

Звіт про результати діяльності КНПФ НБУ

Підсумки місяця

У січні 2021 року інвестиційний прибуток КНПФ НБУ склав 2,8 млн грн. Головним чинником фінансового результату став вплив переоцінки за справедливою вартістю портфелю облігацій внутрішньої державної позики (далі – ОВДП).

Облігації внутрішньої державної позики (ОВДП)

Наприкінці січня ціни на ОВДП зазнали зниження. Внаслідок цього загальний результат від операцій з ОВДП, який складається з нарахованих відсотків, амортизації та переоцінки за справедливою вартістю, склав -3,7 млн грн.

Зазначимо, що портфель ОВДП Фонду сформовано переважно з короткострокових облігацій і він утримується до погашення, а відтак загальний дохід від ОВДП протягом строку їхнього обігу залишається незмінним. Залежно від коливання ринкових цін змінюється лише його помісячний розподіл.

Депозити

Загальний дохід від операцій із банківськими вкладками в січні склав 5,9 млн грн. При цьому відсоткові доходи становили 6,4 млн грн, а переоцінка депозитів за справедливою вартістю за рахунок відмінностей між ставками розміщення та поточними ринковими ставками склала -0,5 млн грн.

Корпоративні облігації

У звітному місяці портфель корпоративних облігацій заробив 666 тис. грн відсоткового доходу.

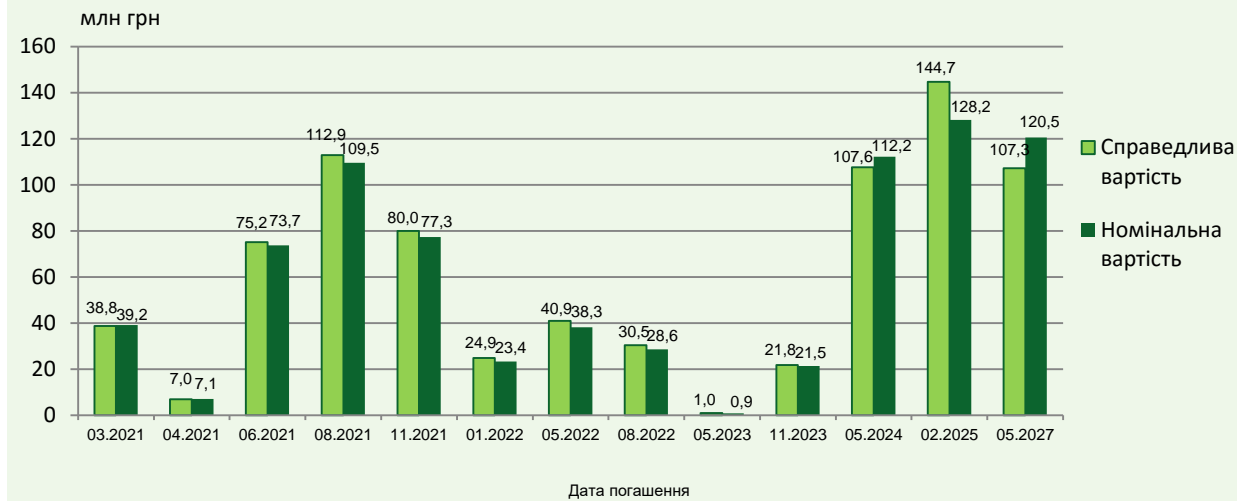
Нерухомість

Фінансовий результат від здавання в оренду нерухомості, з урахуванням сплачених податків, становив у січні 106 тис. грн.

