

# Звіт про результати діяльності КНПФ НБУ станом на 31.10.2024 р. (1/9)

## Інвестиційний коментар станом на 31.10.2024

У жовтні 2024 року фінансовий результат КНПФ НБУ становив 33,2 млн грн. Доходи звітного місяця було переважно сформовано завдяки нарахованим відсоткам портфелю депозитів та облігацій внутрішніх державних позик (далі – ОВДП). Див. також нижче коментар щодо воєнного стану в Україні.

### *ОВДП*

У звітному місяці ціни на ринку ОВДП дещо зросли для гривневих облігацій із залишковим строком обігу більше 1 року. 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 жовтні переоцінка портфелю ОВДП, які належать КНПФ НБУ, становила 6,1 млн грн, а відсоткові доходи склали 15,1 млн грн. Таким чином, сукупні доходи портфелю ОВДП у жовтні становили 21,2 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 10-11% річних. Відтак, у жовтні відсоткові доходи портфелю депозитів КНПФ НБУ становили 10,9 млн грн, а переоцінка депозитів за справедливою вартістю склала 0,1 млн грн. Таким чином, загальний дохід від операцій з банківськими вкладками у звітному місяці становив 11 млн грн.

### *Інвестиційна нерухомість*

У жовтні було реалізовано об'єкт інвестиційної нерухомості, який належав КНПФ НБУ, на суму 8,5 млн грн. Прибуток від продажу (перевищення ціни продажу над балансовою вартістю) склав 0,8 млн грн.

Фінансовий результат від здавання в оренду інвестиційної нерухомості з урахуванням сплачених податків у жовтні становив 76 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*

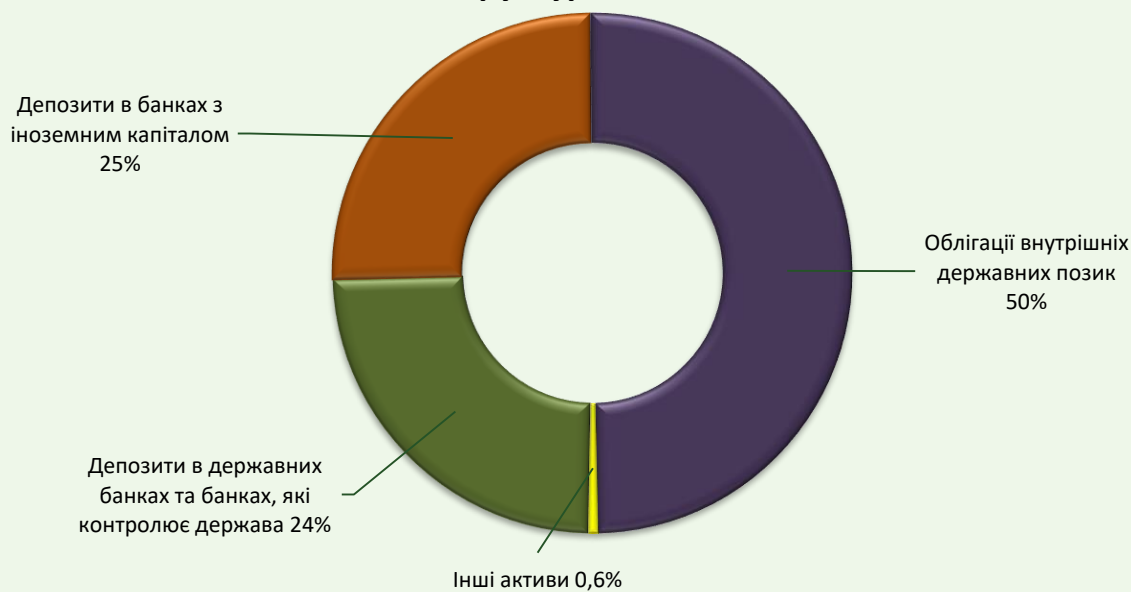
На нашу думку, матеріали, розташовані за наведеними нижче посиланнями, можуть бути Вам корисними для кращого розуміння чинників, які впливають на прийняття рішень щодо управління пенсійними активами Фонду.

