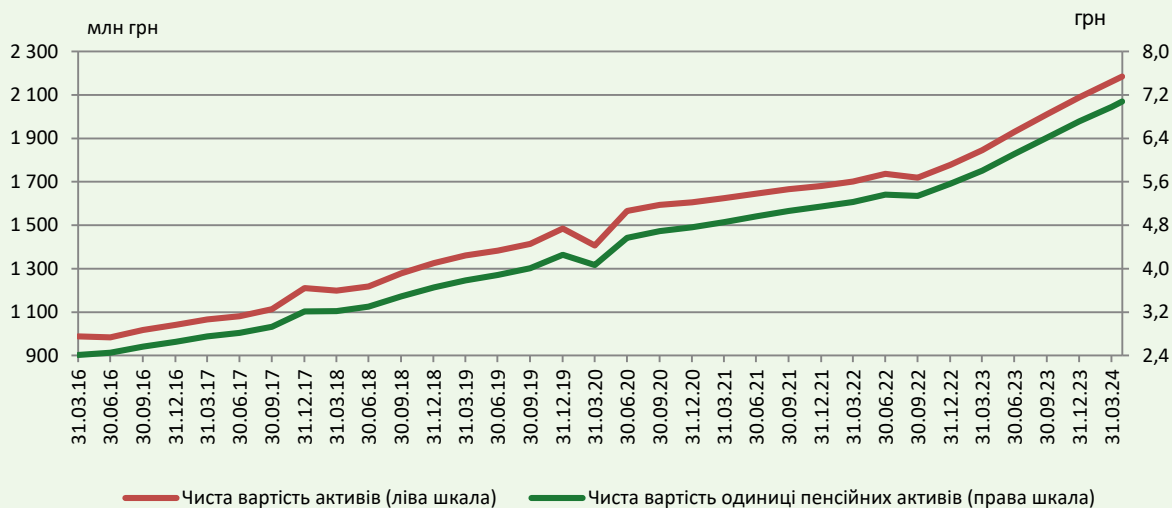


Зміна структури активів

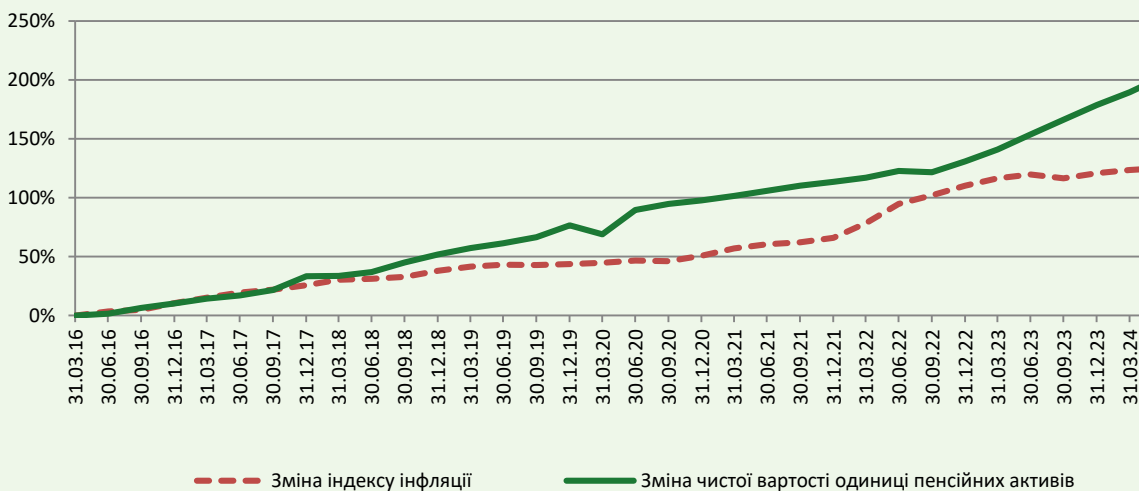


Звіт про результати діяльності КНПФ НБУ станом на 30.04.2024 р. (5/9)

