

# Звіт про результати діяльності КНПФ НБУ

## Підсумки місяця

У жовтні 2020 року фінансовий результат КНПФ НБУ (далі - Фонд) склав 8,7 млн грн. У звітному місяці основним чинником зростання вартості активів Фонду були відсоткові доходи за банківськими вкладками.

### Облігації внутрішньої державної позики (ОВДП)

Прибуток від портфелю облігацій внутрішньої державної позики (далі – ОВДП) у жовтні склав 3,4 млн грн. Після зростання влітку, ціни на ОВДП восени дещо знизилися на тлі невизначеності щодо графіку надходження коштів від зовнішніх державних запозичень і можливого посилення карантинних заходів. Внаслідок цього справедлива вартість портфелю ОВДП зазнала негативної переоцінки.

### Депозити

Після коригування відсоткових доходів за банківськими вкладками на суму переоцінки за справедливою вартістю, фінансовий результат від операцій з депозитами у жовтні склав 4,5 млн грн.

### Корпоративні облігації

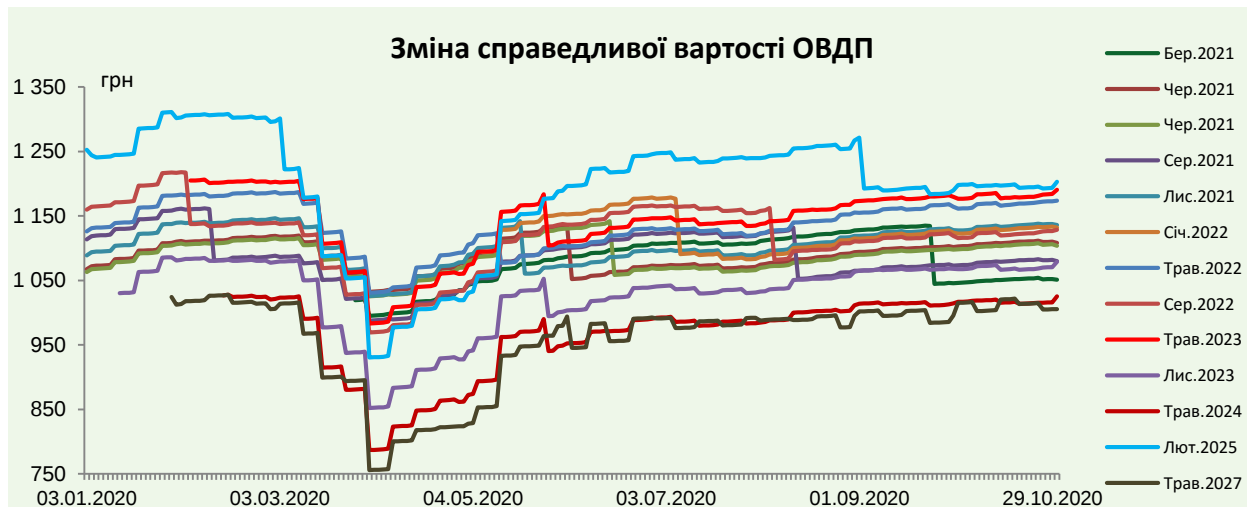
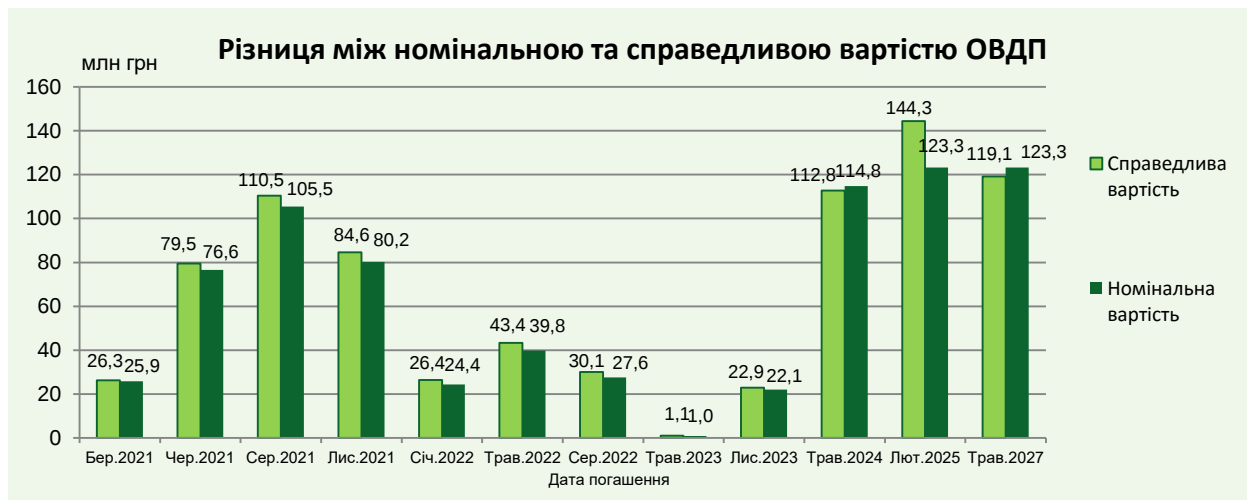
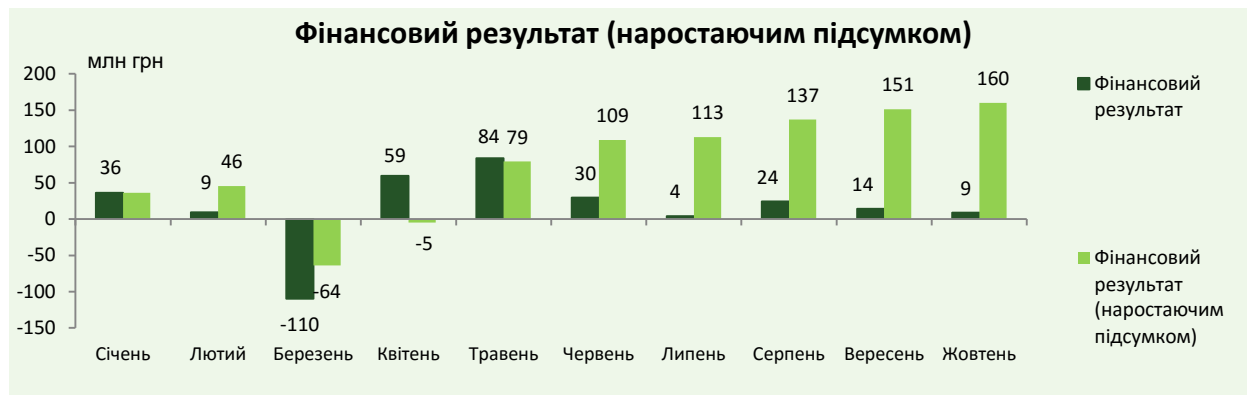
У жовтні портфель корпоративних облігацій заробив 666 тис. грн відсоткового доходу.

