



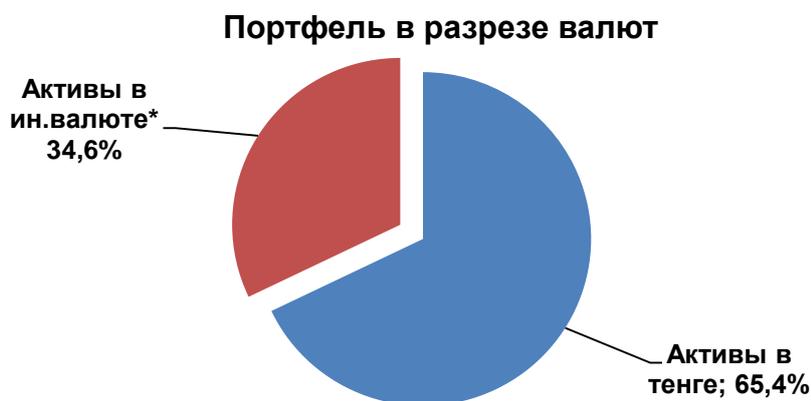
ИНФОРМАЦИОННОЕ СООБЩЕНИЕ

23 сентября 2019 года

Краткий обзор инвестиционной деятельности по пенсионным активам ЕНПФ за август 2019 года

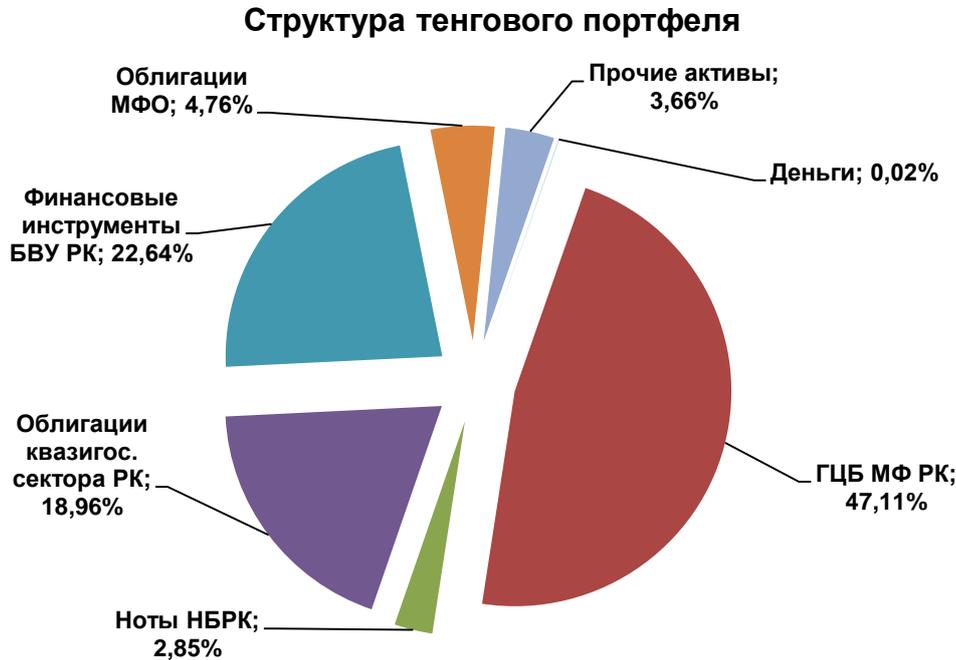
Общий портфель. В соответствии со стратегией инвестирования пенсионных активов ЕНПФ в целях диверсификации инвестиционного портфеля, направленной на обеспечение сохранности и доходности, пенсионные активы инвестируются в различные виды финансовых инструментов по валютам, странам, секторам и эмитентам.

По состоянию на 1 сентября 2019 года объем портфеля пенсионных активов ЕНПФ составил **10 302,9 млрд. тенге**. Денежные средства и финансовые инструменты, номинированные в тенге, составили **6 741,1 млрд. тенге** или 65,4%, номинированные в иностранной валюте – **3 561,7 млрд. тенге** или 34,6%.



*с учетом валюты полученной в рамках валютного свопа USD/KZT

Портфель пенсионных активов, номинированных в тенге. Пенсионные активы ЕНПФ, номинированные в тенге, инвестируются исключительно в рамках направлений, которые ежегодно одобряются Советом по управлению Национальным фондом Республики Казахстан.



Инвестиции в тенге. В августе 2019 года объем инвестирования пенсионных активов, номинированных в тенге, составил **24,0 млрд. тенге** (без учета инвестиций в инструменты денежного рынка¹), в том числе:

- приобретены ГЦБ Министерства финансов РК на общую сумму 10,5 млрд. тенге со средневзвешенной доходностью 8,9% годовых;
- приобретены облигации АО «НУХ «Байтерек» на сумму 12,5 млрд. тенге с доходностью 9,75% годовых;
- приобретены облигации АО «Евразийский Банк» на сумму 1,0 млрд. тенге с доходностью 10,95% годовых в рамках объявленной программы по обеспечению долгосрочной тенговой ликвидности на сумму 600 млрд. тенге.