# Звіт про результати діяльності КНПФ НБУ станом на 31.10.2024 р. (2/9)

Стаття доходів/витрат	Жовтень	Наростаючим підсумком
<i>Зміна справедливої вартості депозитів за рахунок використання методу ДГП</i>	118	(5 741)
<i>Зміна справедливої вартості депозитів за рахунок нарахованих доходів</i>	10 923	114 973
<b>Депозити</b>	<b>11 040</b>	<b>109 232</b>
<i>Зміна справедливої вартості ОДВП за рахунок переоцінки</i>	6 097	44 247
<i>Зміна справедливої вартості ОДВП за рахунок нарахованих доходів</i>	15 145	136 866
<b>ОВДП</b>	<b>21 242</b>	<b>181 114</b>
<i>Доходи від оренди інвестиційної нерухомості</i>	85	1 165
<i>Фінансовий результат від продажу нерухомості</i>	823	823
<i>Майнові податки</i>	(9)	(145)
<b>Інвестиційна нерухомість</b>	<b>899</b>	<b>1 844</b>
<i>Доходи від переоцінки акцій</i>	-	26
<i>Дивіденди</i>	-	1 475
<b>Інші активи</b>	-	<b>1 501</b>
<b>Інвестиційний дохід</b>	<b>33 181</b>	<b>293 690</b>
<i>Аудиторські послуги</i>	-	(567)
<i>Юридичні послуги</i>	-	(120)
<b>Адміністративні витрати</b>	-	<b>(687)</b>
<i>Доходи від переоцінки/відшкодування дебіторської заборгованості</i>	-	131
<b>Інші доходи/витрати</b>	-	<b>131</b>
<b>Прибуток (збиток)</b>	<b>33 181</b>	<b>293 134</b>

# Звіт про результати діяльності КНПФ НБУ станом на 31.10.2024 р. (3/9)

## Структура активів



Вид активу	Валюта	Номінальна вартість активів*	Вартість активів	Питома вага у портфелі
Поточний рахунок	UAH	7 330	7 330	0,3%
Депозити в державних банках та банках, які контролює держава	UAH	566 803	566 966	24,3%
Депозити в банках з іноземним капіталом	UAH	588 998	588 998	25,3%
<b>Всього грошові кошти</b>		<b>1 163 131</b>	<b>1 163 294</b>	<b>49,9%</b>
Облігації внутрішніх державних позик	UAH	1 151 134	1 159 465	49,8%
<b>Всього облігації</b>		<b>1 151 134</b>	<b>1 159 465</b>	<b>49,8%</b>
<b>Всього акції</b>		<b>7 013</b>	<b>7 013</b>	<b>0,3%</b>
<b>Всього активи</b>		<b>2 321 278</b>	<b>2 329 772</b>	<b>100%</b>

