

Звіт про результати діяльності КНПФ НБУ

Підсумки місяця

У серпні 2017 року інвестиційний дохід КНПФ НБУ (далі - Фонд) склав 7,7 млн. гривень. Основну частину цього доходу було сформовано завдяки отриманню купонів та переоцінці облігацій внутрішньої державної позики (ОВДП).

Ринок облігацій внутрішньої державної позики (ОВДП)

Планово збільшуючись, питома вага ОВДП у структурі пенсійних активів Фонду сягнула у серпні 44%. Протягом 2017 року цей інструмент залишається найприбутковішим. Так, у серпні 2017 року отримано купонного доходу від ОВДП на суму 1,1 млн. гривень та за рахунок зростання їх ринкової вартості отримано 5,6 млн. гривень.

Депозити

Внаслідок сезонного зміцнення курсу гривні до долара США та, як наслідок, переоцінки банківських вкладів розміщених у цій валюті, підсумок від операцій з депозитами склав мінус 2,6 млн. гривень. Попри це, зважаючи на історичну динаміку валютного курсу, є підстави припускати, що середньозважена дохідність депозитних вкладів у активах Фонду за результатами 2017 року сягне прийняттого рівня.

Корпоративні облігації

Протягом серпня накопичено доходів від облігацій підприємств на суму 3,4 млн. гривень.

Нерухомість

Доходи від здавання в оренду нерухомості склали 260 тис. гривень.

Головні показники діяльності



Статті доходу	Серпень	Наростаючим підсумком
Зміна справедливої вартості депозитів за рахунок курсової різниці	(4 788)	(22 968)
Зміна справедливої вартості депозитів за рахунок нарахованих доходів	2 227	18 273
Зміна справедливої вартості депозитів за рахунок використання методу ДГП	(81)	(612)
ОВДП	6 667	50 945
Корпоративні облігації	3 431	29 159
Реалізація заставного майна	-	7 390
Оренда нерухомості	260	2 310
Інші статті інвестиційного доходу	(20)	(809)
Інвестиційний дохід	7 695	83 688

Вид активу	Валюта	Вартість активу	Питома вага у портфелі
Поточний рахунок НБУ	UAH	52	0,0%
Депозити в державних банках та банках, що контролюються державою	UAH, USD	21 286, 365 767	1,9%, 33,4%
Депозити в інших банках з іноземним капіталом	UAH	20 563	1,9%
Депозити в комерційних банках	UAH	9 295	0,8%
Всього грошові кошти		416 962	38,1%
Облігації внутрішньої державної позики	UAH	487 159	44,5%
Облігації корпоративні українських емітентів	UAH	138 806	12,7%
Всього облігації		625 965	57,2%
Всього акції		4 460	0,4%
Всього нерухомість		37 545	3,4%
Всього дебіторська заборгованість		69	0,0%
Всього інші активи		9 965	0,9%
Всього активи		1 094 966	100%



*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 одиниць пенсійних активів - розрахункова вартість одиниць пенсійних активів, що визначається шляхом ділення чистої вартості активів на загальну кількість одиниць пенсійних активів на день підрахунку.