

Звіт про результати діяльності КНПФ НБУ

Підсумки місяця

У жовтні 2020 року фінансовий результат КНПФ НБУ (далі - Фонд) склав 8,7 млн грн. У звітному місяці основним чинником зростання вартості активів Фонду були відсоткові доходи за банківськими вкладками.

Облігації внутрішньої державної позики (ОВДП)

Прибуток від портфелю облігацій внутрішньої державної позики (далі – ОВДП) у жовтні склав 3,4 млн грн. Після зростання влітку, ціни на ОВДП восени дещо знизилися на тлі невизначеності щодо графіку надходження коштів від зовнішніх державних запозичень і можливого посилення карантинних заходів. Внаслідок цього справедлива вартість портфелю ОВДП зазнала негативної переоцінки.

Депозити

Після коригування відсоткових доходів за банківськими вкладками на суму переоцінки за справедливою вартістю, фінансовий результат від операцій з депозитами у жовтні склав 4,5 млн грн.

Корпоративні облігації

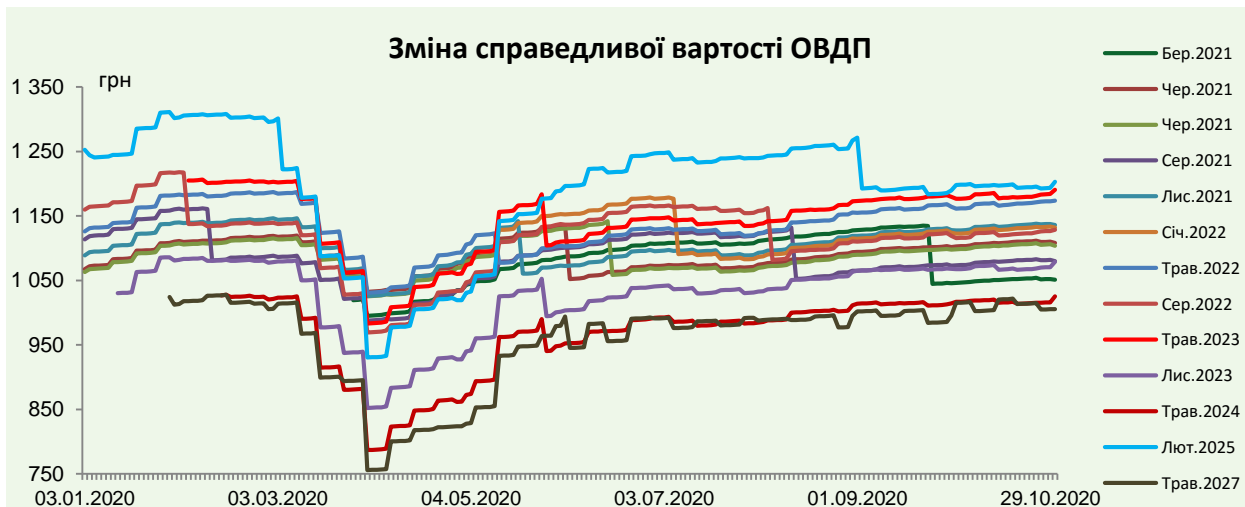
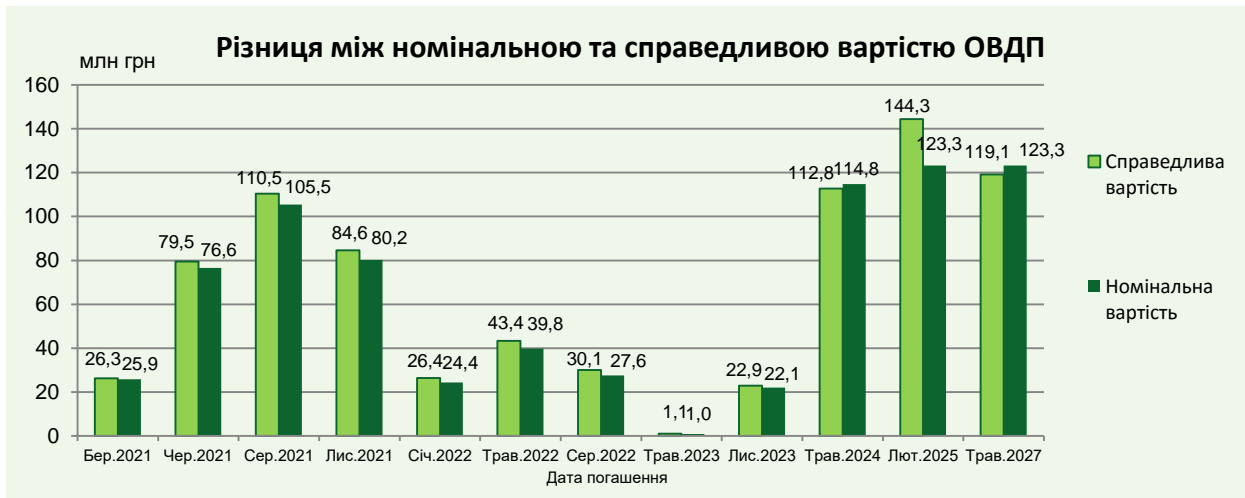
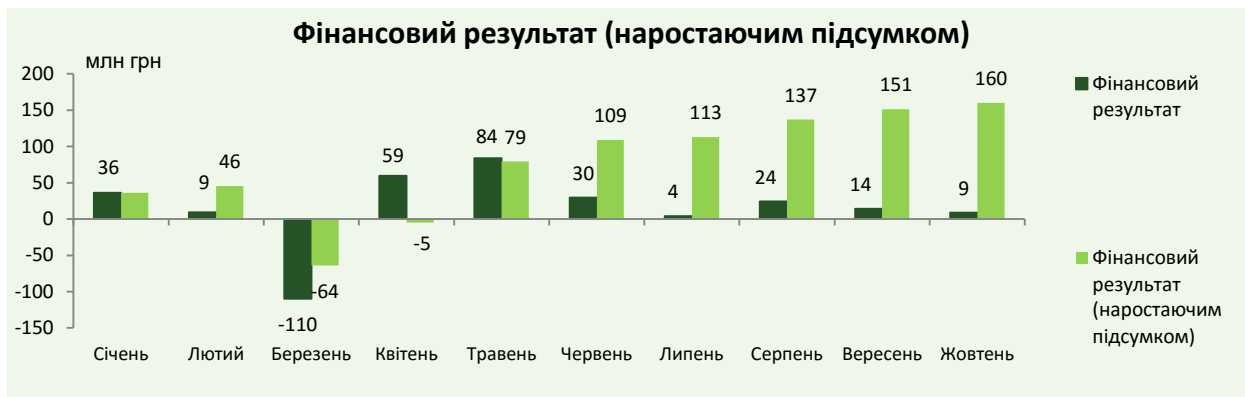
У жовтні портфель корпоративних облігацій заробив 666 тис. грн відсоткового доходу.

