

Звіт про результати діяльності КНПФ НБУ

Підсумки місяця

У березні 2018 року прибуток КНПФ НБУ (далі - Фонд) склав 0,38 млн гривень. Основним чинником його зменшення у порівнянні з середньомісячним значенням минулого року стали зростання курсу гривні до долара США та корекція цін на облігації внутрішньої державної позики (ОВДП) .

Ринок облігацій внутрішньої державної позики (ОВДП)

Результат від операцій з ОВДП був негативним (-774 тисячі гривень), що пояснюється переоцінкою ОВДП номінованих в доларах США та незначним зниженням цін на ОВДП. Наразі портфель ОВДП є збалансованим, сформованим переважно з короткострокових облігацій – з середньозваженою дюрацією 1,4 роки. Ми не очікуємо подальшого зниження цін на ОВДП і не вбачаємо суттєвих ризиків для таких інвестицій.

Депозити

Відсотковий дохід в березні 2018 року склав 2,5 млн грн. Але за рахунок зниження курсу долара США до гривні і відповідно переоцінки вартості депозитів загальний підсумок склав мінус 1,4 млн гривень. Незважаючи на тимчасовий негативний результат від операцій з банківськими вкладками, спричинений зниженням курсу долара США до гривні, ми не плануємо знижувати питому вагу доларів США в активах Фонду, оскільки валютна диверсифікація є одним з ключових інструментів зі зниження ризиків інвестування.

Корпоративні облігації

Доходи від портфелю корпоративних облігацій Фонду у березні становили 2,6 млн гривень.

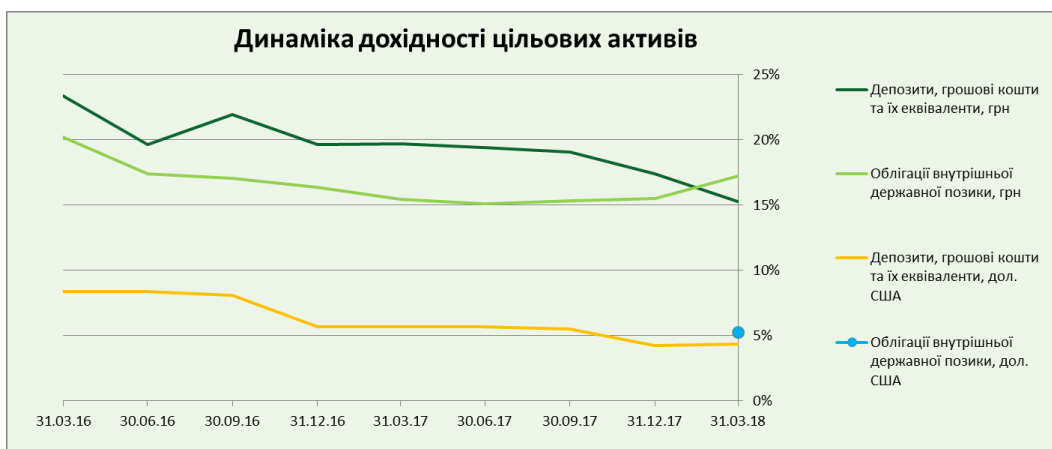
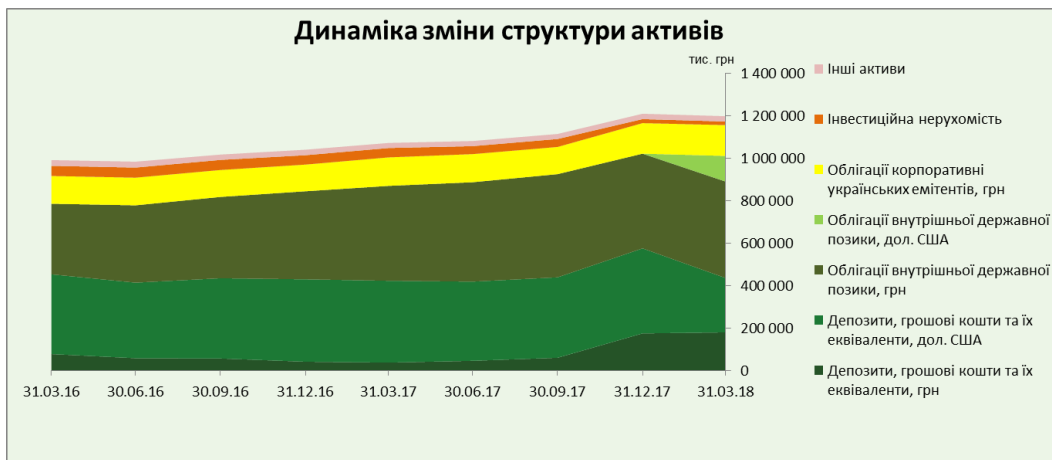
Нерухомість

Платежі від здавання в оренду нерухомості, що належить Фонду, склали 98 тисяч гривень.



Звіт про результати діяльності КНПФ НБУ

Головні показники діяльності



Стаття доходів/витрат	Березень	Наростаючим підсумком
Зміна справедливої вартості депозитів за рахунок курсової різниці	(3 905)	(11 978)
Зміна справедливої вартості депозитів за рахунок нарахованих доходів	2 523	7 351
Зміна справедливої вартості ОВДП за рахунок курсової різниці	(1 842)	(10 769)
Зміна справедливої вартості ОВДП за рахунок переоцінки та нарахованих доходів	1 067	9 167
Корпоративні облігації	2 622	7 761
Оренда нерухомості	98	303
Інші статті інвестиційного доходу	(17)	199
Інвестиційний дохід	547	2 034
Консультаційні послуги	-	-
Аудиторські послуги	(96)	(314)
Послуги оцінювача	-	-
Юридичні послуги	(75)	(255)
Адміністративні витрати	(171)	(568)
Інші доходи/витрати	6	6
Прибуток (збиток)	382	1 471