### Нерухомість

Дохід Фонду від здавання в оренду нерухомості з урахуванням майнових податків у звітному місяці склав 76 тис. грн.

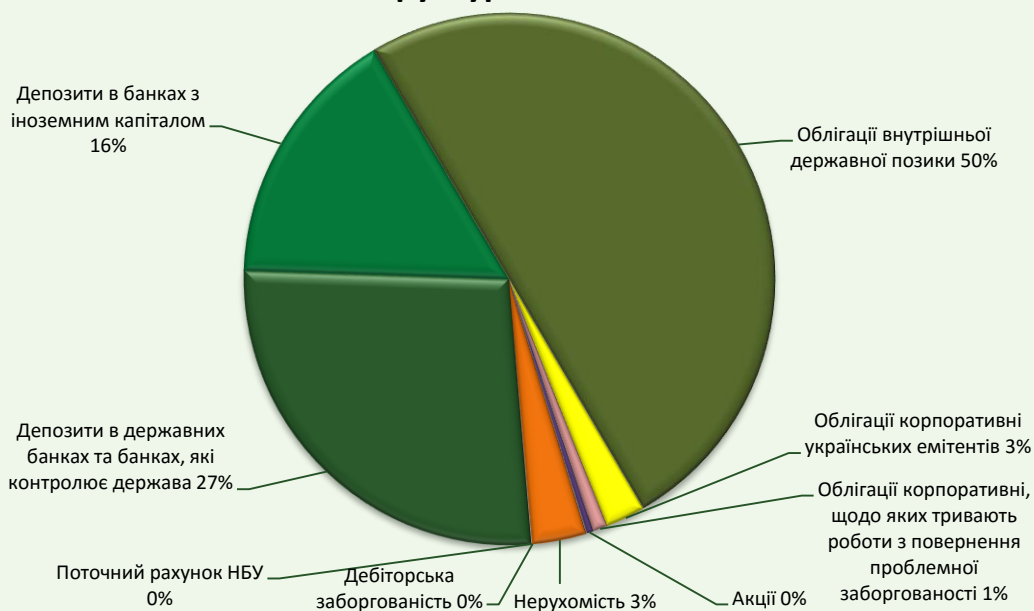
| Стаття доходів/витрат                                                              | Жовтень      | Наростаючим підсумком |
|------------------------------------------------------------------------------------|--------------|-----------------------|
| Зміна справедливої вартості депозитів за рахунок переоцінки                        | -            | 615                   |
| Зміна справедливої вартості депозитів за рахунок використання методу ДГП           | (3 625)      | 1 321                 |
| Зміна справедливої вартості депозитів за рахунок курсової різниці                  | -            | 4 180                 |
| Зміна справедливої вартості депозитів за рахунок нарахованих доходів               | 8 167        | 77 706                |
| <b>Депозити</b>                                                                    | <b>4 542</b> | <b>83 823</b>         |
| Зміна справедливої вартості ОВДП за рахунок курсової різниці                       | -            | 3 400                 |
| Зміна справедливої вартості ОВДП за рахунок переоцінки                             | (5 414)      | (437)                 |
| Зміна справедливої вартості ОВДП за рахунок нарахованих доходів                    | 8 825        | 80 256                |
| Фінансовий результат від продажу ОВДП                                              | -            | (419)                 |
| <b>ОВДП</b>                                                                        | <b>3 411</b> | <b>82 801</b>         |
| Зміна справедливої вартості корпоративних облігацій за рахунок нарахованих доходів | 666          | 7 137                 |
| Амортизація премії/дисконту при погашенні корпоративних облігацій                  | -            | (2 816)               |
| Зміна справедливої вартості корпоративних облігацій за рахунок переоцінки          | -            | (220)                 |
| <b>Корпоративні облігації</b>                                                      | <b>666</b>   | <b>4 101</b>          |
| Доходи від оренди нерухомості                                                      | 107          | 1 014                 |
| Фінансовий результат від продажу нерухомості                                       | -            | (1 676)               |
| Майнові податки                                                                    | (31)         | (240)                 |
| <b>Нерухомість</b>                                                                 | <b>76</b>    | <b>(901)</b>          |
| Дивіденди                                                                          | -            | 405                   |
| Інші активи                                                                        | -            | 405                   |
| <b>Інвестиційний дохід</b>                                                         | <b>8 695</b> | <b>170 228</b>        |
| Послуги з обслуговування активів                                                   | -            | -                     |
| Аудиторські послуги                                                                | -            | (469)                 |
| Послуги оцінювача                                                                  | (28)         | (28)                  |
| Юридичні послуги                                                                   | -            | (240)                 |
