



ИНФОРМАЦИОННОЕ СООБЩЕНИЕ

26 июня 2018 года

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

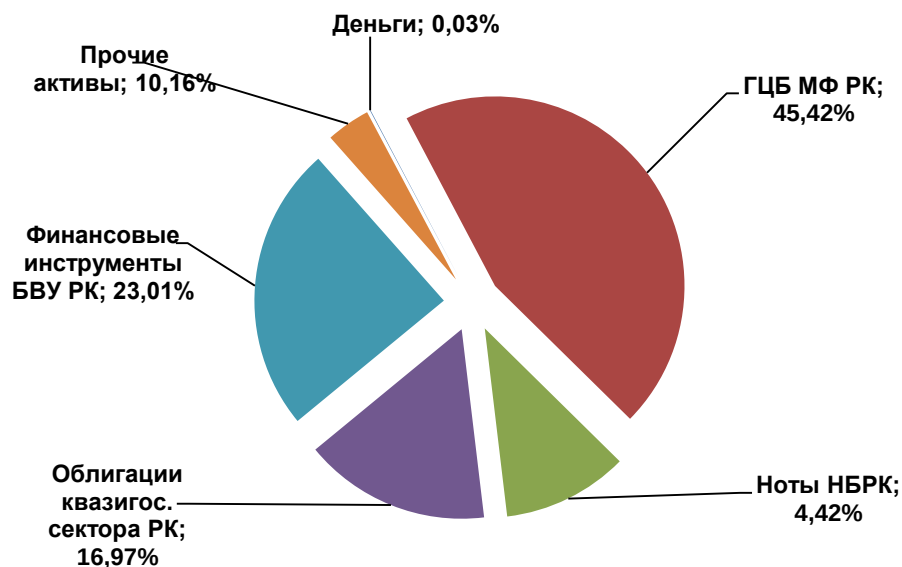
Общий портфель. В соответствии со стратегией инвестирования пенсионных активов ЕНПФ в целях диверсификации инвестиционного портфеля, направленной на обеспечение сохранности и доходности, пенсионные активы инвестируются в различные виды финансовых инструментов по валютам, странам, секторам и эмитентам.

По состоянию на 1 июня 2019 года объем портфеля пенсионных активов ЕНПФ составил **9 899,1 млрд. тенге**. Денежные средства и финансовые инструменты, номинированные в тенге, составили **6 726,3 млрд. тенге** или 67,9%, номинированные в иностранной валюте – **3 172,8 млрд. тенге** или 32,1%.



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 мае 2019 года объем инвестирования пенсионных активов, номинированных в тенге, составил **89,2 млрд. тенге** (без учета инвестиций в инструменты денежного рынка¹), в том числе:

- приобретены ГЦБ Министерства финансов РК на сумму 48,0 млрд. тенге со средневзвешенной доходностью 8,7% годовых;
- приобретены облигации Европейского Банка Реконструкции и Развития на сумму 30,0 млрд. тенге с доходностью, равной инфляции и премии в размере 1,0% годовых;
- приобретены облигации Евразийского банка развития на сумму 11,2 млрд. тенге со средневзвешенной доходностью 9,5% годовых.

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.

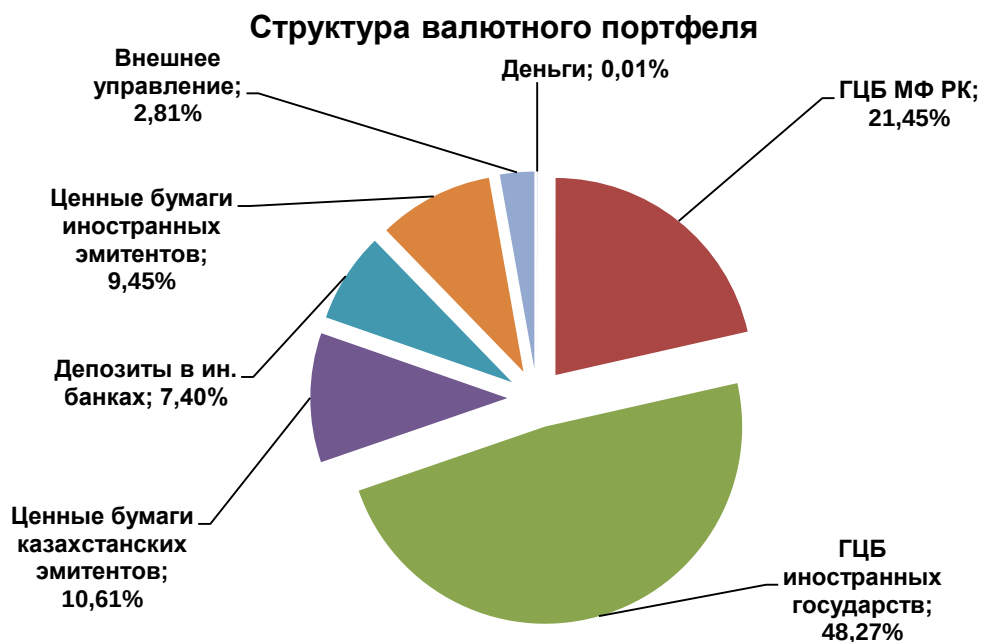
Погашения и продажи в тенге. В мае 2019 года в соответствии с условиями, установленными в проспекте эмиссии ценных бумаг, произошла выплата основного долга по облигациям АО «Банк ЦентрКредит» на сумму 15,0 млрд. тенге, а также реализованы облигации АО «Евразийский Банк» на сумму 19,8 млрд. тенге.

В рассматриваемом периоде в соответствии с условиями, установленными в договорах банковского вклада, произведены досрочные частичные погашения основного долга по депозитам БВУ РК на общую сумму 1,3 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.

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



Инвестиции в иностранной валюте. В мае 2019 года объем инвестирования пенсионных активов, номинированных в иностранной валюте, составил **308,8 млрд. тенге**. На указанный объем приобретены ГЦБ Правительства США со средневзвешенной доходностью 2,4% годовых.

Погашения и продажи в иностранной валюте.

В апреле 2019 года в соответствии со сроками, установленными в проспектах эмиссии ценных бумаг, произошло погашение основного долга по ГЦБ Правительства США и ГЦБ Правительства РФ, номинированным в российских рублях, на сумму 263,4 млрд. тенге и 9,6 млрд. тенге соответственно.

В отчетном периоде была реализована часть депозитарных расписок АО «НАК «Казатомпром» на сумму 0,4 млрд. тенге (0,9 млн. долларов США).

Результаты инвестиционной деятельности. Размер начисленного инвестиционного дохода с начала 2019 года составил **250,1 млрд. тенге**. Доходность пенсионных активов, распределенная на счета вкладчиков (получателей) с начала 2019 года, составила 2,37%.

При этом по состоянию на 1 июня 2019 года доходность пенсионных активов за последние 12 месяцев (с июня 2018 года по май 2019 года) для вкладчиков (получателей) ЕНПФ составила **10,6%** при инфляции в размере 5,3%. Таким образом, за последние 12 месяцев реальная доходность по пенсионным активам ЕНПФ составила **5,3%**.

Более подробную информацию представители СМИ могут получить по телефону:

+7 (727) 2704 585

e-mail: press@nationalbank.kz

www.nationalbank.kz