

Звіт про результати діяльності КНПФ НБУ станом на 31.07.2024 р. (1/9)

Інвестиційний коментар станом на 31 липня 2024 року

У липні 2024 року фінансовий результат КНПФ НБУ становив 27,5 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.

ОВДП

У звітному місяці ціни на ринку ОВДП були майже незмінними. Ставки дохідності вторинного ринку залишалися близькими до рівнів первинного ринку, де найбільшим попитом користувалися державні цінні папери із залишковим строком обігу від 1 до 2 років. У липні переоцінка портфелю ОВДП, які належать КНПФ НБУ, становила 3 млн грн. Відсоткові доходи за ОВДП у липні склали 14,2 млн грн. Таким чином, сукупні доходи портфелю ОВДП у звітному місяці становили 17,2 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 звітному місяці відсоткові ставки за банківськими вкладками в сегменті великих корпоративних вкладників залишилися на рівні 9-11% річних. У липні відсоткові доходи портфелю депозитів КНПФ НБУ становили 11,3 млн грн, а переоцінка депозитів за справедливою вартістю склала -1,1 млн грн. Таким чином, загальний дохід від операцій з банківськими вкладками у звітному місяці становив 10,2 млн грн.

Інвестиційна нерухомість

Фінансовий результат від здавання в оренду інвестиційної нерухомості, з урахуванням сплачених податків, у липні 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.

Корисні посилання

На нашу думку, матеріали, розташовані за наведеними нижче посиланнями, можуть бути Вам корисними для кращого розуміння чинників, які впливають на прийняття рішень щодо управління пенсійними активами Фонду.

Звіт про результати діяльності КНПФ НБУ станом на 31.07.2024 р. (2/9)

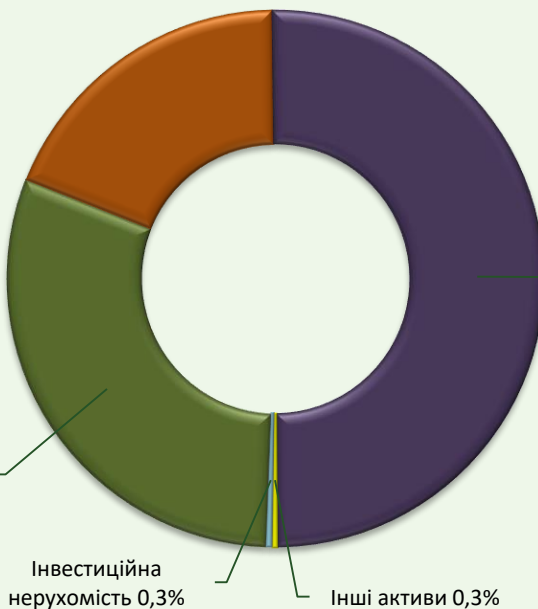
Стаття доходів/витрат	Липень	Наростаючим підсумком
<i>Зміна справедливої вартості депозитів за рахунок використання методу ДГП</i>	(1 138)	2 947
<i>Зміна справедливої вартості депозитів за рахунок нарахованих доходів</i>	11 342	82 151
Депозити	10 204	85 098
<i>Зміна справедливої вартості ОДВП за рахунок переоцінки</i>	2 967	42 999
<i>Зміна справедливої вартості ОДВП за рахунок нарахованих доходів</i>	14 273	93 180
ОВДП	17 240	136 179
<i>Доходи від оренди інвестиційної нерухомості</i>	120	840
<i>Майнові податки</i>	(15)	(105)
Інвестиційна нерухомість	105	735
<i>Доходи від переоцінки акцій</i>	-	26
<i>Дивіденди</i>	-	1 475
Інші активи	-	1 501
Інвестиційний дохід	27 549	223 513
<i>Аудиторські послуги</i>	-	(567)
Адміністративні витрати	-	(567)
Прибуток (збиток)	27 549	222 947