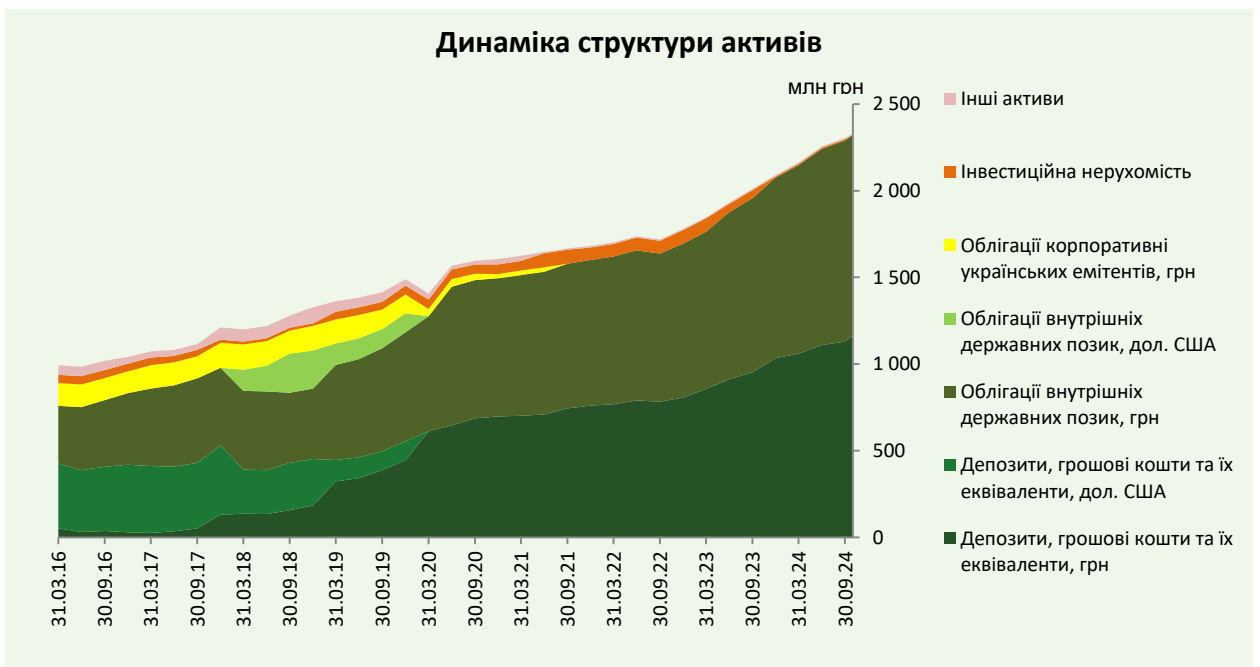
### Примітки:

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

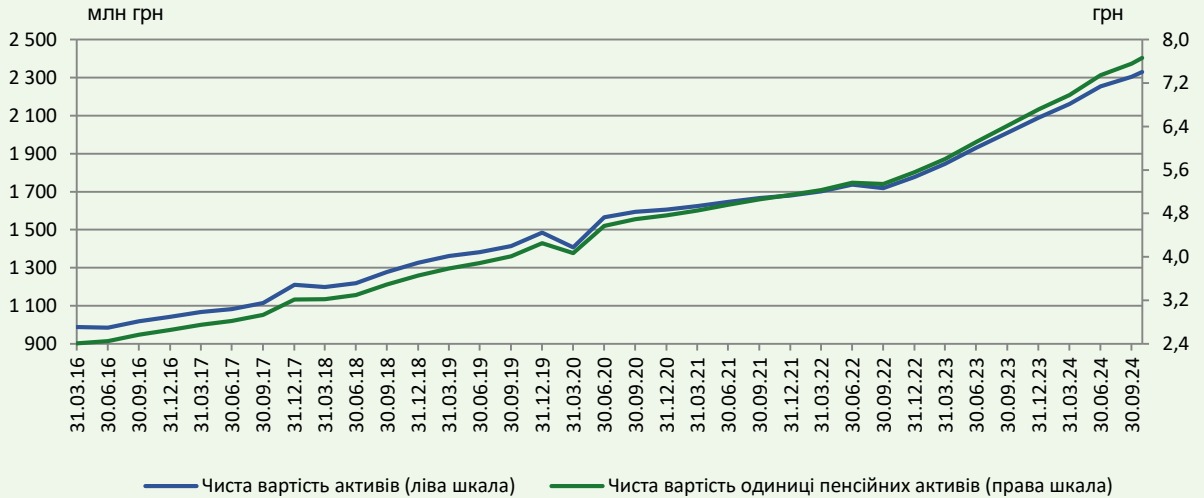
Джерело: Департамент з управління діяльністю КНПФ НБУ. Дані у тис. грн, станом на 31.10.2024.

