

Звіт про результати діяльності КНПФ НБУ

Підсумки місяця

У січні 2023 року фінансовий результат КНПФ НБУ становив 18,3 млн грн. Цього місяця доходи Фонду переважно було сформовано з нарахованих та отриманих відсотків за банківськими вкладками. Див. також нижче коментар щодо впровадження воєнного стану в Україні.

Облігації внутрішньої державної позики (ОВДП)

Протягом січня ставки дохідності ОВДП рухалися різнонаправлено: користувалися попитом переважно цінні папери з терміном погашення до 1 року; водночас, на тлі слабкого попиту, відсоткові ставки за ОВДП з терміном погашення більше 2 років дещо зросли, що, у свою чергу, негативно вплинуло на переоцінку портфелю ОВДП КНПФ НБУ. Так, у звітному місяці переоцінка становила -6,5 млн грн, при цьому відсоткові доходи за ОВДП склали 10 млн грн. Відтак, сукупні доходи портфелю ОВДП Фонду в січні становили 3,5 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

За останні місяці відсоткові ставки за короткостроковими банківськими вкладками в сегменті великих корпоративних вкладників ймовірно досягли свого локального максимуму і стабілізувалися біля позначки 19% річних.

У звітному місяці відсоткові доходи портфелю депозитів Фонду склали 11,2 млн грн, а переоцінка депозитів за справедливою вартістю становила 3,7 млн грн. Таким чином, сукупний дохід від операцій з банківськими вкладками у січні склав 14,9 млн грн.

Нерухомість

Фінансовий результат від здавання в оренду інвестиційної нерухомості Фонду становив у січні 132 тис. грн.