Звіт про результати діяльності КНПФ НБУ станом на 31.07.2024 р. (3/9)

Структура активів

Депозити в банках з іноземним капіталом
19%

Депозити в державних банках та банках, які контролює держава
31%



Облігації внутрішніх державних позик
50%

Інвестиційна нерухомість
0,3%

Інші активи
0,3%

Вид активу	Валюта	Номінальна вартість активів*	Вартість активів	Питома вага у портфелі
Поточний рахунок	UAH	420	420	0,0%
Депозити в державних банках та банках, які контролює держава	UAH	684 799	693 651	30,5%
Депозити в банках з іноземним капіталом	UAH	427 899	427 899	18,8%
Всього грошові кошти		1 113 119	1 121 971	49,3%
Облігації внутрішніх державних позик	UAH	1 134 863	1 140 671	50,1%
Всього облігації		1 134 863	1 140 671	50,1%
Всього акції		7 013	7 013	0,3%
Всього інвестиційна нерухомість		7 678	7 678	0,3%
Всього дебіторська заборгованість		-	-	-
Всього активи		2 262 673	2 277 333	100%

Примітки:

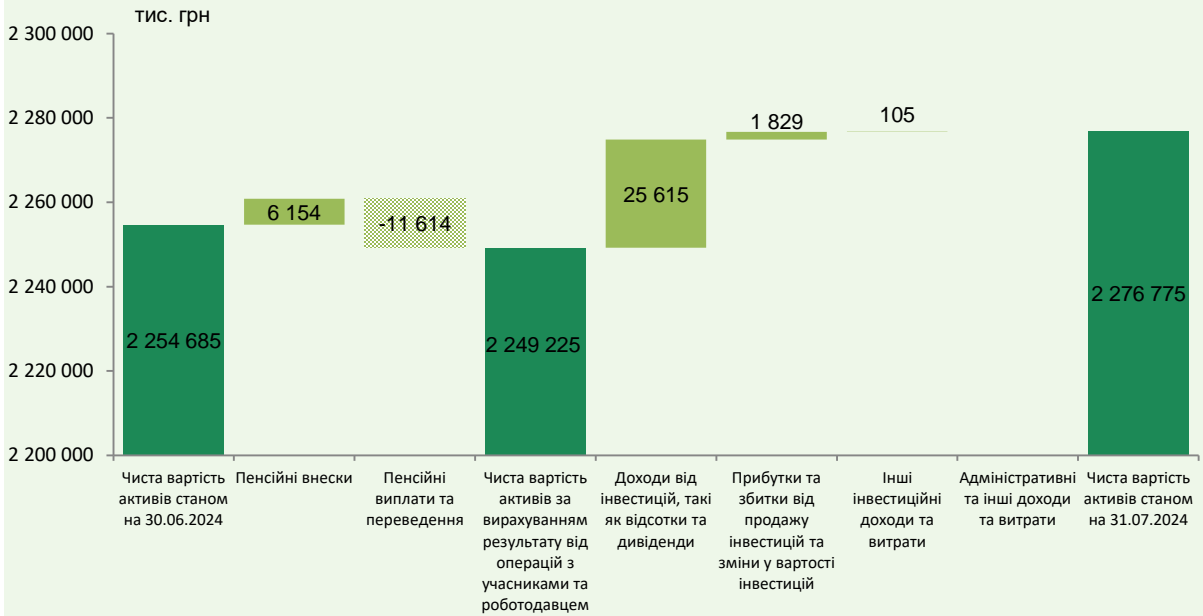
згідно п.п.4 п.1 ст.49 ЗУ «Про недержавне пенсійне забезпечення» заборонено розміщувати на банківських депозитних рахунках у грошових коштах та в ощадних сертифікатах банків більш як 50% загальної вартості пенсійних активів

