

Звіт про результати діяльності КНПФ НБУ

Підсумки місяця

Інвестиційний дохід КНПФ НБУ (далі - Фонд) у листопаді 2017 року склав 10,7 млн. гривень, переважно за рахунок зростання вартості банківських вкладів у доларах США та відсоткових доходів від облігацій внутрішньої державної позики.

Ринок облігацій внутрішньої державної позики (ОВДП)

Незважаючи на незначну корекцію цін на ОВДП внаслідок підвищення ключової ставки центрального банку у листопаді Фондом отримано доходів від ОВДП на суму 3,7 млн гривень. В структурі активів Фонду переважають короткострокові державні цінні папери, тому коливання цін на ОВДП не спричиняють суттєвих впливів на вартість активів Фонду.

Депозити

Цього місяця тривало зростання курсу долара США до гривні, внаслідок чого дохід від банківських вкладів (переоцінка вкладів у доларах США та відсоткові доходи) склав 5,1 млн. гривень.

Корпоративні облігації

Портфель корпоративних облігацій приніс у листопаді 3,1 млн. гривень доходу.

Нерухомість

Послідовно реалізуючи стратегію Фонду на 2017-2022 роки з метою приведення складу активів Фонду до цільового, у листопаді були продані об'єкти нерухомості на відкритих аукціонах Prozorro.Sale та акції ПАТ «ФБ «Перспектива» на Фондовій біржі ПФТС на загальну суму 1,6 млн. гривень. Дохід від здавання в оренду нерухомості у листопаді становив 285 тис. гривень.

Головні показники діяльності



Статті доходу	Листопад	Наростаючим підсумком
Зміна справедливої вартості депозитів за рахунок курсової різниці	2 629	(2 529)
Зміна справедливої вартості депозитів за рахунок нарахованих доходів	2 469	25 546
Зміна справедливої вартості депозитів за рахунок використання методу ДГП ОВДП	-	(862)
Корпоративні облігації	3 113	64 248
Реалізація заставного майна	-	7 390
Оренда нерухомості	285	3 173
Інші статті інвестиційного доходу	(1 508)	(2 389)
Інвестиційний дохід	10 695	134 738



Вид активу	Валюта	Вартість активу	Питома вага у портфелі
Поточний рахунок НБУ	UAH	1	0,0%
Депозити в державних банках та банках, що контролюються державою	UAH / USD	44 777 / 386 175	3,9% / 34,0%
Депозити в банках з іноземним капіталом	UAH	20 302	1,8%
Депозити в комерційних банках	UAH	9 295	0,8%
Всього грошові кошти		460 551	40,5%
Облігації внутрішньої державної позики	UAH	484 827	42,7%
Облігації корпоративні українських емітентів	UAH	139 629	12,3%
Всього облігації		624 456	55,0%
Всього акції		4 118	0,4%
Всього нерухомість		35 631	3,1%
Всього дебіторська заборгованість		1 044	0,1%
Всього інші активи		9 965	0,9%
Всього активи		1 135 766	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.