

Підсумки місяця

У січні 2018 року інвестиційний дохід КНПФ НБУ (далі - Фонд) склав 7,4 млн гривень. Більшу частину цього доходу було отримано за рахунок відсоткового доходу та доходу від переоцінки валютних депозитів.

Ринок облігацій внутрішньої державної позики (ОВДП)

Дохід від ОВДП цього місяця був незначним внаслідок зниження поточної ринкової вартості ОВДП, спричиненого нещодавнім підвищенням облікової ставки Національним банком України. Оскільки портфель ОВДП Фонду сформовано переважно з облігацій з коротким терміном погашення, які Фонд зазвичай утримує до погашення, ми не вбачаємо суттєвих ризиків втрат через тимчасове зменшення вартості цієї категорії активів.

З метою підвищення дохідності активів за умови збереження незмінною валютної частки портфелю, у січні за рахунок зменшення валютних депозитів до портфелю Фонду було придбано ОВДП деноміновані у доларі США, дохідність яких є суттєво вищою за дохідність доларових депозитів.

Депозити

Дохід від операцій з банківським вкладами у січні склав 4,6 млн гривень. З них 2,5 млн гривень становив відсотковий дохід, а решту доходу було отримано від переоцінки доларових депозитів.

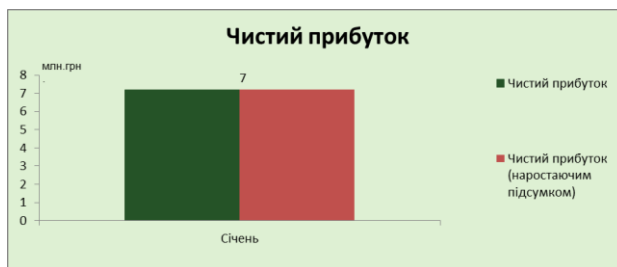
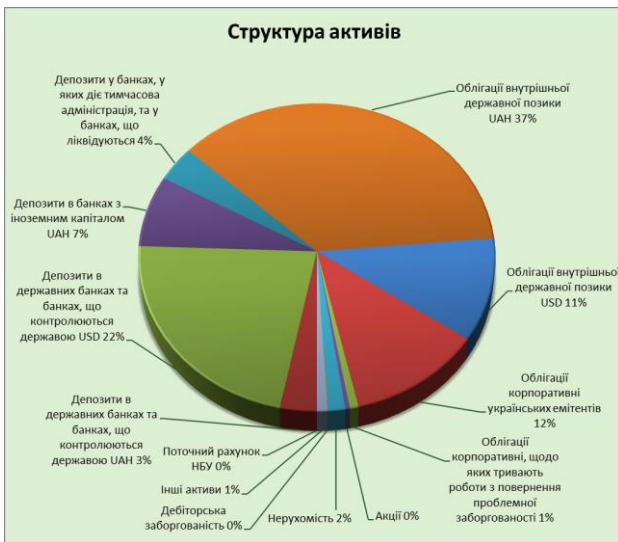
Корпоративні облігації

У січні портфель корпоративних облігацій заробив 2,6 млн гривень купонного доходу.

Нерухомість

Дохід Фонду від здавання в оренду нерухомості у січні зменшилися у порівнянні з середньомісячним значенням 2017 року внаслідок продажу нерухомості у Харкові та Одесі. Цього місяця він склав 106 тисяч гривень.

Головні показники діяльності



Вид активу	Валюта	Вартість активу	Питома вага у портфелі
Поточний рахунок НБУ	UAH	65	0,0%
Депозити в державних банках та банках, що контролюються державою	UAH / USD	38 974 / 270 895	3,2% / 22,3%
Депозити в банках з іноземним капіталом	UAH	91 070	7,5%
Депозити у банках, у яких діє тимчасова адміністрація, та у банках, що ліквідуються	UAH	44 910	3,7%
Всього грошові кошти		445 914	36,8%
Облігації внутрішньої державної позики	UAH / USD	447 080 / 131 343	36,9% / 10,8%
Облігації корпоративні українських емітентів	UAH	144 724	11,9%
Облігації корпоративні українських емітентів, щодо яких тривають роботи з повернення проблемної заборгованості	UAH	9 181	0,8%
Всього облігації		732 328	60,4%
Всього акції		4 673	0,4%
Всього нерухомість		18 788	1,5%
Всього дебіторська заборгованість		605	0,0%
Всього інші активи		10 624	0,9%
Всього активи		1 212 933	100%

Статті доходу	Січень
Зміна справедливої вартості депозитів за рахунок курсової різниці	2 115
Зміна справедливої вартості депозитів за рахунок нарахованих доходів	2 498
Зміна справедливої вартості ОВДП за рахунок курсової різниці	(3 918)
Зміна справедливої вартості ОВДП за рахунок нарахованих доходів	11 170
Зміна справедливої вартості ОВДП за рахунок переоцінки	(7 195)
Корпоративні облігації	2 664
Оренда нерухомості	106
Інвестиційний дохід	7 441

*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.