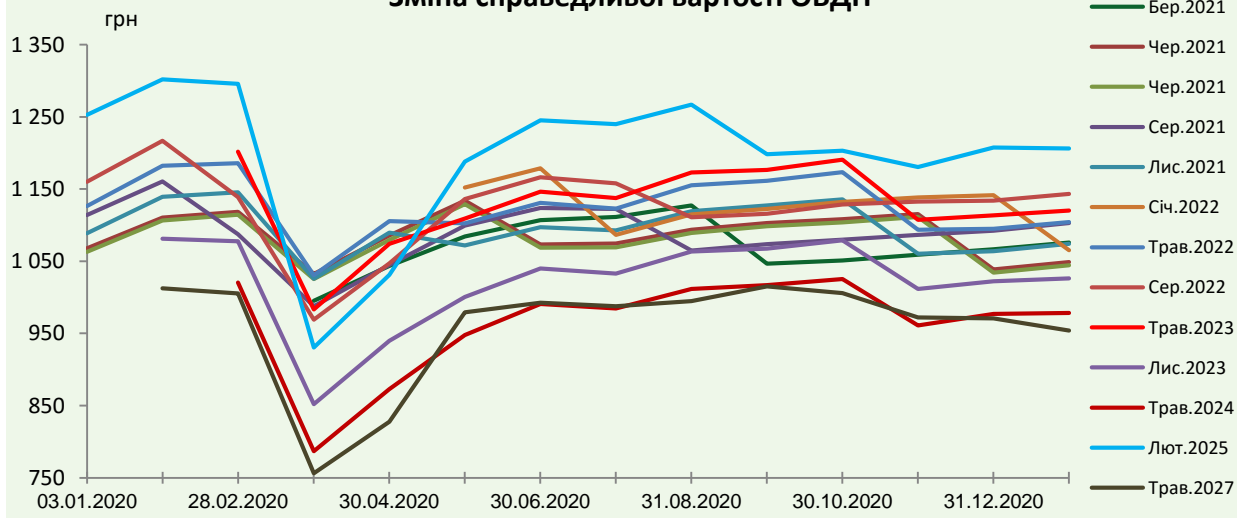
| Стаття доходів/витрат | Січень | Наростаючим підсумком |
|---|----------------|-----------------------|
| <i>Зміна справедливої вартості депозитів за рахунок використання методу ДГП</i> | 6 431 | 6 431 |
| <i>Зміна справедливої вартості депозитів за рахунок нарахованих доходів</i> | (533) | (533) |
| Депозити | 5 898 | 5 898 |
| <i>Зміна справедливої вартості ОВДП за рахунок переоцінки</i> | (12 556) | (12 556) |
| <i>Зміна справедливої вартості ОВДП за рахунок нарахованих доходів</i> | 8 836 | 8 836 |
| ОВДП | (3 721) | (3 721) |
| <i>Зміна справедливої вартості корпоративних облігацій за рахунок нарахованих доходів</i> | 666 | 666 |
| Корпоративні облігації | 666 | 666 |
| <i>Доходи від оренди нерухомості</i> | 106 | 106 |
| <i>Майнові податки</i> | - | - |
| Нерухомість | 106 | 106 |
| Інші активи | - | - |
| Інвестиційний дохід | 2 950 | 2 950 |
| <i>Послуги з обслуговування активів</i> | - | - |
| <i>Аудиторські послуги</i> | (181) | (181) |
| <i>Послуги оцінювача</i> | 1 | 1 |
| <i>Юридичні послуги</i> | - | - |
| Адміністративні витрати | (180) | (180) |
| Інші доходи/витрати | - | - |
| Прибуток (збиток) | 2 769 | 2 769 |

