



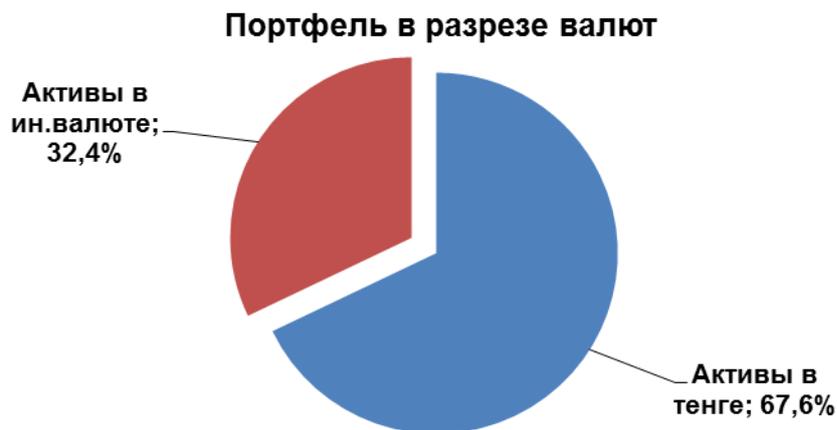
ИНФОРМАЦИОННОЕ СООБЩЕНИЕ

26 февраля 2019 года

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

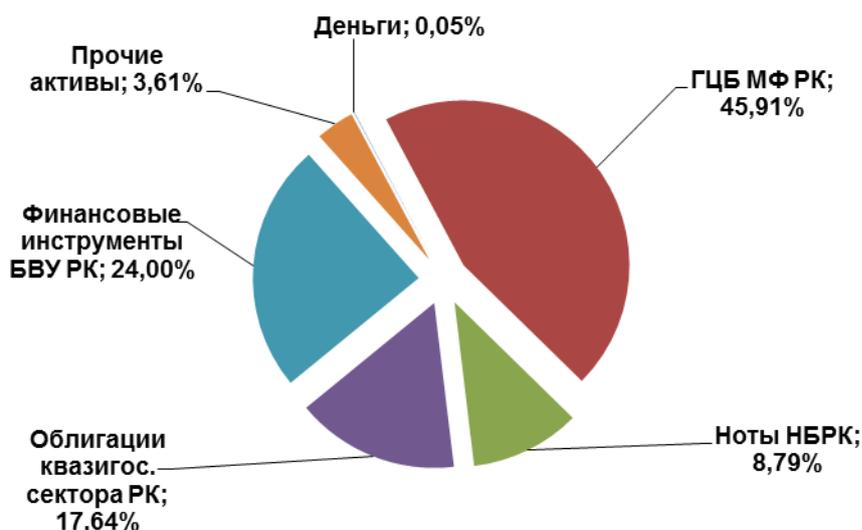
Общий портфель. В соответствии со стратегией инвестирования пенсионных активов ЕНПФ в целях диверсификации инвестиционного портфеля, направленной на обеспечение сохранности и доходности, пенсионные активы инвестируются в различные виды финансовых инструментов по валютам, странам, секторам и эмитентам.

По состоянию на 1 февраля 2019 года объем портфеля пенсионных активов ЕНПФ составил **9 436,9 млрд. тенге**. Денежные средства и финансовые инструменты, номинированные в тенге, составили **6 380,3 млрд. тенге** или 67,6%, номинированные в иностранной валюте – **3 056,7 млрд. тенге** или 32,4%.



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 январе 2019 года объем инвестирования пенсионных активов, номинированных в тенге, составил **60,6 млрд. тенге** (без учета инвестиций в инструменты денежного рынка¹), в том числе:

- ГЦБ Министерства финансов РК на сумму 45,4 млрд. тенге со средневзвешенной доходностью 8,7% годовых;
- облигации Азиатского банка развития на сумму 15,2 млрд. тенге с доходностью, равной инфляции и премии в размере 1,15% годовых.