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

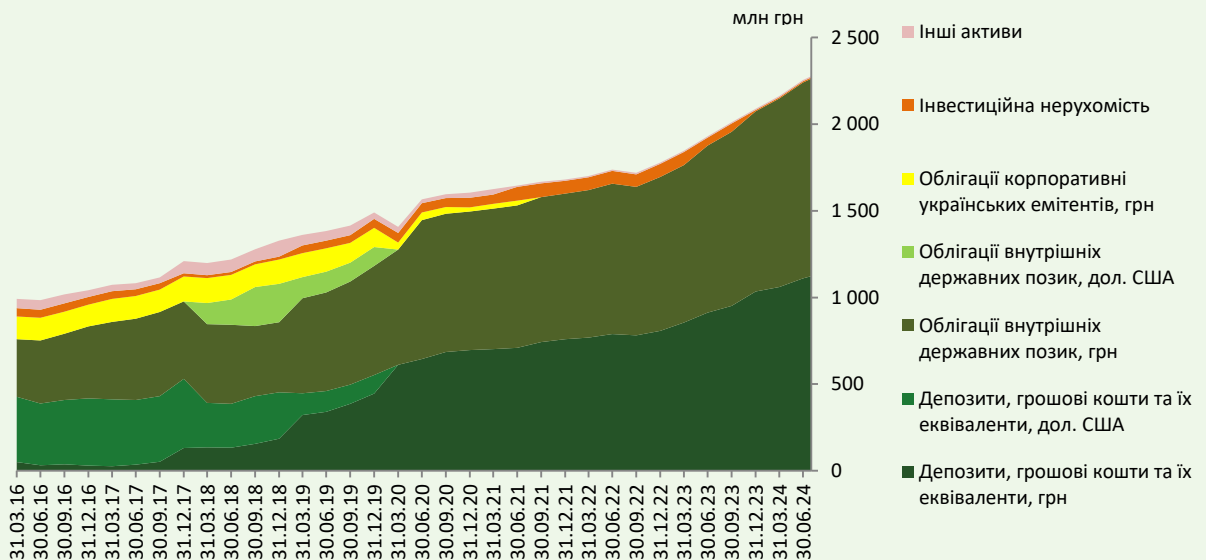
Джерело: Департамент з управління діяльністю КНПФ НБУ. Дані у тис. грн, станом на 31.07.2024.

Звіт про результати діяльності КНПФ НБУ станом на 31.07.2024 р. (4/9)