# Звіт про результати діяльності КНПФ НБУ станом на 31.10.2024 р. (4/9)

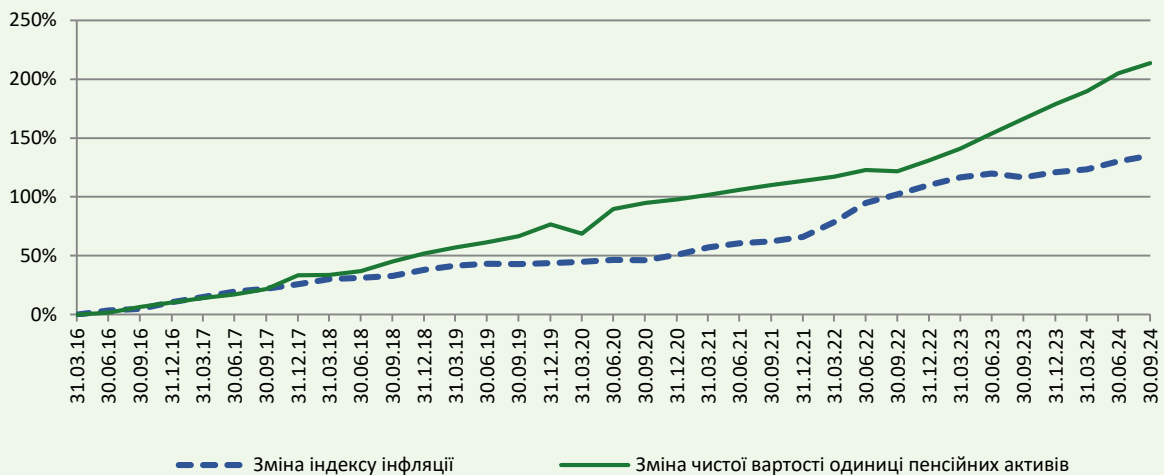


# Звіт про результати діяльності КНПФ НБУ станом на 31.10.2024 р. (5/9)

## Динаміка чистої вартості активів та одиниці пенсійних активів



## Динаміка чистої вартості одиниці пенсійних активів



**\*Примітки:**

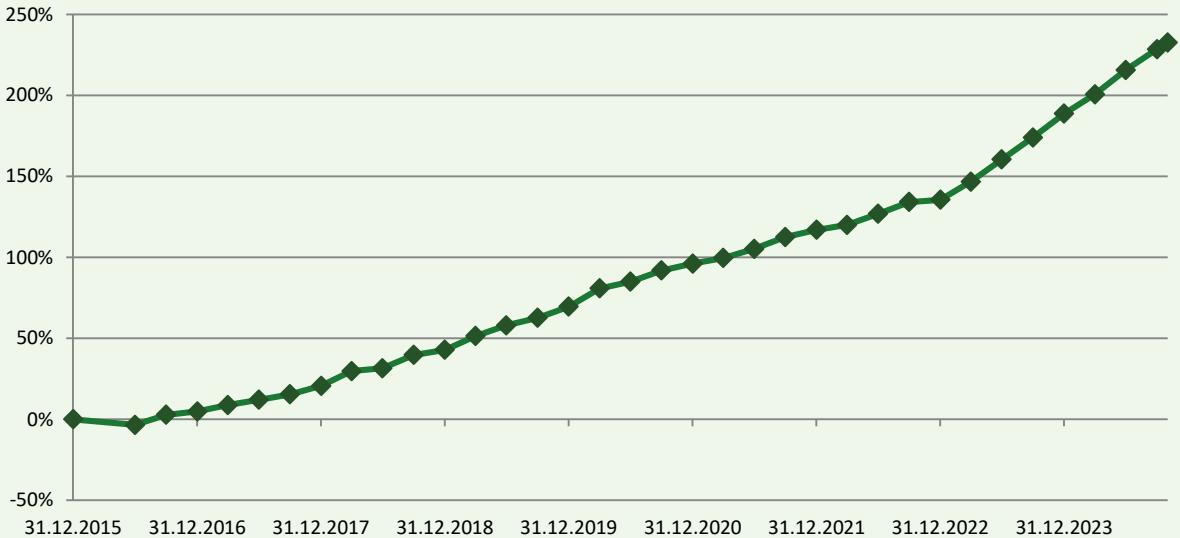
чиста вартість активів пенсійного фонду - різниця між вартістю активів пенсійного фонду на день проведення підрахунку та сумою зобов'язань пенсійного фонду, що підлягають виконанню на день проведення підрахунку.

