



НАЦИОНАЛЬНЫЙ БАНК КАЗАХСТАНА

ИНФОРМАЦИОННОЕ СООБЩЕНИЕ

27 ноября 2019 года

Краткий обзор инвестиционной деятельности по пенсионным активам ЕНПФ за октябрь 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.

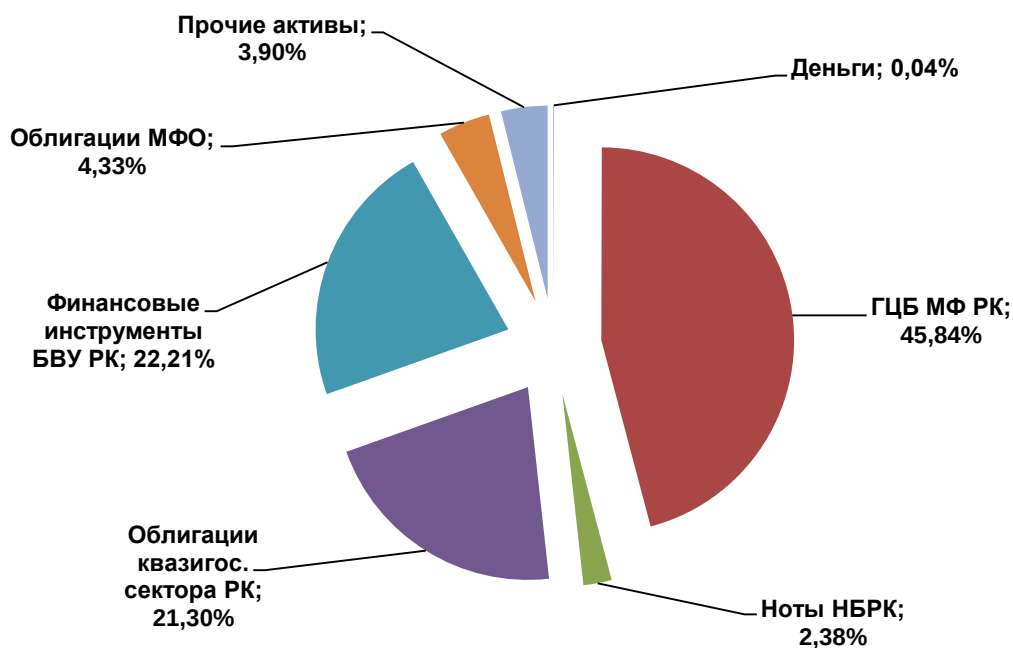
По состоянию на 1 ноября 2019 года объем портфеля пенсионных активов ЕНПФ составил **10 564,4 млрд. тенге**. Денежные средства и финансовые инструменты, номинированные в тенге, составили **6 949,8 млрд. тенге** или 65,8%, номинированные в иностранной валюте – **3 614,6 млрд. тенге** или 34,2%.



*с учетом валюты, полученной в рамках сделок валютного свопа

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.

Структура тенгового портфеля



Инвестиции в тенге. В октябре 2019 года объем инвестирования пенсионных активов, номинированных в тенге, составил **192,03 млрд. тенге** (без учета инвестиций в инструменты денежного рынка¹), в том числе:

- приобретены ГЦБ Министерства финансов РК на общую сумму 12,88 млрд. тенге со средневзвешенной доходностью 9,6% годовых;
- приобретены облигации АО «НК «КТЖ» на сумму 170,0 млрд. тенге с доходностью 11,5% годовых;
- приобретены облигации АО «ДБ «Альфа-Банк» на сумму 7,50 млрд. тенге и АО «Аграрная кредитная корпорация» на сумму 1,65 млрд. тенге с доходностью 10,75% годовых в рамках механизма кредитования приоритетных проектов через БВУ РК 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 в тенге. В октябре 2019 года в соответствии со сроками, установленными в проспектах эмиссии ценных бумаг, произошло погашение основного долга по облигациям на общую сумму 29,9 млрд. тенге, в том числе:

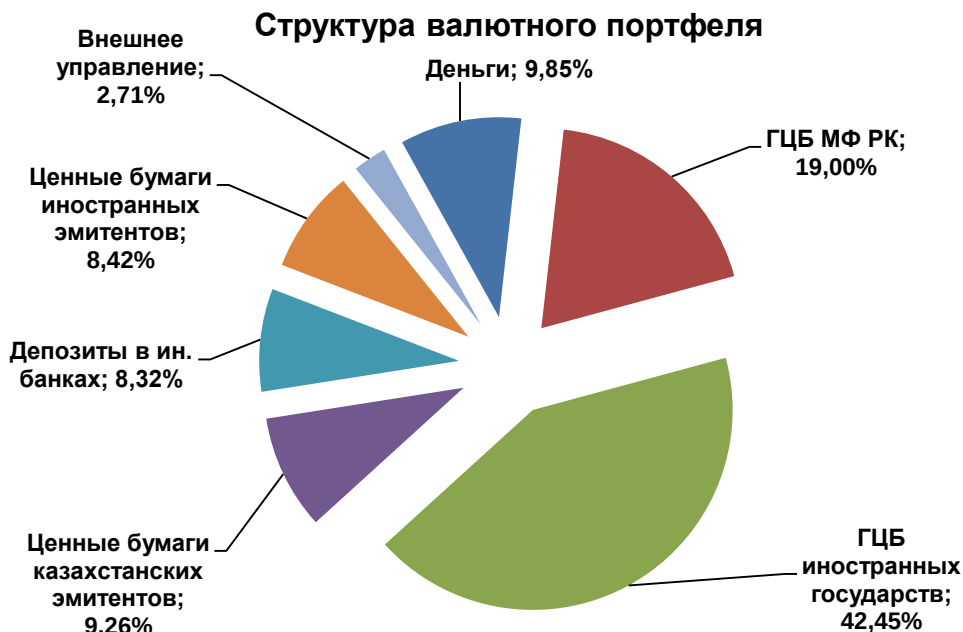
- Евразийский банк развития на сумму 19,9 млрд. тенге;
- АО «Ипотечная организация «Баспана» на сумму 10,0 млрд. тенге.

В соответствии с условиями, установленными в договорах банковского вклада, произведены погашения основного долга и досрочные частичные погашения основного долга по депозитам БВУ РК на общую сумму 2,5 млрд. тенге.

Портфель пенсионных активов, номинированных в иностранной валюте.

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

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



Инвестиции в иностранной валюте. В октябре 2019 года объем инвестирования пенсионных активов, номинированных в иностранной валюте, составил **267,6 млрд. тенге**.

В отчетном периоде были приобретены краткосрочные ГЦБ США в объеме **238,5 млрд. тенге** со средневзвешенной доходностью 1,65% годовых.

В рассматриваемом периоде были заключены сделки купли-продажи с ГЦБ следующих стран: Российской Федерации, Филиппин, Перу, Индонезии, Мексики, Бразилии. Объем нетто-продаж за рассматриваемый период составил 131,0 млрд. тенге.

В рассматриваемом периоде были заключены сделки валютного свопа USD/JPY объемом 327,0 млн. долларов США на срок от 6 до 9 месяцев с рядом крупных международных инвестиционных банков с кредитным рейтингом «А» и выше. Данные сделки были заключены на рыночных условиях с целью повышения доходности пенсионных активов. В рамках данных сделок в портфель пенсионных активов ЕНПФ были получены 35,3 млрд. японских йен.

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 октябре 2019 года в соответствии со сроками, установленными в проспектах эмиссии ценных бумаг, произошло погашение основного долга по ГЦБ Правительства США на сумму **208,3 млрд. тенге**.

Результаты инвестиционной деятельности. Размер начисленного инвестиционного дохода с начала 2019 года составил **599,3 млрд. тенге**. Доходность пенсионных активов, распределенная на счета вкладчиков (получателей) с начала 2019 года, составила 5,67%.

При этом по состоянию на 1 ноября 2019 года доходность пенсионных активов за последние 12 месяцев (с ноября 2018 года по октябрь 2019 года) для вкладчиков

(получателей) ЕНПФ составила **8,0%** при инфляции в размере 5,5%. Таким образом, за последние 12 месяцев реальная доходность по пенсионным активам ЕНПФ составила **2,5%**.

Более подробную информацию представители СМИ могут получить по телефону:

+7 (727) 2704 591 (3930)

+7 (727) 330 24 52 (1452)

e-mail: press@nationalbank.kz

www.nationalbank.kz