Декомпозиція зміни чистої вартості активів

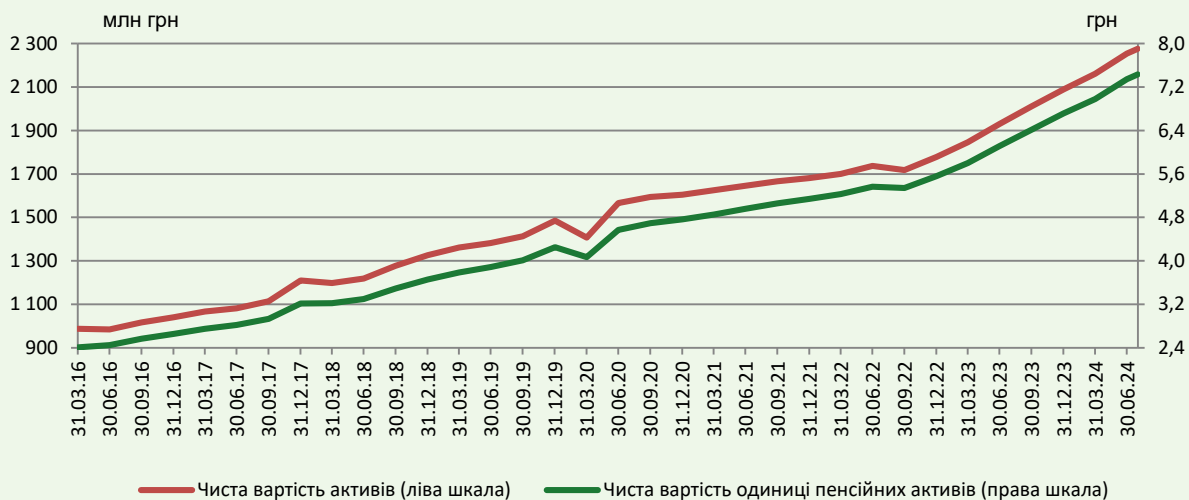


Динаміка структури активів

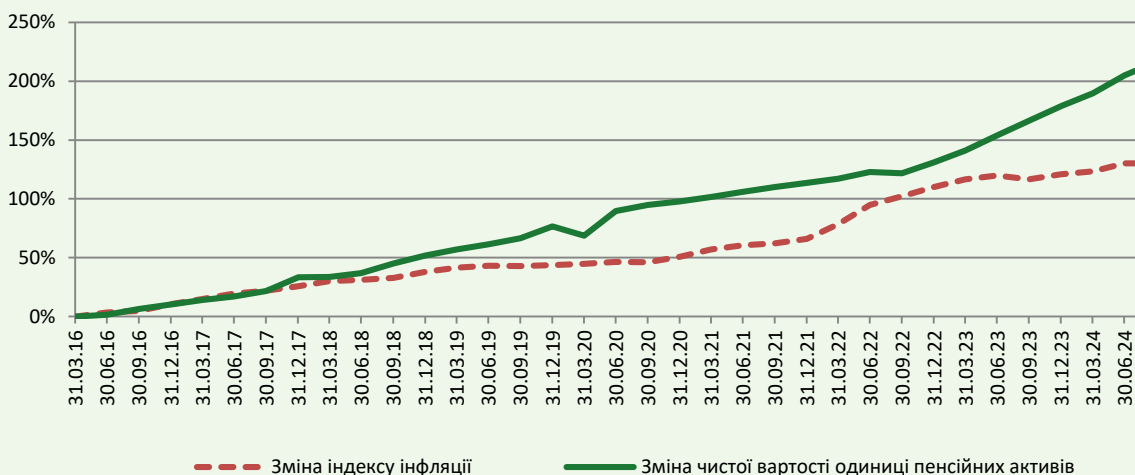


Звіт про результати діяльності КНПФ НБУ станом на 31.07.2024 р. (5/9)

Динаміка чистої вартості активів та одиниці пенсійних активів



Динаміка чистої вартості одиниці пенсійних активів



***Примітки:**

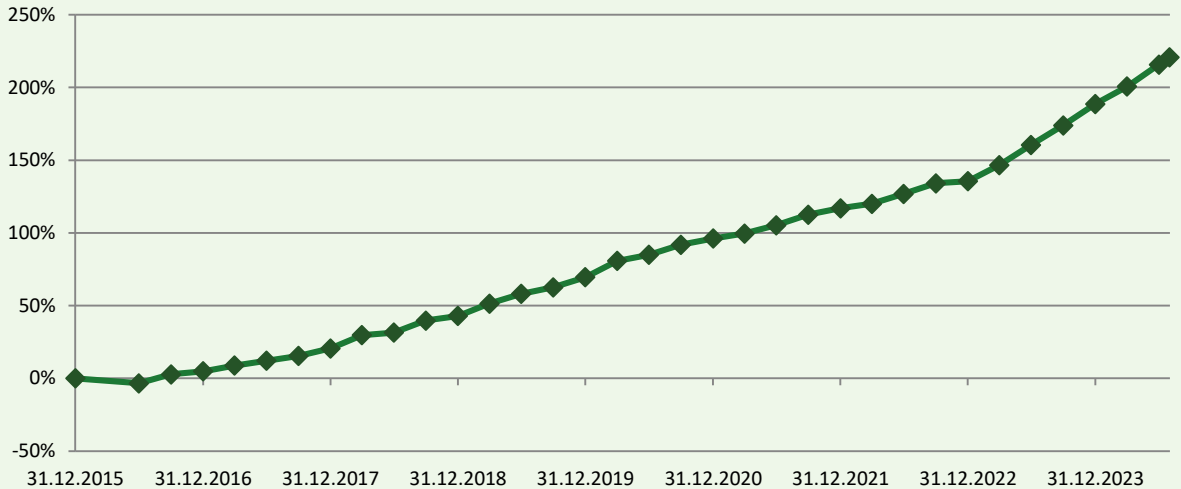
чиста вартість активів пенсійного фонду - різниця між вартістю активів пенсійного фонду на день проведення підрахунку та сумою зобов'язань пенсійного фонду, що підлягають виконанню на день проведення підрахунку.