Звіт про результати діяльності КНПФ НБУ

Справедлива та номінальна вартість ОВДП

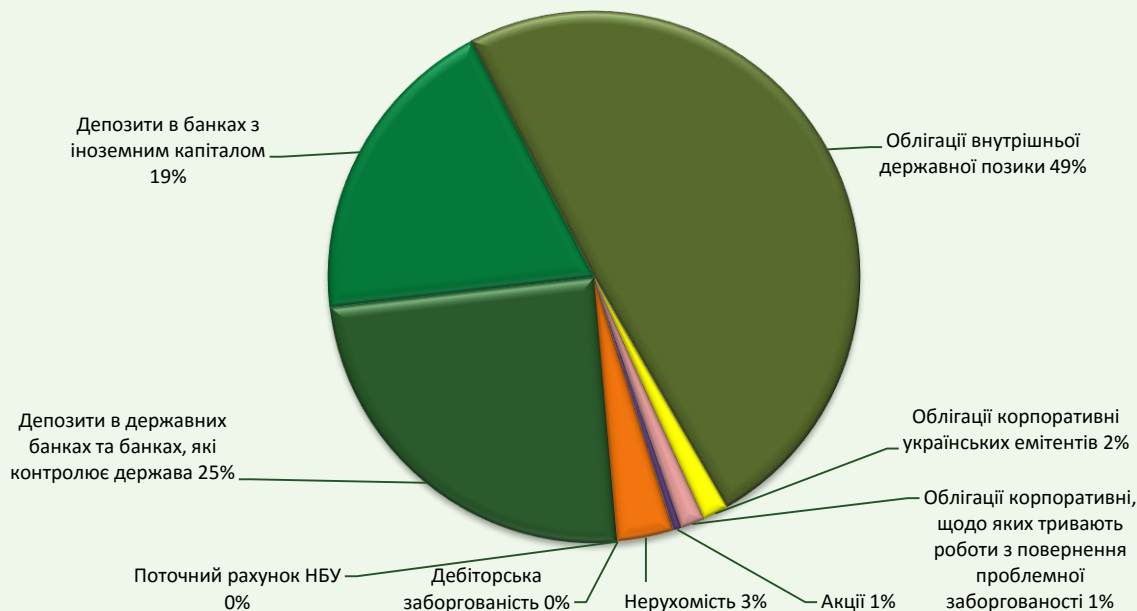


Зміна справедливої вартості ОВДП



Звіт про результати діяльності КНПФ НБУ

Структура активів



| Вид активу | Валюта | Номинальна вартість активів | Вартість активів | Питома вага у портфелі |
|--|--------|-----------------------------|------------------|------------------------|
| Поточний рахунок НБУ | UAH | 499 | 499 | 0,0% |
| Депозити в державних банках та банках, які контролює держава | UAH | 390 320 | 394 264 | 24,5% |
| Депозити в банках з іноземним капіталом | UAH | 307 811 | 308 272 | 19,2% |
| Всього грошові кошти | | 698 631 | 703 036 | 43,8% |
| Облігації внутрішньої державної позики | UAH | 780 400 | 792 596 | 49,3% |
| Облігації корпоративні українських емітентів | UAH | 25 219 | 25 219 | 1,6% |
| Облігації корпоративні українських емітентів, щодо яких тривають роботи з повернення проблемної заборгованості | UAH | 23 509 | 23 509 | 1,5% |
| Всього облігації | | 829 128 | 841 325 | 52,4% |
| Всього акції | | 7 653 | 7 653 | 0,5% |
| Всього нерухомість | | 54 753 | 54 753 | 3,4% |
| Всього дебіторська заборгованість | | 22 | 22 | 0,0% |
| Всього активи | | 1 590 186 | 1 606 788 | 100% |

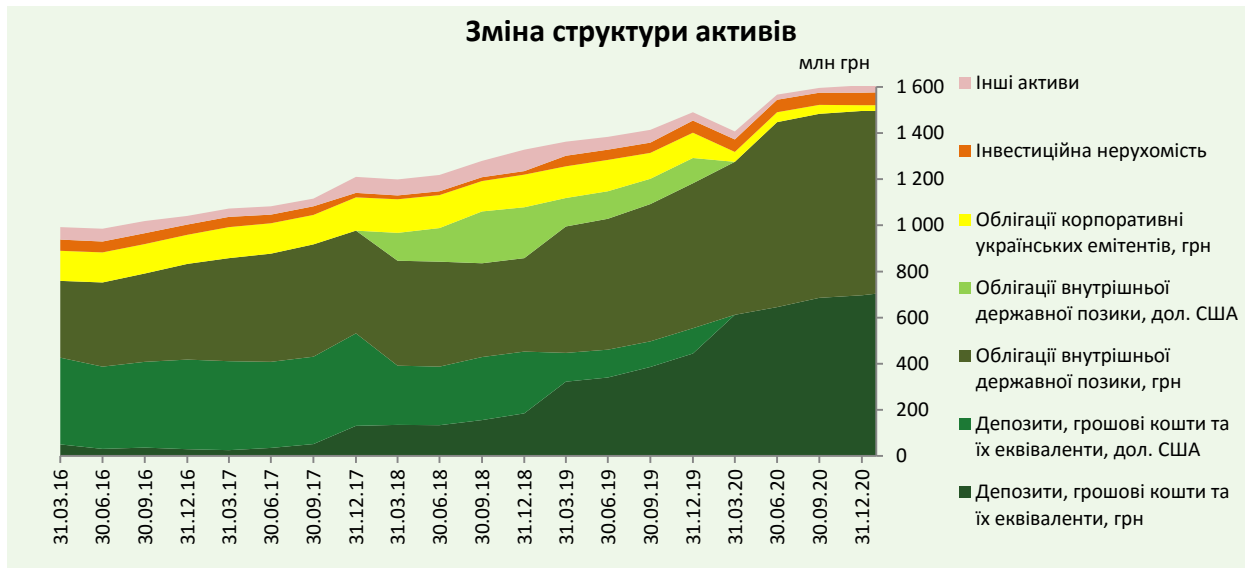
*Примітки:

*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

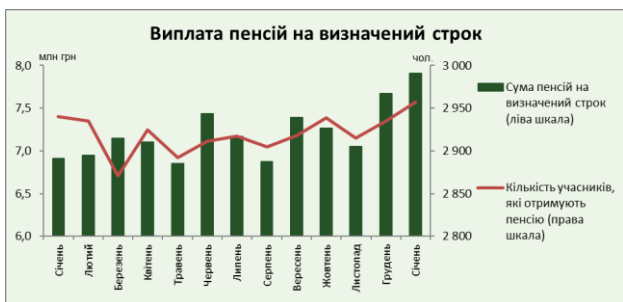
** згідно п.п.6 п.1 ст.49 ЗУ «Про недержавне пенсійне забезпечення» заборонено придбавати або додатково інвестувати в цінні папери, доходи за якими гарантовано Кабінетом Міністрів України, більш як 50% загальної вартості пенсійних активів

Джерело: Департамент з управління діяльністю КНПФ НБУ. Дані у тис. грн, станом на 31.01.2021.

Звіт про результати діяльності КНПФ НБУ



Звіт про результати діяльності КНПФ НБУ



***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 31.01.2021.