Эмитент	ISIN	Мин. рейтинг эмитента	Доля приобретения от выпуска в обращении, %	Деятельность
Азиатский банк развития	XS1937714597	AAA	50	Институт развития, созданный для стимулирования экономического роста и региональной интеграции в Азии и Тихоокеанском регионе.
	XS1937714753		50	

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 январе 2019 года в соответствии со сроками, установленными в проспектах эмиссии ценных бумаг, произошло погашение основного долга на общую сумму 5,7 млрд. тенге, в том числе:

- АО «ИО «КИК» на сумму 4,0 млрд. тенге;

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

- АО «Евразийский Банк» на сумму 0,14 млрд. тенге;
- ГЦБ Министерства финансов РК на сумму 1,0 млрд. тенге;
- АО «Абди Компани» на сумму 0,6 млрд. тенге (в соответствии с соглашением о реструктуризации задолженности).

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 2,6 млрд. тенге.

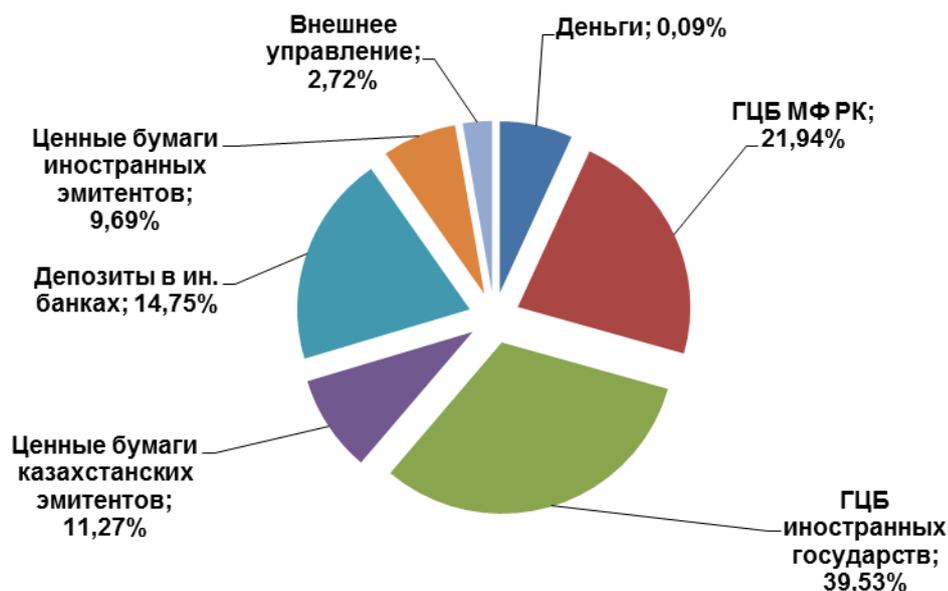
В отчетном периоде были проданы следующие ценные бумаги:

- облигации АО «АстанаГаз КМГ» на сумму 3,0 млрд. тенге;
- облигации АО «Батыс Транзит» на сумму 11,2 млрд. тенге;
- простые акции АО «Цеснабанк» на сумму 5,9 млрд. тенге;
- депозитарные расписки АО «НАК «Казатомпром» на сумму 0,3 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 январе 2019 года объем инвестирования пенсионных активов, номинированных в иностранной валюте, составил **269,6 млрд. тенге**. На указанный объем приобретены ГЦБ Правительства США со средневзвешенной доходностью 2,4% годовых.

Погашения и продажи в иностранной валюте. В январе 2019 года в соответствии с установленными сроками осуществлено погашение основного долга по государственным ценным бумагам США на сумму 240,7 млрд. тенге.

Продаж ценных бумаг не было.

Результаты инвестиционной деятельности. За январь 2019 год размер начисленного инвестиционного дохода составил **18,56 млрд. тенге**. Доходность пенсионных активов за январь 2019 года составил 0,16%.

При этом по состоянию на 1 февраля 2019 года доходность пенсионных активов за последние 12 месяцев (с февраля 2018 года по январь 2019 года) для вкладчиков (получателей) ЕНПФ составила **11,31%** при инфляции в размере 5,20%. Таким образом, за последние 12 месяцев реальная доходность по пенсионным активам ЕНПФ составила **6,11%**.

Более подробную информацию представители СМИ могут получить по телефону:

+7 (727) 704 585

e-mail: press@nationalbank.kz

www.nationalbank.kz