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.

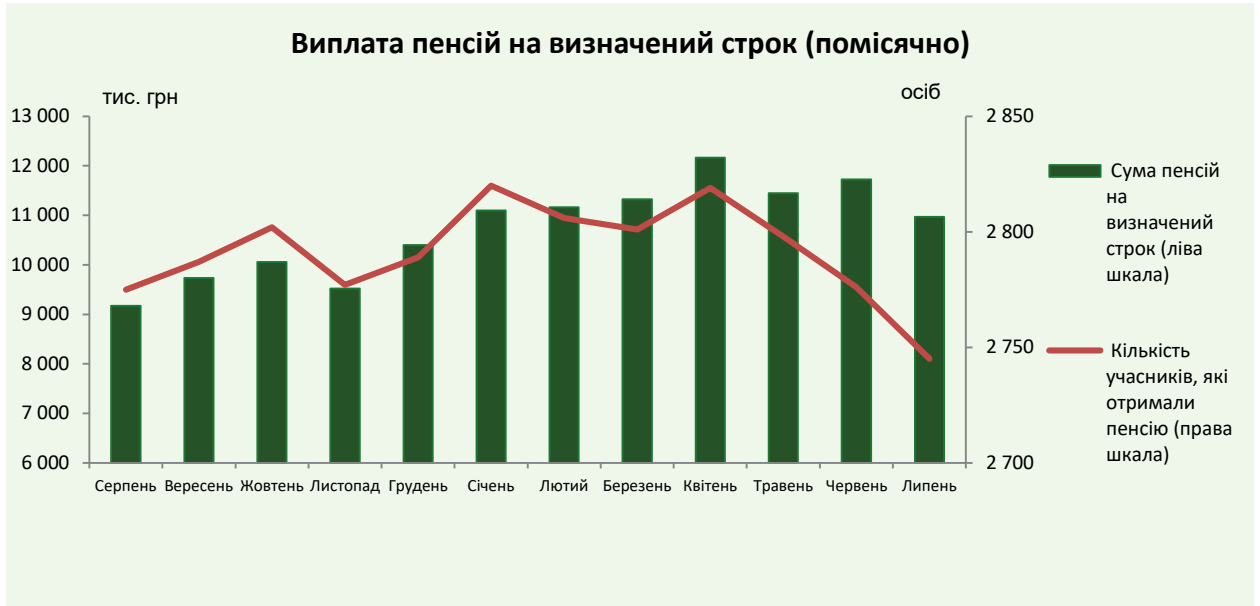
Джерело: Департамент з управління діяльністю КНПФ НБУ, НБУ. Дані станом на 31.07.2024.

Звіт про результати діяльності КНПФ НБУ станом на 31.07.2024 р. (6/9)