Нерухомість

Дохід Фонду від здавання в оренду нерухомості з урахуванням майнових податків у звітному місяці склав 76 тис. грн.

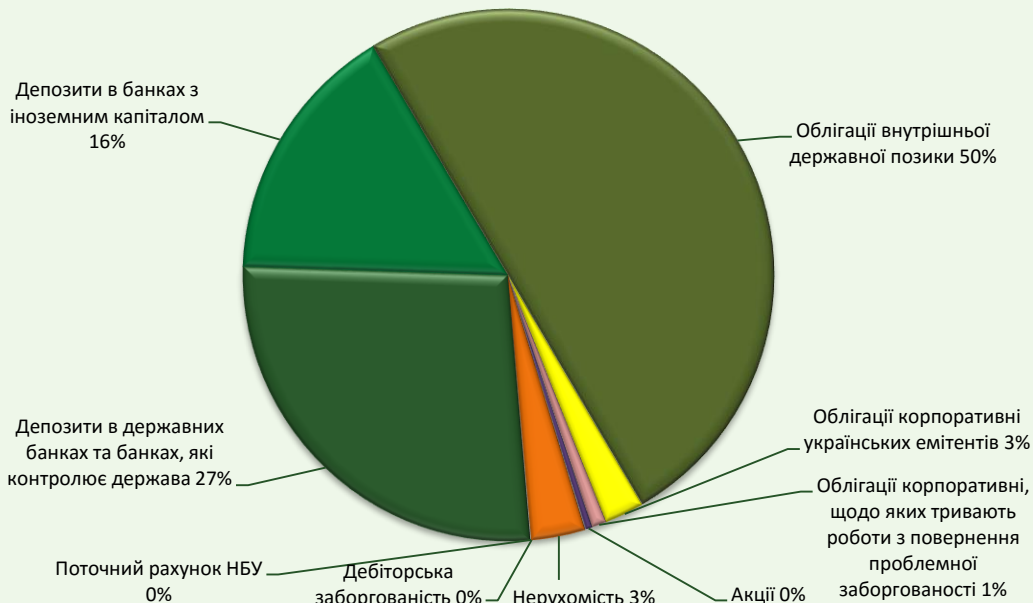
Стаття доходів/витрат	Жовтень	Наростаючим підсумком
<i>Зміна справедливої вартості депозитів за рахунок переоцінки</i>	-	615
<i>Зміна справедливої вартості депозитів за рахунок використання методу ДГП</i>	(3 625)	1 321
<i>Зміна справедливої вартості депозитів за рахунок курсової різниці</i>	-	4 180
<i>Зміна справедливої вартості депозитів за рахунок нарахованих доходів</i>	8 167	77 706
Депозити	4 542	83 823
<i>Зміна справедливої вартості ОВДП за рахунок курсової різниці</i>	-	3 400
<i>Зміна справедливої вартості ОВДП за рахунок переоцінки</i>	(5 414)	(437)
<i>Зміна справедливої вартості ОВДП за рахунок нарахованих доходів</i>	8 825	80 256
<i>Фінансовий результат від продажу ОВДП</i>	-	(419)
ОВДП	3 411	82 801
<i>Зміна справедливої вартості корпоративних облігацій за рахунок нарахованих доходів</i>	666	7 137
<i>Амортизація премії/дисконту при погашенні корпоративних облігацій</i>	-	(2 816)
<i>Зміна справедливої вартості корпоративних облігацій за рахунок переоцінки</i>	-	(220)
Корпоративні облігації	666	4 101
<i>Доходи від оренди нерухомості</i>	107	1 014
<i>Фінансовий результат від продажу нерухомості</i>	-	(1 676)
<i>Майнові податки</i>	(31)	(240)
Нерухомість	76	(901)
<i>Дивіденди</i>	-	405
<i>Інші активи</i>	-	405
Інвестиційний дохід	8 695	170 228
<i>Послуги з обслуговування активів</i>	-	-
<i>Аудиторські послуги</i>	-	(469)
<i>Послуги оцінювача</i>	(28)	(28)
<i>Юридичні послуги</i>	-	(240)
Адміністративні витрати	(28)	(737)
<i>Фінансовий результат від продажу обладнання</i>	-	(9 413)
<i>Доходи від переоцінки дебіторської заборгованості</i>	-	4
Інші доходи/витрати	-	(9 409)
Прибуток (збиток)	8 666	160 028

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 НБУ	UAH	1 028	1 028	0,1%
Депозити в державних банках та банках, які контролює держава	UAH	427 128	429 259	26,8%
Депозити в банках з іноземним капіталом	UAH	248 796	255 641	16,0%
Всього грошові кошти		676 952	685 928	42,9%
Облігації внутрішньої державної позики	UAH	764 524	800 985	50,1%
Облігації корпоративні українських емітентів	UAH	38 878	38 878	2,4%
Облігації корпоративні українських емітентів, щодо яких тривають роботи з повернення проблемної заборгованості	UAH	14 420	14 420	0,9%
Всього облігації		817 822	854 283	53,4%
Всього акції		6 475	6 475	0,4%
Всього нерухомість		52 464	52 464	3,3%
Всього дебіторська заборгованість		208	208	0,0%
Всього активи		1 553 921	1 599 358	100%