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.

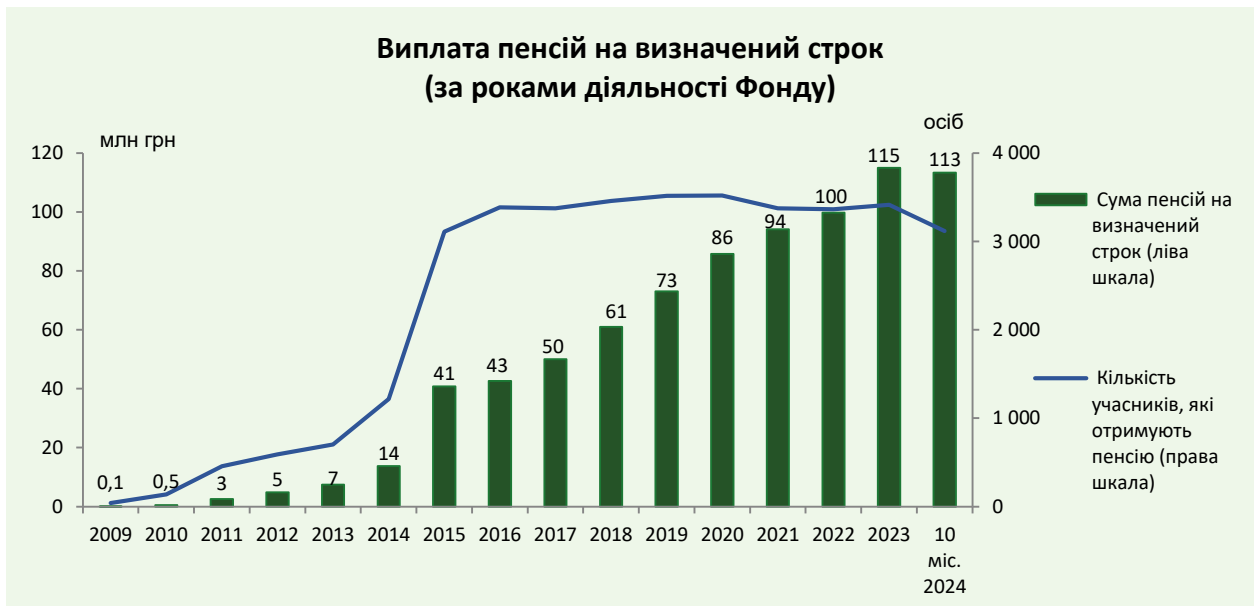
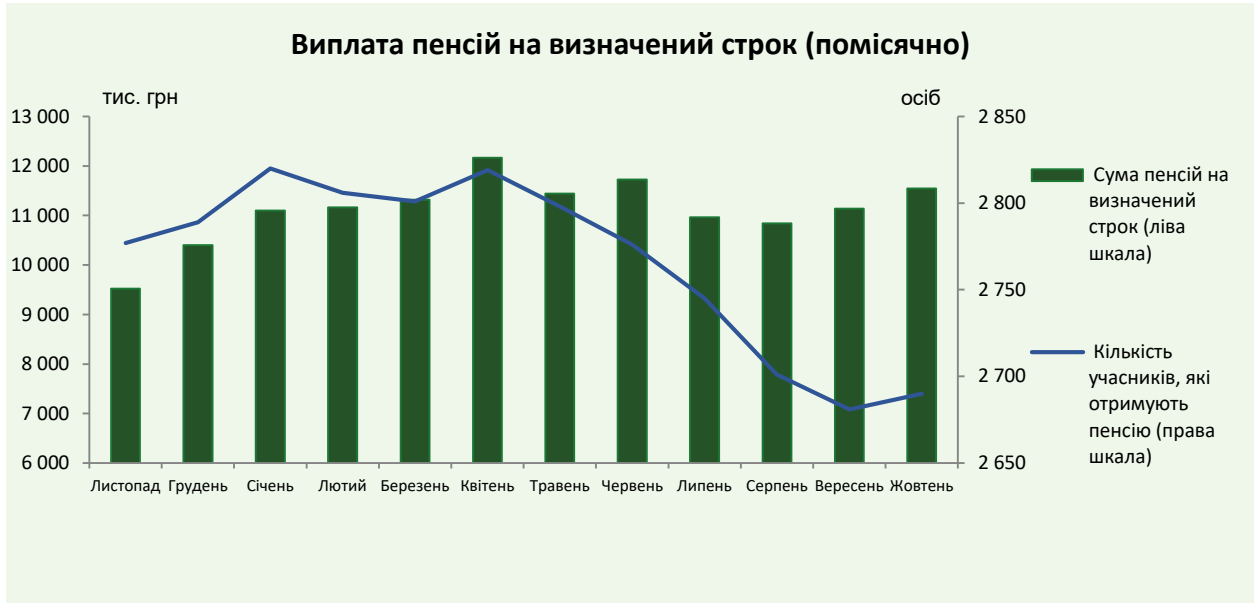
Джерело: Департамент з управління діяльністю КНПФ НБУ, НБУ. Дані станом на 31.10.2024.