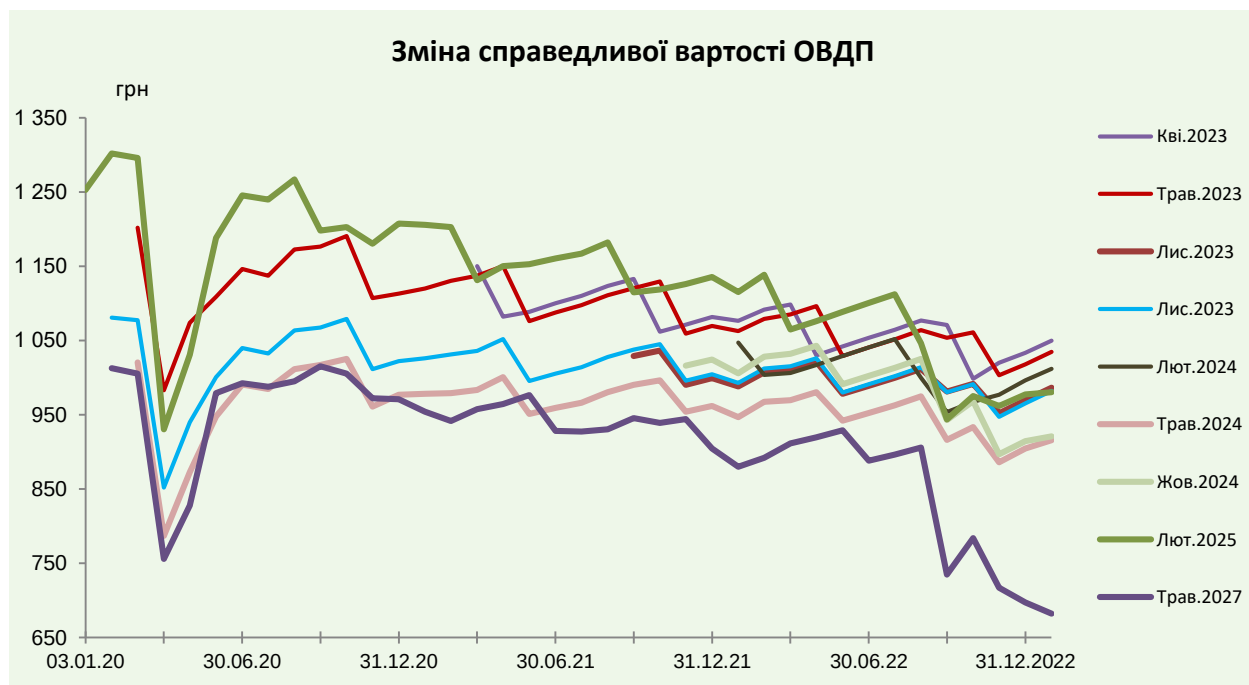
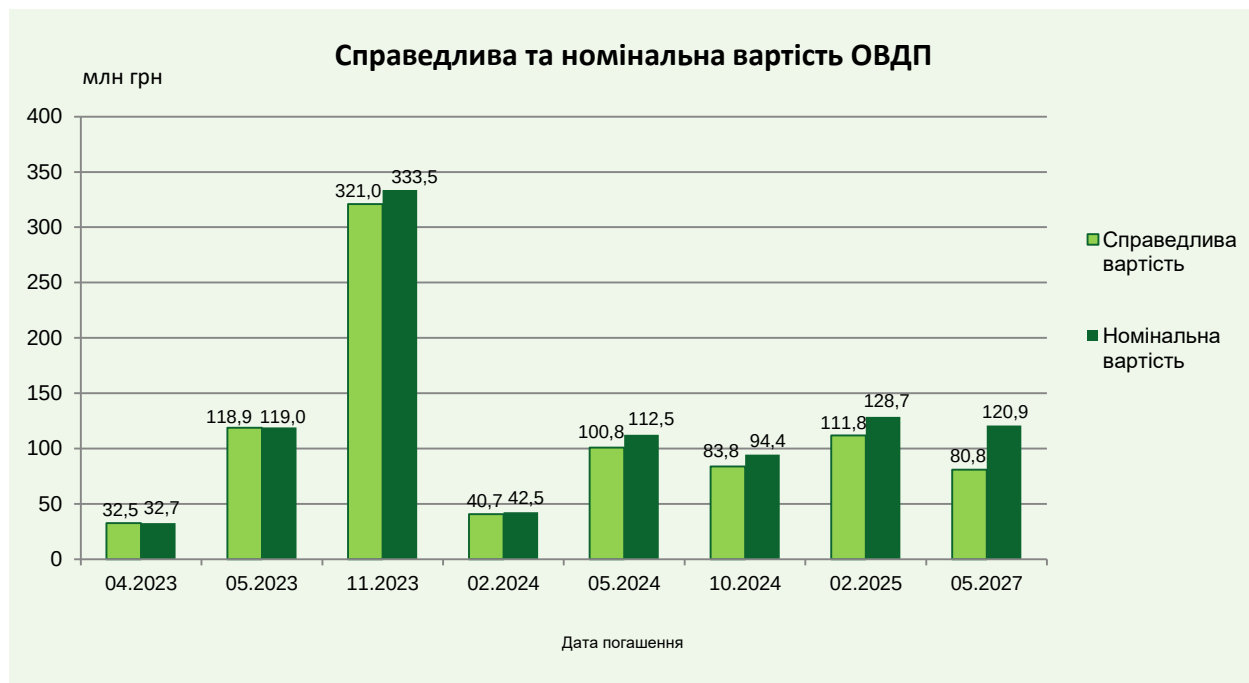
Коментар щодо впровадження воєнного стану в Україні

Повідомляємо, що з огляду на впровадження воєнного стану в Україні, при інвестуванні пенсійних активів фонду перевага надається розміщенню коштів на короткострокові депозитні вклади, а також інвестуванню в короткострокові 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