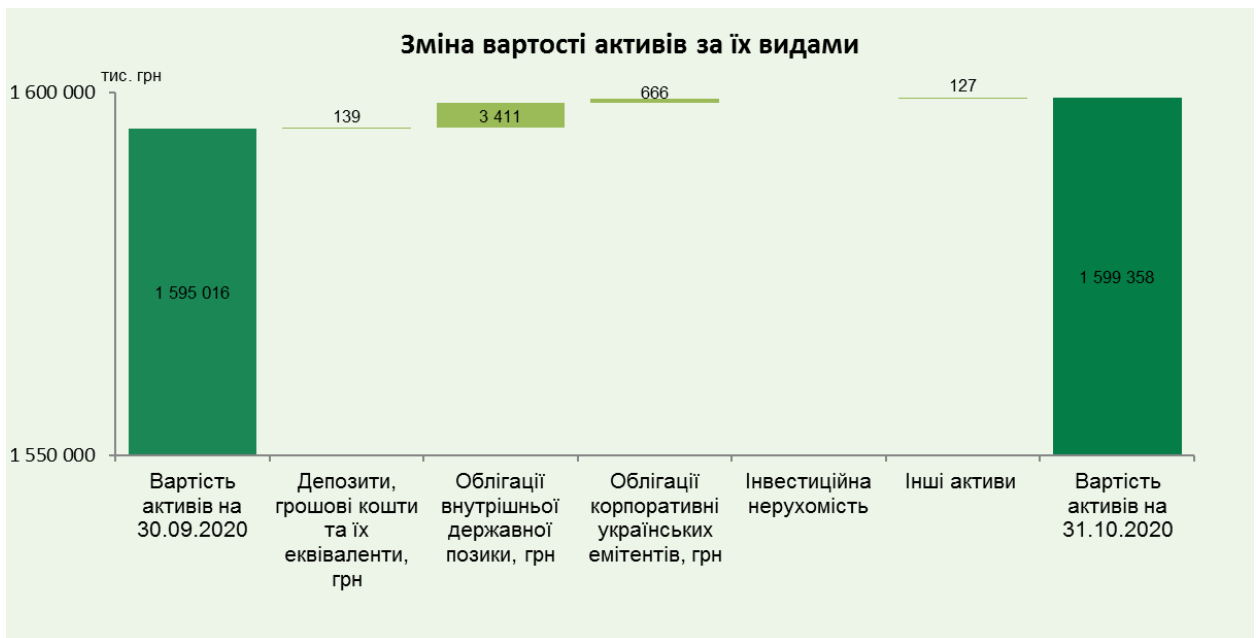
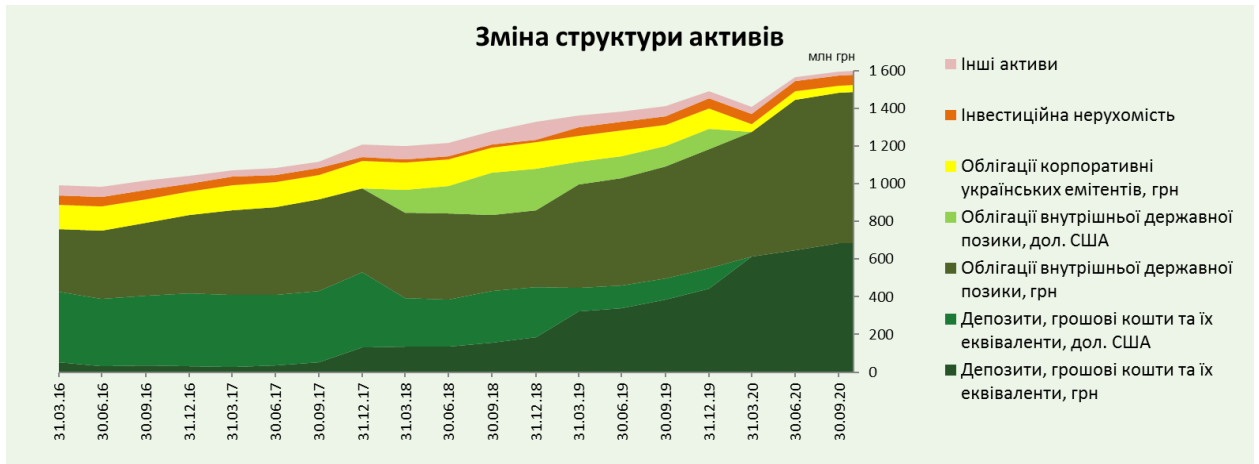
*Примітки:

*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

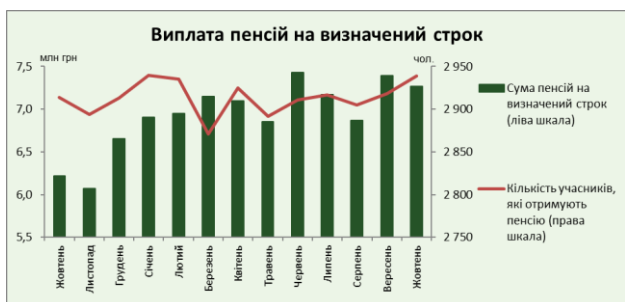
** згідно п.п.6 п.1 ст.49 ЗУ «Про недержавне пенсійне забезпечення» заборонено придбавати або додатково інвестувати в цінні папери, доходи за якими гарантовано Кабінетом Міністрів України, більш як 50% загальної вартості пенсійних активів

Джерело: Департамент з управління діяльністю КНПФ НБУ. Дані у тис. грн, станом на 31.10.2020.

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 31.10.2020.