# Звіт про результати діяльності КНПФ НБУ станом на 31.10.2024 р. (6/9)

Динаміка розміру середньої щомісячної пенсії на визначений строк

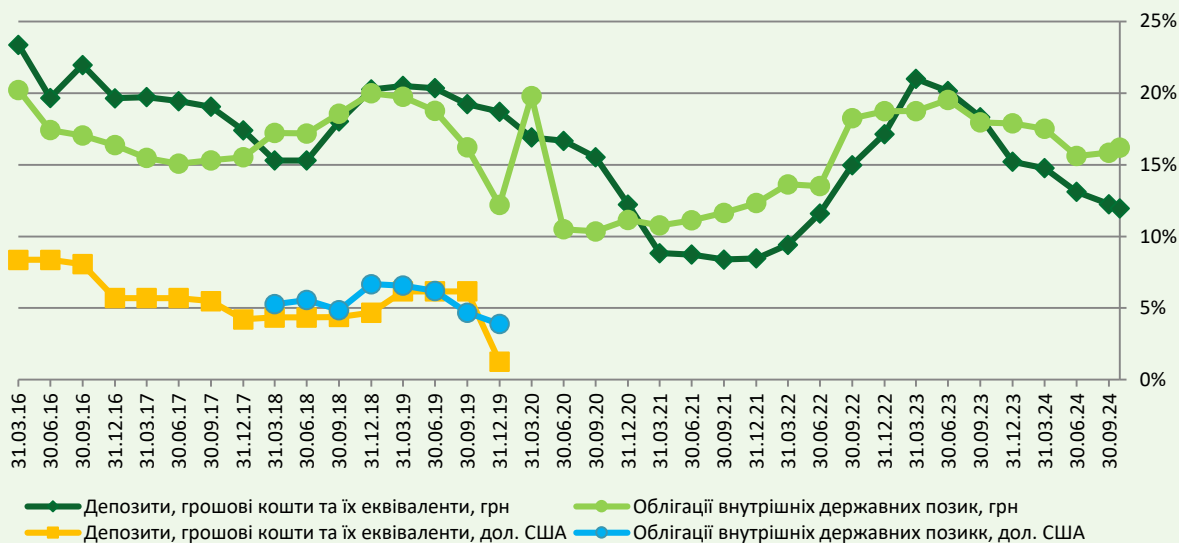


# Звіт про результати діяльності КНПФ НБУ станом на 31.10.2024 р. (7/9)

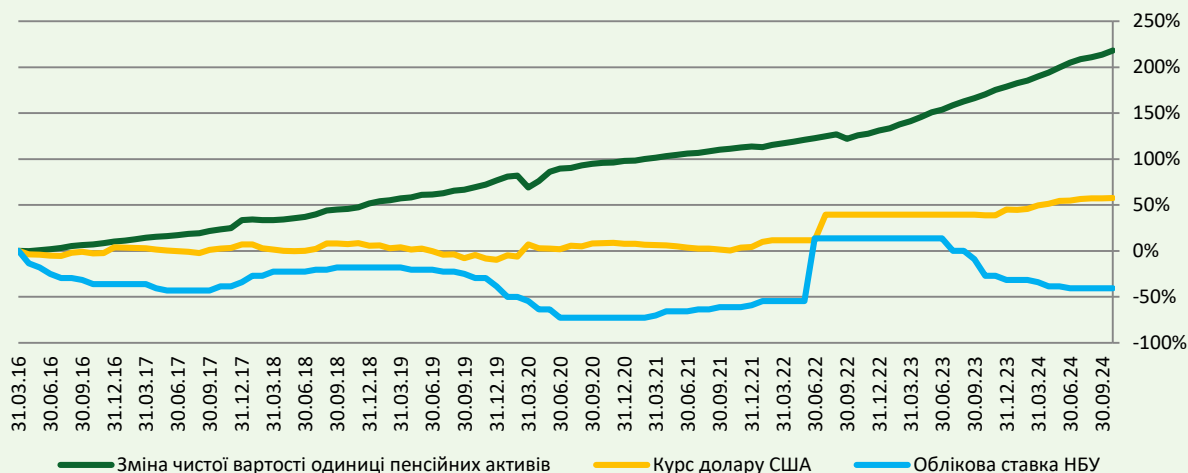


# Звіт про результати діяльності КНПФ НБУ станом на 31.10.2024 