



ИНФОРМАЦИОННОЕ СООБЩЕНИЕ

26 декабря 2018 года

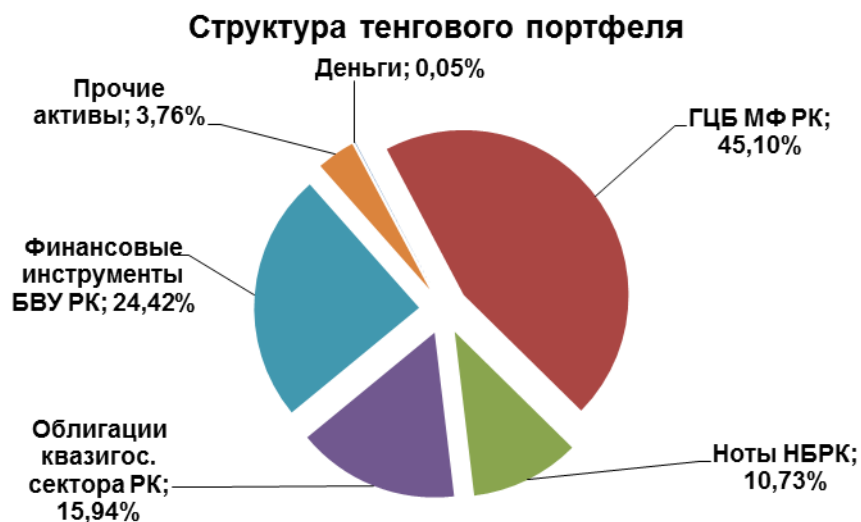
Краткий обзор инвестиционной деятельности по пенсионным активам ЕНПФ за ноябрь 2018 года

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 декабря 2018 года объем портфеля пенсионных активов ЕНПФ составил **9 135,2 млрд. тенге**, в том числе денежные средства и финансовые инструменты, номинированные в тенге, составили **6 287,8 млрд. тенге** или 68,8%, номинированные в иностранной валюте – **2 847,4 млрд. тенге** или 31,2%.



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. В 2018 году указанным Советом одобрены такие направления инвестирования пенсионных активов ЕНПФ, как приобретение государственных ценных бумаг Республики Казахстан, покупка иностранной валюты для диверсификации портфеля, приобретение ценных бумаг международных финансовых организаций, субъектов квазигосударственного сектора, банков второго уровня и других корпоративных казахстанских эмитентов.



Инвестиции в тенге. В ноябре 2018 года объем инвестирования пенсионных активов, номинированных в тенге, составил **462,1 млрд. тенге** (без учета инвестиций в инструменты денежного рынка¹), в том числе:

- приобретены облигации АО «НУХ «КазАгро» на сумму 450,0 млрд. тенге с доходностью 10,0% годовых;
- приобретены облигации Евразийского банка развития на сумму 5,0 млрд. тенге с доходностью 9,7% годовых;
- приобретены облигации банков второго уровня на общую сумму 7,1 млрд. тенге со средневзвешенной доходностью 11,4% годовых в рамках объявленной программы по финансированию банков второго уровня РК для поддержки экономики на сумму 200 млрд. тенге.

В рассматриваемом периоде 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 ноябре 2018 года в соответствии с установленными сроками произошло погашение облигаций банков второго уровня на сумму 12,1 млрд. тенге.

В рассматриваемом периоде по инициативе банков второго уровня в соответствии с условиями, установленными в договорах банковского вклада, произведены досрочные частичные погашения основного долга по депозитам на общую сумму 2,9 млрд. тенге.

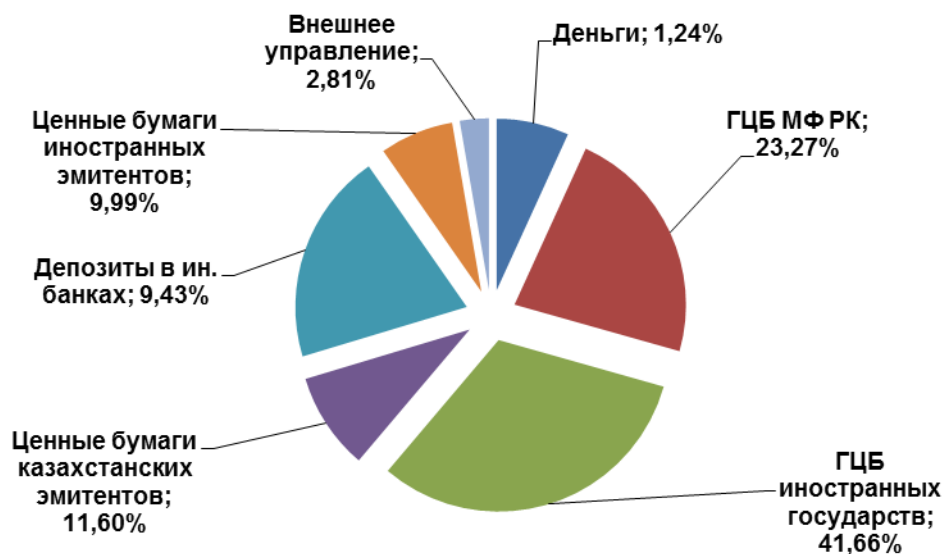
Продаж ценных бумаг в отчетном периоде не было.

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.

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

Структура валютного портфеля



Инвестиции в иностранной валюте. В ноябре 2018 года объем инвестирования пенсионных активов, номинированных в иностранной валюте, составил **233,9 млрд. тенге**, в том числе:

- приобретены краткосрочные государственные ценные бумаги США на сумму 174,1 млрд. тенге с доходностью 2,4% годовых;
- приобретены государственные ценные бумаги Филиппин, номинированные в долларах США, на сумму 2,6 млрд. тенге со средневзвешенной доходностью 4,4% годовых;
- приобретены государственные ценные бумаги Чили, номинированные в долларах США, на сумму 1,0 млрд. тенге с доходностью 3,8% годовых;
- приобретены депозитарные расписки АО «НАК «Казатомпром» на сумму 56,1 млрд. тенге.

Погашения и продажи в иностранной валюте. В ноябре 2018 года в соответствии с установленными сроками осуществлено погашение основного долга по государственным ценным бумагам США на сумму 243,8 млрд. тенге.

Продаж ценных бумаг в отчетном периоде не было.

Результаты инвестиционной деятельности. За 11 месяцев 2018 года размер начисленного инвестиционного дохода составил **800,19 млрд. тенге**.

При этом по состоянию на 1 декабря 2018 года доходность пенсионных активов за последние 12 месяцев (с декабря 2017 года по ноябрь 2018 года) для вкладчиков (получателей) ЕНПФ составила **10,0%** при инфляции в размере 5,3%. Таким образом, за последние 12 месяцев реальная доходность по пенсионным активам ЕНПФ составила **4,7%**.

Более подробную информацию представители СМИ могут получить по телефону:

+7 (727) 704 585

e-mail: press@nationalbank.kz

www.nationalbank.kz