| <b>Адміністративні витрати</b>                                                     | <b>(28)</b>  | <b>(737)</b>          |
| Фінансовий результат від продажу обладнання                                        | -            | (9 413)               |
| Доходи від переоцінки дебіторської заборгованості                                  | -            | 4                     |
| <b>Інші доходи/витрати</b>                                                         | <b>-</b>     | <b>(9 409)</b>        |
| <b>Прибуток (збиток)</b>                                                           | <b>8 666</b> | <b>160 082</b>        |

# Звіт про результати діяльності КНПФ НБУ



# Звіт про результати діяльності КНПФ НБУ

**Структура активів**



| Вид активу                                                                                                     | Валюта | Номінальна вартість активів | Вартість активів | Питома вага у портфелі |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------|-----------------------------|------------------|------------------------|
| Поточний рахунок НБУ                                                                                           | UAH    | 1 028                       | 1 028            | 0,1%                   |
| Депозити в державних банках та банках, які контролює держава                                                   | UAH    | 427 128                     | 429 259          | 26,8%                  |
| Депозити в банках з іноземним капіталом                                                                        | UAH    | 248 796                     | 255 641          | 16,0%                  |
| <b>Всього грошові кошти</b>                                                                                    |        | <b>676 952</b>              | <b>685 928</b>   | <b>42,9%</b>           |
| Облігації внутрішньої державної позики                                                                         | UAH    | 764 524                     | 800 985          | 50,1%                  |
| Облігації корпоративні українських емітентів                                                                   | UAH    | 38 878                      | 38 878           | 2,4%                   |
| Облігації корпоративні українських емітентів, щодо яких тривають роботи з повернення проблемної заборгованості | UAH    | 14 420                      | 14 420           | 0,9%                   |
| <b>Всього облігації</b>                                                                                        |        | <b>817 822</b>              | <b>854 283</b>   | <b>53,4%</b>           |
| <b>Всього акції</b>                                                                                            |        | <b>6 475</b>                | <b>6 475</b>     | <b>0,4%</b>            |
| <b>Всього нерухомість</b>                                                                                      |        | <b>52 464</b>               | <b>52 464</b>    | <b>3,3%</b>            |
| <b>Всього дебіторська заборгованість</b>                                                                       |        | <b>208</b>                  | <b>208</b>       | <b>0,0%</b>            |
| <b>Всього активи</b>                                                                                           |        | <b>1 553 921</b>            | <b>1 599 358</b> | <b>100%</b>            |