р. (8/9)

## Дохідність цільових активів у валюті інвестиції



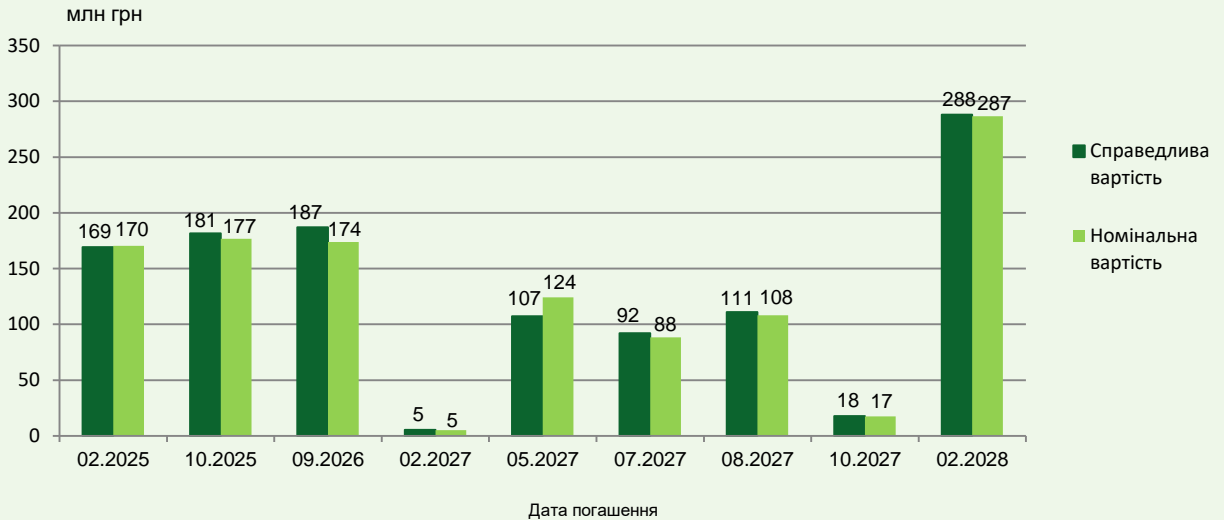
## Вплив ключових макроекономічних показників на зміну чистої вартості одиниці пенсійних активів





# Звіт про результати діяльності КНПФ НБУ станом на 31.10.2024 р. (9/9)

## Справедлива та номінальна вартість ОВДП



## Динаміка справедливої вартості ОВДП