Свободные денежные средства в тенге также размещались в краткосрочные инструменты денежного рынка. При этом данные инвестиции не являются стратегической целью инвестирования и осуществляются в рамках управления текущей ликвидностью для поддержания доходности пенсионных активов.

Погашения и продажи в тенге. В августе 2019 года реализованы следующие финансовые инструменты:

- ГЦБ Министерства финансов РК на общую сумму 157,1 млрд. тенге;
- облигации Международной Финансовой Корпорации на сумму 5,0 млрд. тенге.

В августе 2019 года в соответствии со сроками, установленными в проспектах эмиссии ценных бумаг, произошло погашение основного долга по облигациям на общую сумму 31,3 млрд. тенге, в том числе:

- Евразийский банк развития на сумму 20,0 млрд. тенге;
- АО «First Heartland Jysan Bank» на сумму 9,6 млрд. тенге;

¹ Ноты и депозиты НБРК, «Обратное репо» под залог ГЦБ РК

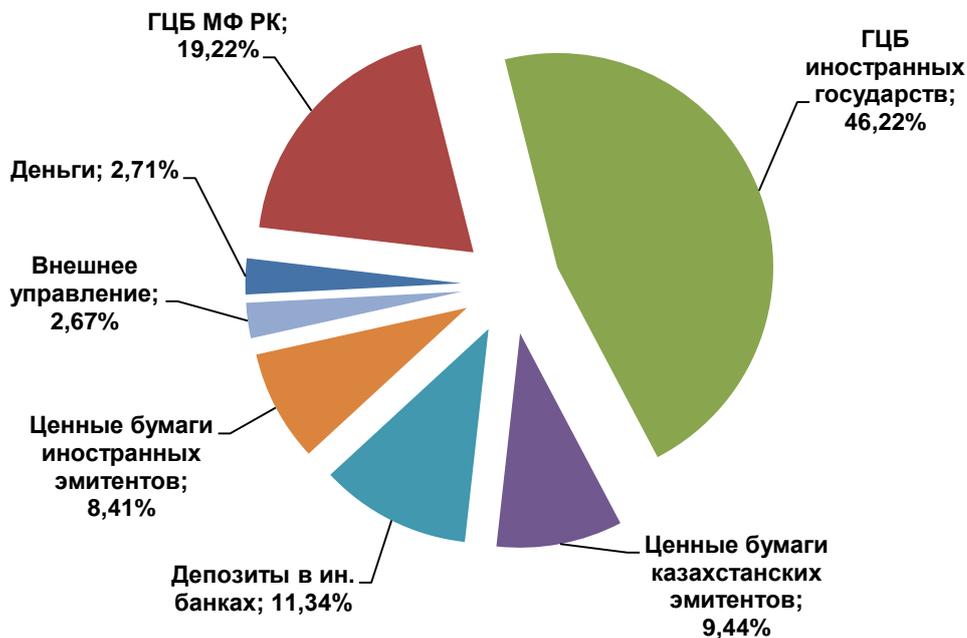
– ДБ АО «Сбербанк» на сумму 1,7 млрд. тенге.

В соответствии с условиями, установленными в договорах банковского вклада, произведены также досрочные частичные погашения основного долга по депозитам БВУ РК на общую сумму 2,9 млрд. тенге.

Портфель пенсионных активов, номинированных в иностранной валюте.

Пенсионные активы ЕНПФ, номинированные в иностранной валюте, инвестируются в соответствии с общей структурой и стратегией инвестирования валютных активов, установленных Инвестиционной декларацией ЕНПФ.

Структура валютного портфеля



Инвестиции в иностранной валюте. В августе 2019 года объем инвестирования пенсионных активов, номинированных в иностранной валюте, составил **633,0 млрд. тенге**. На указанный объем приобретены ГЦБ Правительства США со средневзвешенной доходностью 2,0% годовых.

В рассматриваемом периоде свободные денежные средства в иностранной валюте также размещались в краткосрочные депозиты иностранных банков, имеющих рейтинговые оценки не ниже «А-». При этом данные инвестиции не являются стратегической целью инвестирования и осуществляются в рамках управления текущей ликвидностью для поддержания доходности пенсионных активов.

Погашения и продажи в иностранной валюте.

В августе 2019 года в соответствии со сроками, установленными в проспектах эмиссии ценных бумаг, произошло погашение основного долга по ГЦБ Правительства США на сумму 154,8 млрд. тенге.

Результаты инвестиционной деятельности. Размер начисленного инвестиционного дохода с начала 2019 года составил **465,1 млрд. тенге**. Доходность пенсионных активов, распределенная на счета вкладчиков (получателей) с начала 2019 года, составила 4,44%.

При этом по состоянию на 1 сентября 2019 года доходность пенсионных активов за последние 12 месяцев (с сентября 2018 года по август 2019 года) для вкладчиков (получателей) ЕНПФ составила **8,32%** при инфляции в размере 5,5%. Таким образом, за последние 12 месяцев реальная доходность по пенсионным активам ЕНПФ составила **2,82%**.

Более подробную информацию представители СМИ могут получить по телефону:

+7 (727) 2704 591 (1452)

e-mail: press@nationalbank.kz

www.nationalbank.kz