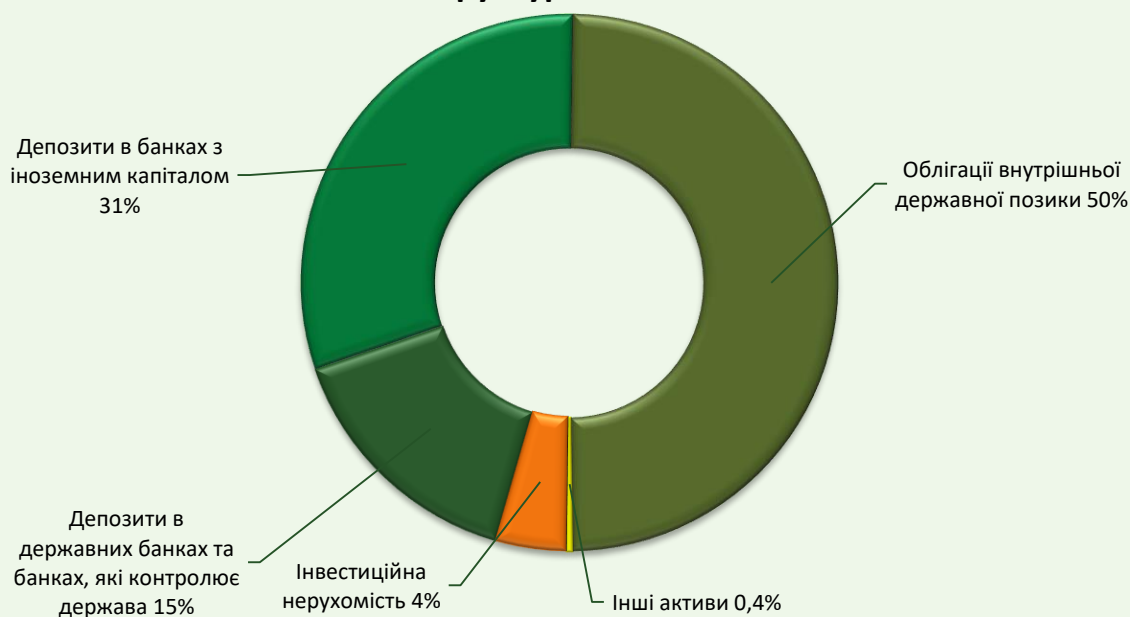
Стаття доходів/витрат	Січень	Наростаючим підсумком
<i>Зміна справедливої вартості депозитів за рахунок використання методу ДГП</i>	3 695	3 695
<i>Зміна справедливої вартості депозитів за рахунок нарахованих доходів</i>	11 183	11 183
Депозити	14 879	14 879
<i>Зміна справедливої вартості ОДВП за рахунок переоцінки</i>	(6 536)	(6 536)
<i>Зміна справедливої вартості ОДВП за рахунок нарахованих доходів</i>	10 067	10 067
ОВДП	3 531	3 531
<i>Доходи від оренди інвестиційної нерухомості</i>	132	132
Інвестиційна нерухомість	132	132
Інші активи	-	-
Інвестиційний дохід	18 542	18 542
<i>Аудиторські послуги</i>	(237)	(237)
Адміністративні витрати	(237)	(237)
Інші доходи/витрати	-	-
Прибуток (збиток)	18 305	18 305

Звіт про результати діяльності КНПФ НБУ



Звіт про результати діяльності КНПФ НБУ

Структура активів



Вид активу	Валюта	Номинальна вартість активів	Вартість активів	Питома вага у портфелі
Поточний рахунок	UAH	328	328	0,0%
Депозити в державних банках та банках, які контролює держава	UAH	272 781	275 331	15,3%
Депозити в банках з іноземним капіталом	UAH	545 819	547 381	30,5%
Всього грошові кошти		818 929	823 040	45,8%
Облігації внутрішньої державної позики	UAH	984 280	890 366	49,6%
Всього облігації		984 280	890 366	49,6%
Всього акції		6 987	6 987	0,4%
Всього інвестиційна нерухомість		76 339	76 339	4,2%
Всього дебіторська заборгованість		39	39	0,0%
Всього активи		1 886 574	1 796 771	100%