Динаміка розміру середньої щомісячної пенсії на визначений строк

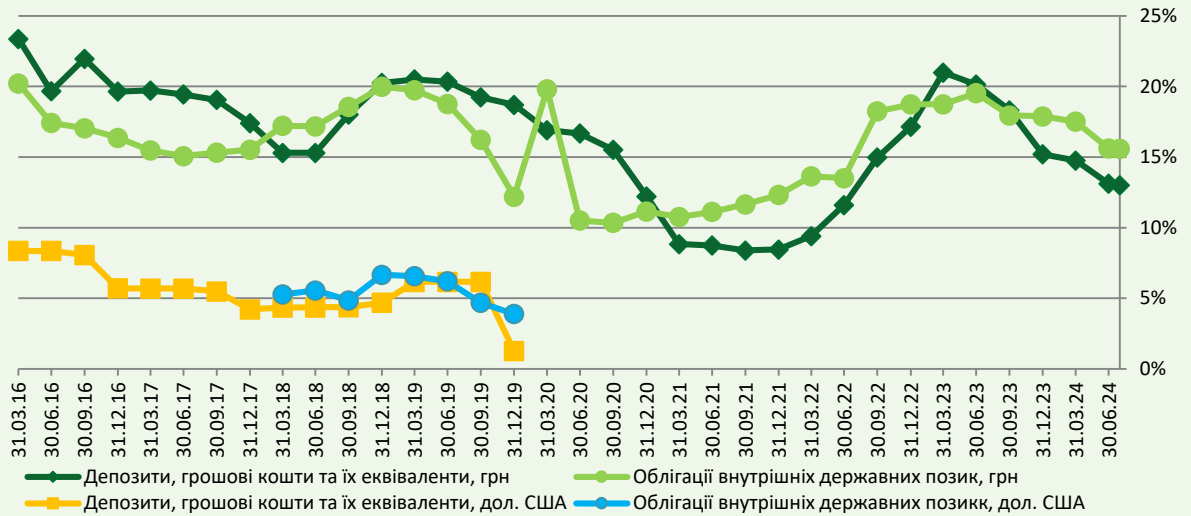


Звіт про результати діяльності КНПФ НБУ станом на 31.07.2024 р. (7/9)

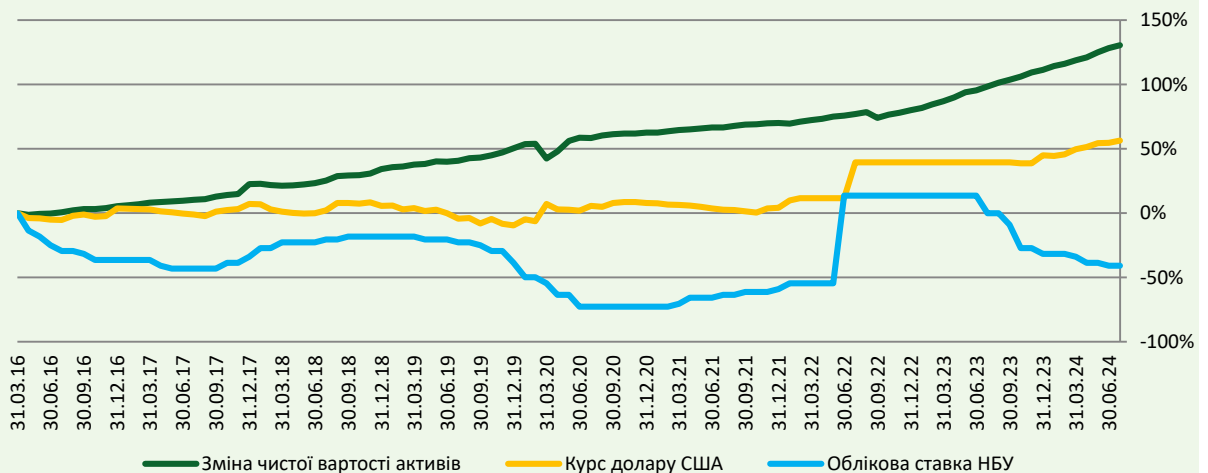


Звіт про результати діяльності КНПФ НБУ станом на 31.07.2024 р. (8/9)

Дохідність цільових активів у валюті інвестиції



Вплив ключових макроекономічних показників на зміну чистої вартості активів



Звіт про результати діяльності КНПФ НБУ станом на 31.07.2024 р. (9/9)