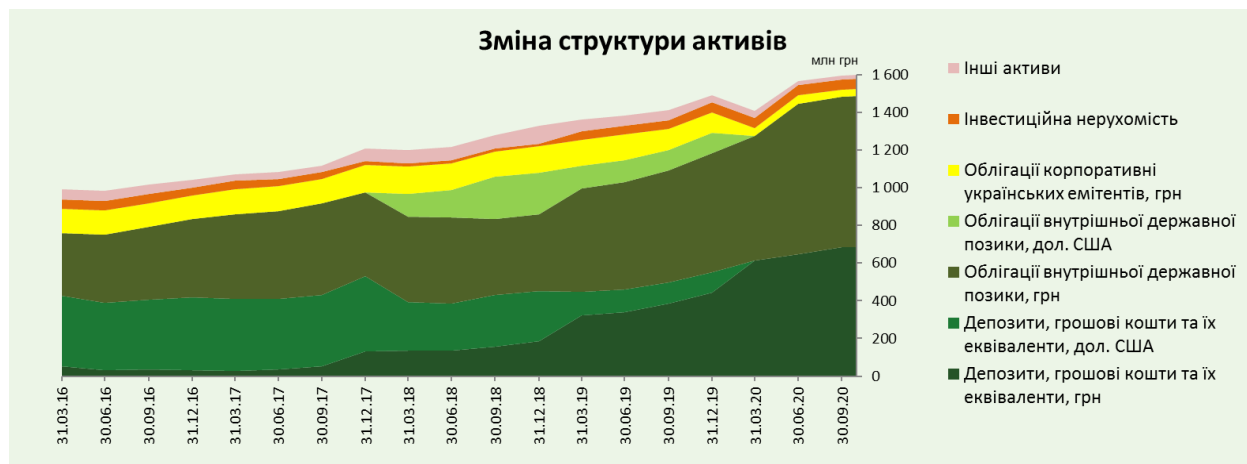
**\*Примітки:**

\*згідно п.п.4 п.1 ст.49 ЗУ «Про недержавне пенсійне забезпечення» заборонено розміщувати на банківських депозитних рахунках у грошових коштах та в ощадних сертифікатах банків більш як 50% загальної вартості пенсійних активів

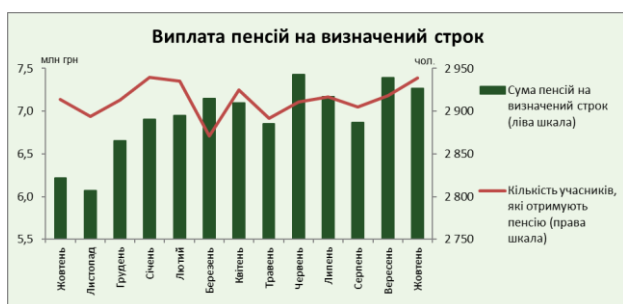
\*\* згідно п.п.6 п.1 ст.49 ЗУ «Про недержавне пенсійне забезпечення» заборонено придбавати або додатково інвестувати в цінні папери, доходи за якими гарантовано Кабінетом Міністрів України, більш як 50% загальної вартості пенсійних активів

Джерело: Департамент з управління діяльністю КНПФ НБУ. Дані у тис. грн, станом на 31.10.2020.

# Звіт про результати діяльності КНПФ НБУ



# Звіт про результати діяльності КНПФ НБУ



## \*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: Департамент з управління діяльністю КНПФ НБУ, НБУ. Дані станом на 31.10.2020.