Чиста вартість активів та одиниці пенсійних активів



Зміна чистої вартості одиниці пенсійних активів



***Примітки:**

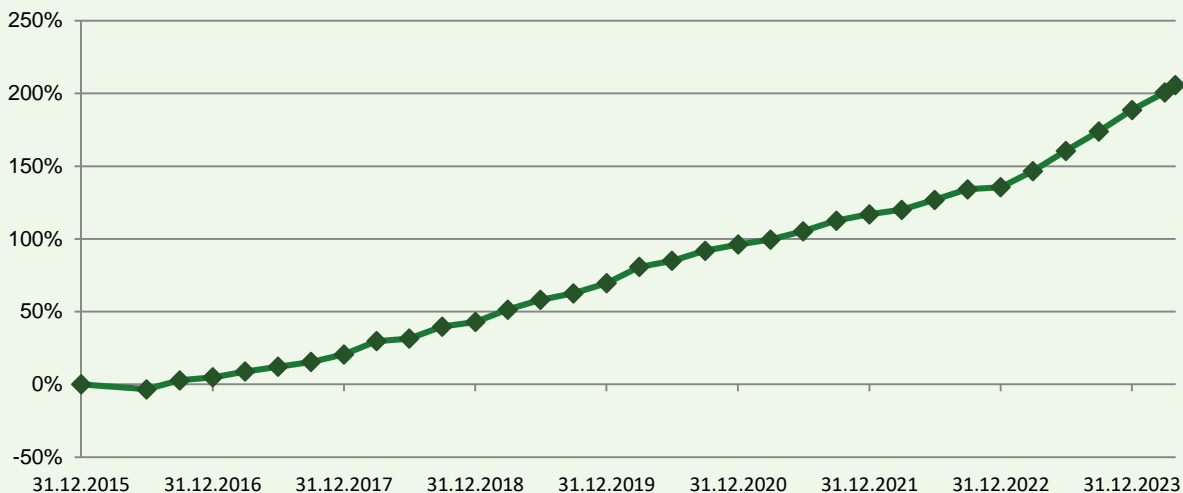
чиста вартість активів пенсійного фонду - різниця між вартістю активів пенсійного фонду на день проведення підрахунку та сумою зобов'язань пенсійного фонду, що підлягають виконанню на день проведення підрахунку.

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 30.04.2024.

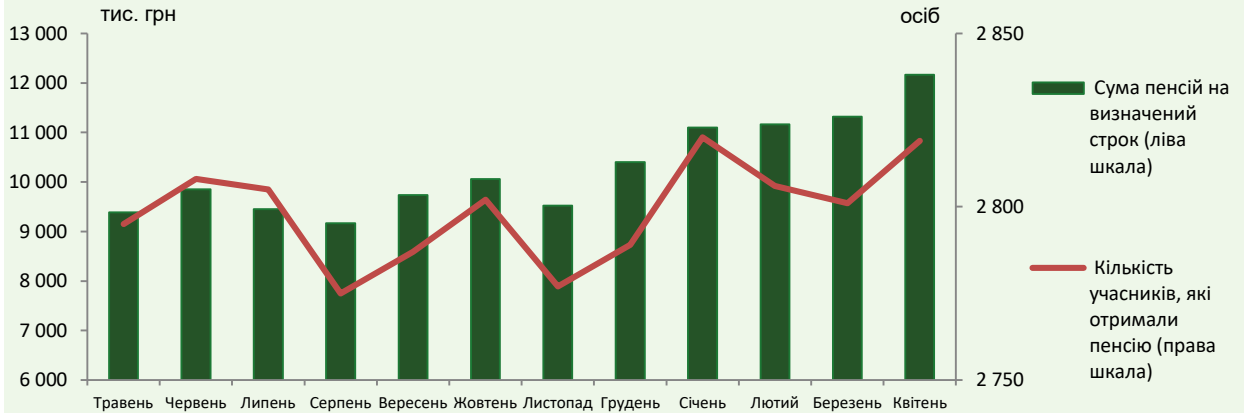
Звіт про результати діяльності КНПФ НБУ станом на 30.04.2024 р. (6/9)

Зміна розміру середньої щомісячної пенсії на визначений строк

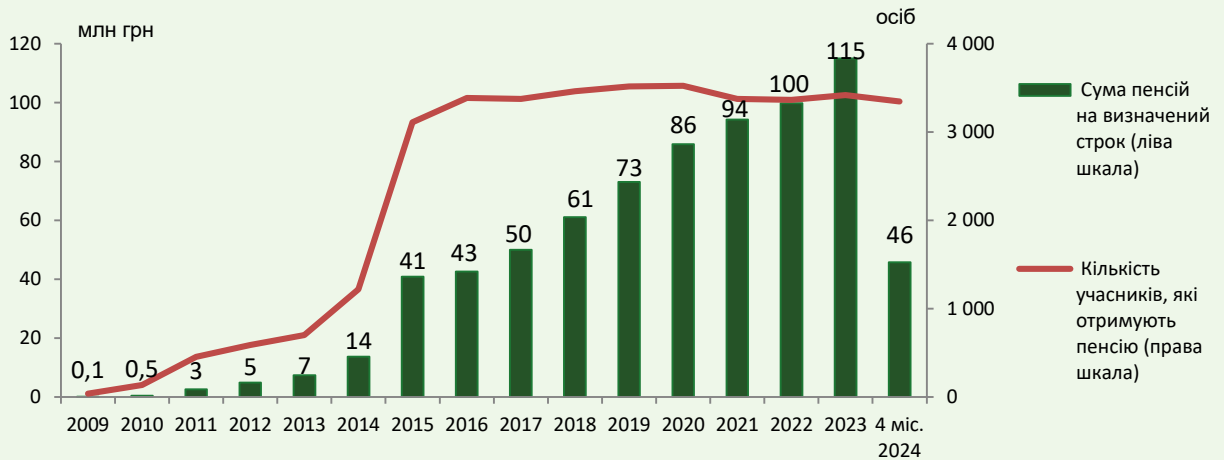


Звіт про результати діяльності КНПФ НБУ станом на 30.04.2024 р. (7/9)

