

# Звіт про результати діяльності КНПФ НБУ

## Підсумки місяця

У вересні 2017 року інвестиційний дохід КНПФ НБУ (далі - Фонд) склав 22,9 млн. гривень. Дохід цього місяця є найвищим у 2017 році і досягнений переважно завдяки сезонному зростанню курсу долара США до гривні.

### Ринок облігацій внутрішньої державної позики (ОВДП)

Ціни на ОВДП протягом вересня 2017 року залишалися сталими: в залежності від терміну погашення (1-3 роки) вони складали 14,5-15% річних до погашення. За місяць дохід Фонду від ОВДП склав 3,2 млн. гривень.

### Депозити

Кошти Фонду, що розміщені на депозитних рахунках в банках, складають приблизно 39% від сукупних активів Фонду. Переважно це депозити у доларах США. Внаслідок стрімкого зростання курсу долару до гривні у вересні 2017 року сукупний дохід від депозитів склав 15,5 млн. гривень. Це є найвищим показником за 2017 рік і наочним прикладом захисту пенсійних накопичень учасників Фонду від девальвації.

### Корпоративні облігації

12% активів Фонду складають корпоративні облігації. Емітенти цих облігацій демонструють позитивну динаміку фінансових показників: операційний прибуток зростає як рік до року, так і місяць до місяця. Такі результати дозволяють емітентам не лише у повному обсязі і вчасно обслуговувати свої боргові зобов'язання, а й здійснювати погашення основної суми боргу. Це знаходить своє відображення у доході Фонду від таких інвестицій – у вересні портфель корпоративних облігацій заробив 3,9 млн. гривень.

### Нерухомість

Сталим є дохід Фонду від здавання в оренду нерухомості. Цього місяця він склав 0,28 млн. гривень.

## Головні показники діяльності



| Статті доходу                                                            | Вересень      | Наростаючим підсумком |
|--------------------------------------------------------------------------|---------------|-----------------------|
| Зміна справедливої вартості депозитів за рахунок курсової різниці        | 13 415        | (9 553)               |
| Зміна справедливої вартості депозитів за рахунок нарахованих доходів     | 2 341         | 20 614                |
| Зміна справедливої вартості депозитів за рахунок використання методу ДГП | (250)         | (862)                 |
| ОВДП                                                                     | 3 256         | 54 200                |
| Корпоративні облігації                                                   | 3 933         | 33 092                |
| Реалізація заставного майна                                              | -             | 7 390                 |
| Оренда нерухомості                                                       | 281           | 2 592                 |
| Інші статті інвестиційного доходу                                        | (42)          | (850)                 |
| <b>Інвестиційний дохід</b>                                               | <b>22 935</b> | <b>106 623</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 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 30.09.2017.

| Вид активу                                                       | Валюта | Вартість активу  | Питома вага у портфелі |
|------------------------------------------------------------------|--------|------------------|------------------------|
| Поточний рахунок НБУ                                             | UAH    | 106              | 0,0%                   |
| Депозити в державних банках та банках, що контролюються державою | UAH    | 30 821           | 2,8%                   |
| Депозити в банках з іноземним капіталом                          | USD    | 379 130          | 34,0%                  |
| Депозити в комерційних банках                                    | UAH    | 20 302           | 1,8%                   |
| Депозити в комерційних банках                                    | UAH    | 9 295            | 0,8%                   |
| <b>Всього грошові кошти</b>                                      |        | <b>439 653</b>   | <b>39,4%</b>           |
| Облігації внутрішньої державної позики                           | UAH    | 486 188          | 43,6%                  |
| Облігації корпоративні українських емітентів                     | UAH    | 137 448          | 12,3%                  |
| <b>Всього облігації</b>                                          |        | <b>623 636</b>   | <b>55,9%</b>           |
| <b>Всього акції</b>                                              |        | <b>4 460</b>     | <b>0,4%</b>            |
| <b>Всього нерухомість</b>                                        |        | <b>37 545</b>    | <b>3,4%</b>            |
| <b>Всього дебіторська заборгованість</b>                         |        | <b>68</b>        | <b>0,0%</b>            |
| <b>Всього інші активи</b>                                        |        | <b>9 965</b>     | <b>0,9%</b>            |
| <b>Всього активи</b>                                             |        | <b>1 115 327</b> | <b>100%</b>            |