***Примітки:**

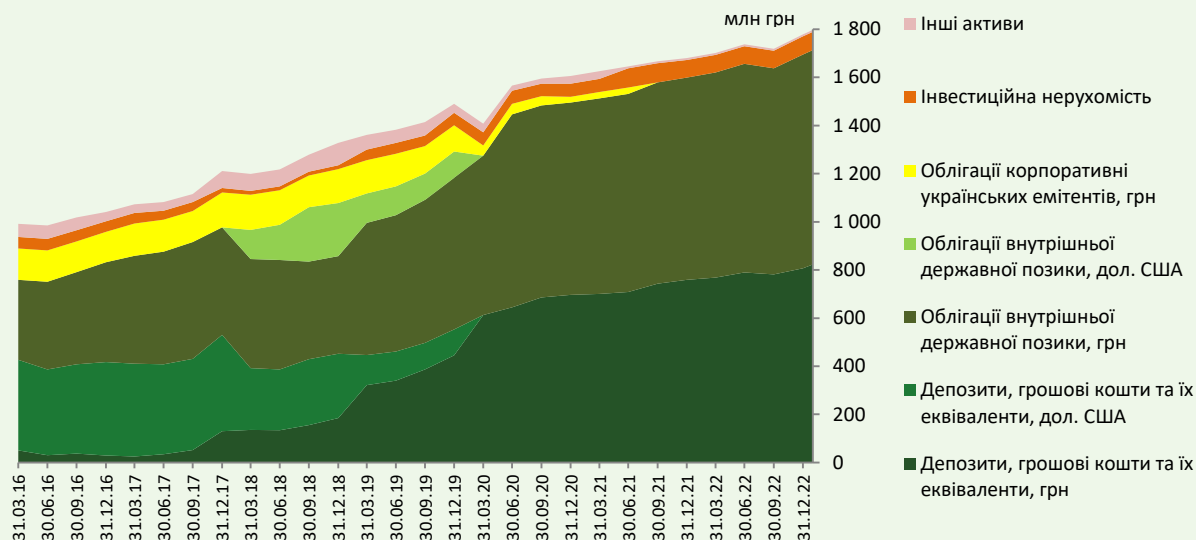
*згідно п.п.4 п.1 ст.49 ЗУ «Про недержавне пенсійне забезпечення» заборонено розмішувати на банківських депозитних рахунках у грошових коштах та в ощадних сертифікатах банків більш як 50% загальної вартості пенсійних активів

** 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

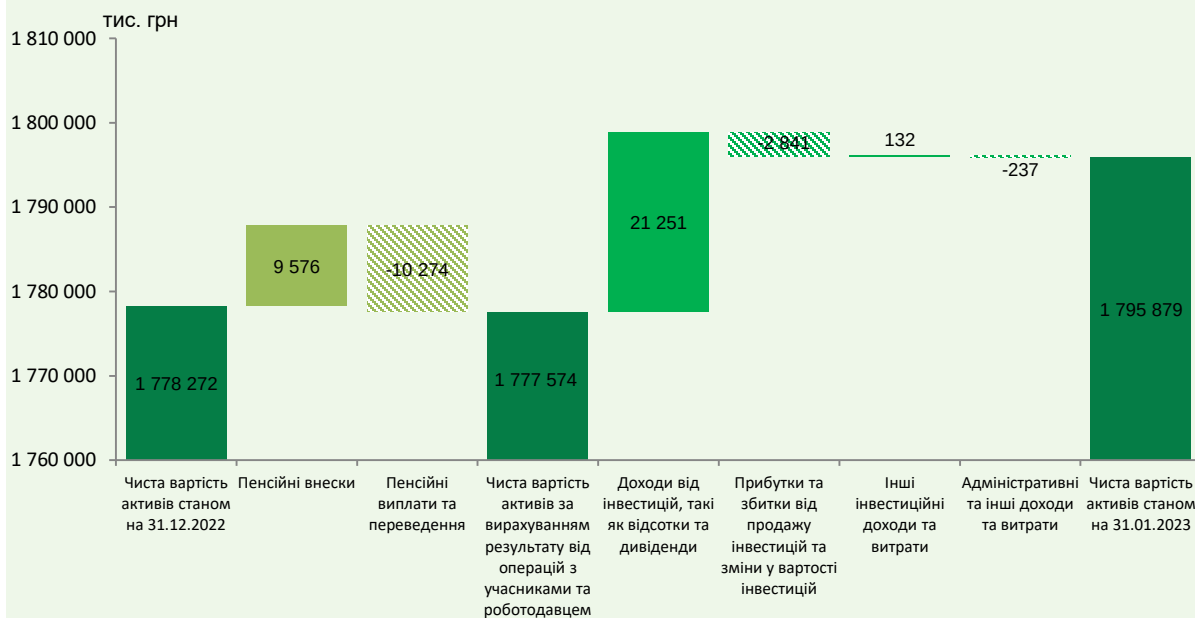
Джерело: Департамент з управління діяльністю КНПФ НБУ. Дані у тис. грн, станом на 31.01.2023.

Звіт про результати діяльності КНПФ НБУ

Зміна структури активів



Зміна чистої вартості активів



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 31.01.2023.