Виплата пенсій на визначений строк (помісячно)

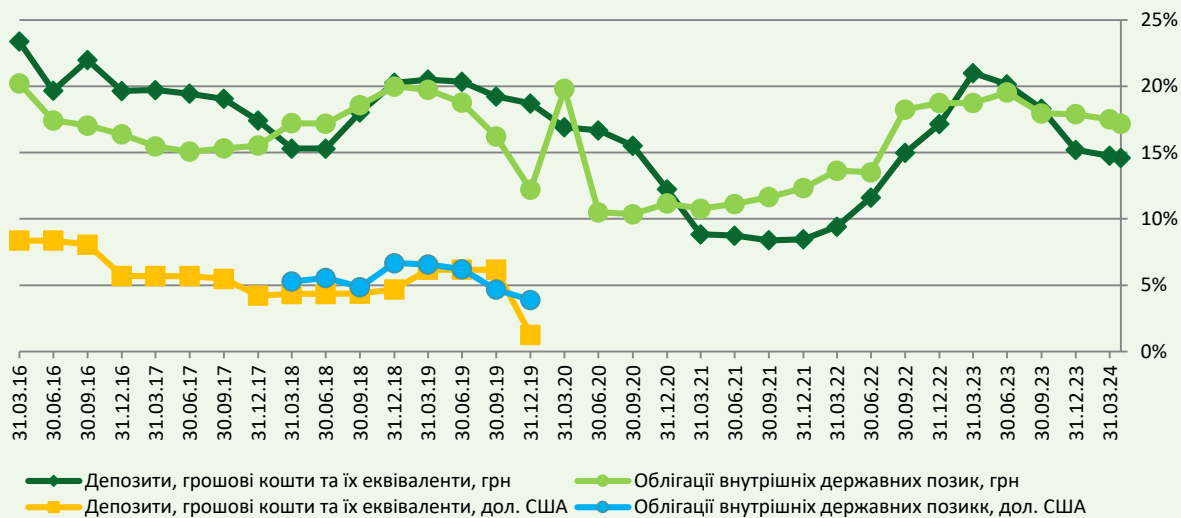


Виплата пенсій на визначений строк (за роками діяльності Фонду)

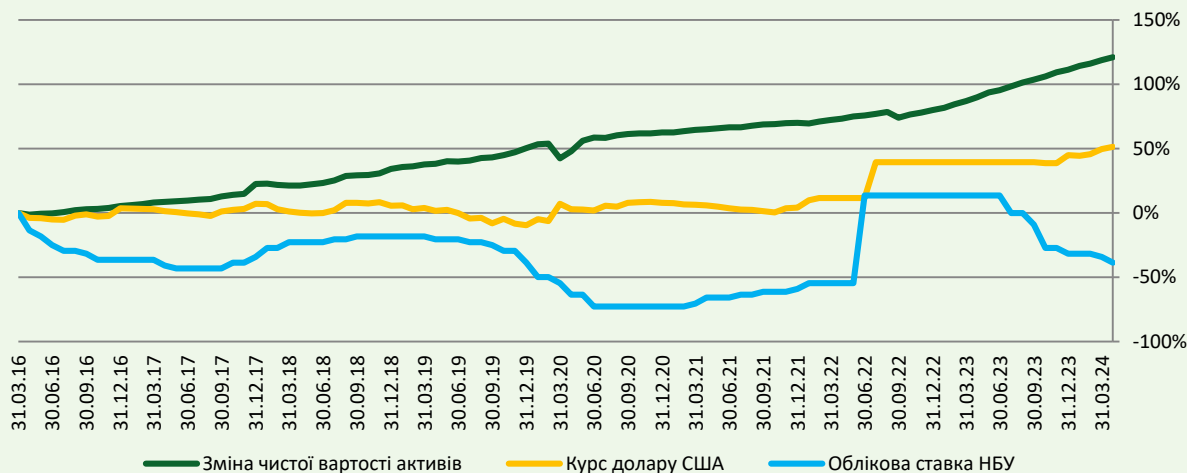


Звіт про результати діяльності КНПФ НБУ станом на 30.04.2024 р. (8/9)

Дохідність цільових активів у валюті інвестиції



Вплив ключових макроекономічних показників на зміну чистої вартості активів



Звіт про результати діяльності КНПФ НБУ станом на 30.04.2024 р. (9/9)

