

Звіт про результати діяльності КНПФ НБУ

Підсумки місяця

Інвестиційний дохід КНПФ НБУ (далі - Фонд) у жовтні 2017 року становив 17,4 млн. гривень, сягнувши 124 млн. гривень за 10 місяців 2017 року. Дохід цього місяця є суттєво вищим за середньомісячний у 2017 році.

Ринок облігацій внутрішньої державної позики (ОВДП)

У жовтні ціни на ОВДП переважно не змінилися і становили в залежності в терміні погашення (1-3 роки) - 14.5-15% річних до погашення. За жовтень 2017 року накопичено доходів від ОВДП у розмірі 6,3 млн. гривень.

Депозити

Цього місяця продовжилося зростання курсу долара США до гривні, хоча й не таке стрімке як у вересні. Як результат у жовтні вдалося збільшити дохідність банківських вкладів. Дохід від депозитів склав 6,9 млн. гривень, що є значно вищим за середньомісячне значення у 2017 році.

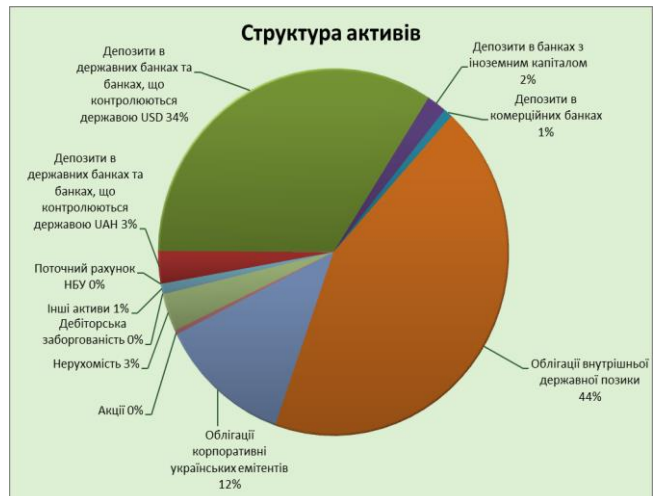
Корпоративні облігації

Накопичений купонний дохід та відсоткові платежі від облігацій підприємств, що знаходяться в активах Фонду, додали на пенсійні рахунки учасників Фонду 4 млн. гривень доходу.

Нерухомість

Доходи від здавання в оренду нерухомості у жовтні 2017 року становили 296 тис. гривень.

Головні показники діяльності



Статті доходу	Жовтень	Наростаючим підсумком
Зміна справедливої вартості депозитів за рахунок курсової різниці	4 395	(5 158)
Зміна справедливої вартості депозитів за рахунок нарахованих доходів	2 462	23 077
Зміна справедливої вартості депозитів за рахунок використання методу ДГП	-	(862)
ОВДП	6 340	60 540
Корпоративні облігації	3 957	37 049
Реалізація заставного майна	-	7 390
Оренда нерухомості	296	2 888
Інші статті інвестиційного доходу	(30)	(881)
Інвестиційний дохід	17 420	124 043



*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.

Джерело: КНПФ НБУ. Дані у тис. грн., станом на 31.10.2017.

Вид активу	Валюта	Вартість активу	Питома вага у портфелі
Поточний рахунок НБУ	UAH	54	0,0%
Депозити в державних банках та банках, що контролюються державою	UAH	32 284	2,9%
	USD	383 593	34,0%
Депозити в банках з іноземним капіталом	UAH	20 313	1,8%
Депозити в комерційних банках	UAH	9 295	0,8%
Всього грошові кошти		445 538	39,5%
Облігації внутрішньої державної позики	UAH	492 301	43,7%
Облігації корпоративні українських емітентів	UAH	137 402	12,2%
Всього облігації		629 703	55,9%
Всього акції		4 460	0,4%
Всього нерухомість		37 545	3,3%
Всього дебіторська заборгованість		274	0,0%
Всього інші активи		9 965	0,9%
Всього активи		1 127 485	100%