

# Звіт про результати діяльності КНПФ НБУ

## Підсумки місяця

У квітні 2018 року інвестиційний прибуток КНПФ НБУ (далі - Фонд) склав 4,7 млн гривень. Більшу частину цього доходу було отримано за рахунок відсоткового доходу та доходу від переоцінки облігацій внутрішньої державної позики та корпоративних облігацій.

### ▪ Ринок облігацій внутрішньої державної позики (ОВДП)

З уповільненням споживчої інфляції та завершенням циклу підвищення облікової ставки в 1 кварталі 2018 року ціни на ОВДП призупинили падіння. Незважаючи на зміцнення гривні до долару США на 1,2% у квітні та уцінку частини ОВДП, що номіновані в доларах США, дохід від ОВДП цього місяця був суттєво вищим за дохід попереднього місяця і становив 2,3 млн. гривень.

### ▪ Депозити

Відсотковий дохід у квітні 2018 року склав 2,5 млн. грн. Однак, внаслідок ревальвації гривні курсова різниця за депозитами в доларі США склала -3 млн. грн., що в підсумку дало негативний фінансовий результат в розмірі -540 тисяч гривень.

### ▪ Корпоративні облігації

У квітні портфель корпоративних облігацій заробив 2,7 млн гривень купонного доходу.

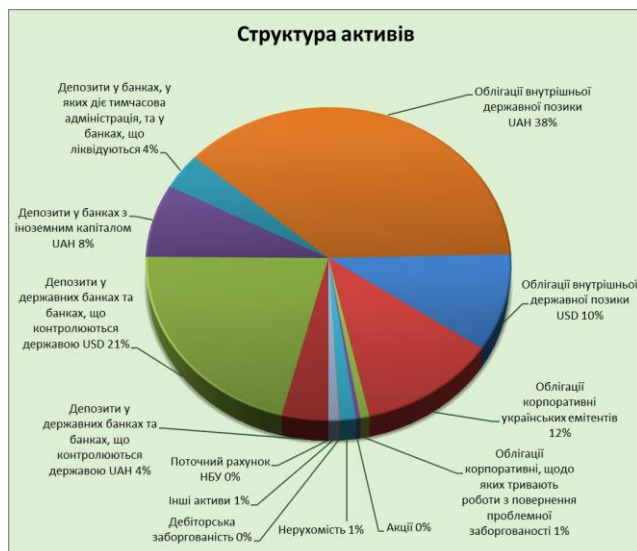
### ▪ Нерухомість

Дохід Фонду від здавання в оренду нерухомості цього місяця склав 98 тисяч гривень.

| Стаття доходів/витрат                                                              | Квітень      | Наростаючим підсумком |
|------------------------------------------------------------------------------------|--------------|-----------------------|
| Зміна справедливої вартості депозитів за рахунок курсової різниці                  | (3 023)      | (15 023)              |
| Зміна справедливої вартості депозитів за рахунок нарахованих доходів               | 2 483        | 9 856                 |
| <b>Депозити</b>                                                                    | <b>(540)</b> | <b>(5 168)</b>        |
| Зміна справедливої вартості ОВДП за рахунок курсової різниці                       | (1 424)      | (12 193)              |
| Зміна справедливої вартості ОВДП за рахунок переоцінки та нарахованих доходів      | 3 763        | 12 930                |
| <b>ОВДП</b>                                                                        | <b>2 340</b> | <b>737</b>            |
| Зміна справедливої вартості корпоративних облігацій за рахунок нарахованих доходів | 2 657        | 10 332                |
| Зміна справедливої вартості корпоративних облігацій за рахунок погашення/продажу   | 86           | 172                   |
| <b>Корпоративні облігації</b>                                                      | <b>2 743</b> | <b>10 504</b>         |
| Доходи від оренди нерухомості                                                      | 98           | 401                   |
| Доходи від продажу нерухомості                                                     | -            | 251                   |
| Майнові податки                                                                    | (17)         | (68)                  |
| <b>Нерухомість</b>                                                                 | <b>81</b>    | <b>584</b>            |
| Доходи від продажу обладнання                                                      | 147          | 147                   |
| <b>Інші активи</b>                                                                 | <b>147</b>   | <b>147</b>            |
| <b>Інвестиційний дохід</b>                                                         | <b>4 771</b> | <b>6 804</b>          |
| Аудиторські послуги                                                                | (23)         | (337)                 |
| Юридичні послуги                                                                   | (41)         | (296)                 |
| <b>Адміністративні витрати</b>                                                     | <b>(64)</b>  | <b>(632)</b>          |
| <b>Інші доходи/витрати</b>                                                         | <b>(0)</b>   | <b>6</b>              |
| <b>Прибуток (збиток)</b>                                                           | <b>4 706</b> | <b>6 177</b>          |

# Звіт про результати діяльності КНПФ НБУ

## Головні показники діяльності



| Вид активу                                                                                                     | Валюта | Вартість активу  | Питома вага у портфелі |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------|------------------|------------------------|
| Поточний рахунок НБУ                                                                                           | UAH    | 43               | 0,0%                   |
| Депозити у державних банках та банках, що контролюються державою                                               | UAH    | 47 691           | 4,0%                   |
| Депозити у банках з іноземним капіталом                                                                        | USD    | 253 669          | 21,1%                  |
| Депозити у банках, у яких діє тимчасова адміністрація, та у банках, що ліквідуються                            | UAH    | 91 036           | 7,6%                   |
| Депозити у банках, у яких діє тимчасова адміністрація, та у банках, що ліквідуються                            | UAH    | 44 910           | 3,7%                   |
| <b>Всього грошові кошти</b>                                                                                    |        | <b>437 349</b>   | <b>36,4%</b>           |
| Облігації внутрішньої державної позики                                                                         | UAH    | 458 086          | 38,2%                  |
| Облігації корпоративні українських емітентів                                                                   | USD    | 119 369          | 9,9%                   |
| Облігації корпоративні українських емітентів, щодо яких тривають роботи з повернення проблемної заборгованості | UAH    | 143 466          | 12,0%                  |
| <b>Всього облігації</b>                                                                                        |        | <b>730 103</b>   | <b>60,8%</b>           |
| <b>Всього акції</b>                                                                                            |        | <b>4 673</b>     | <b>0,4%</b>            |
| <b>Всього нерухомість</b>                                                                                      |        | <b>16 839</b>    | <b>1,4%</b>            |
| <b>Всього дебіторська заборгованість</b>                                                                       |        | <b>575</b>       | <b>0,0%</b>            |
| <b>Всього інші активи</b>                                                                                      |        | <b>10 421</b>    | <b>0,9%</b>            |
| <b>Всього активи</b>                                                                                           |        | <b>1 199 959</b> | <b>100%</b>            |



\*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: КНПФ НБУ. Дані у тис. грн., станом на 30.04.2018.

# Звіт про результати діяльності КНПФ НБУ

## Головні показники діяльності

