



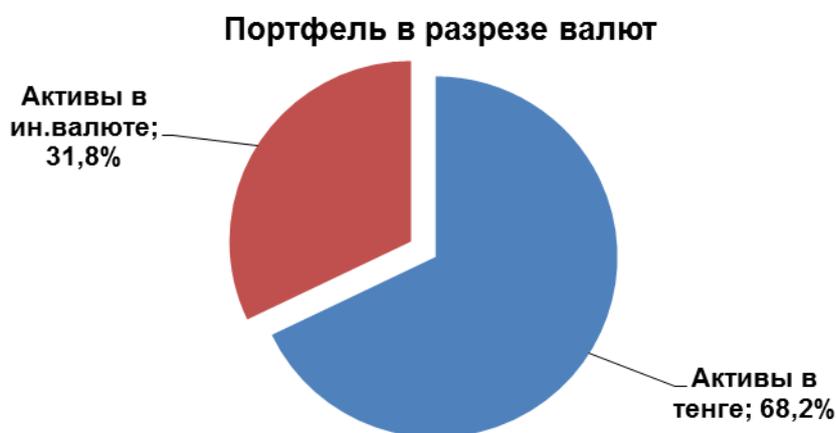
ИНФОРМАЦИОННОЕ СООБЩЕНИЕ

26 июля 2019 года

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

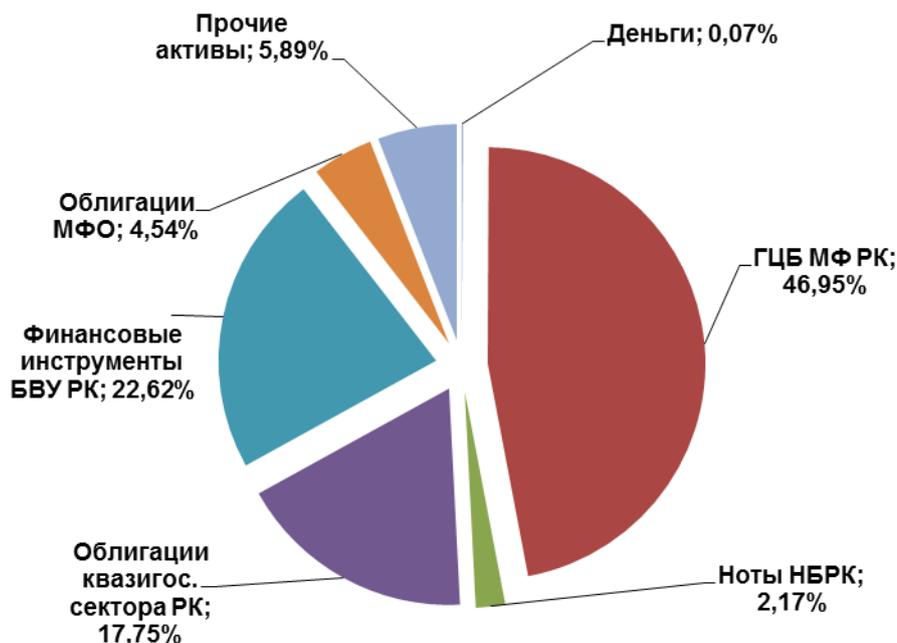
Общий портфель. В соответствии со стратегией инвестирования пенсионных активов ЕНПФ в целях диверсификации инвестиционного портфеля, направленной на обеспечение сохранности и доходности, пенсионные активы инвестируются в различные виды финансовых инструментов по валютам, странам, секторам и эмитентам.

По состоянию на 1 июля 2019 года объем портфеля пенсионных активов ЕНПФ составил **9 995,5 млрд. тенге**. Денежные средства и финансовые инструменты, номинированные в тенге, составили **6 819,7 млрд. тенге** или 68,2%, номинированные в иностранной валюте – **3 175,8 млрд. тенге** или 31,8%.



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 июне 2019 года объем инвестирования пенсионных активов, номинированных в тенге, составил **239,4 млрд. тенге** (без учета инвестиций в инструменты денежного рынка¹), в том числе:

- приобретены ГЦБ Министерства финансов РК на сумму 140,0 млрд. тенге со средневзвешенной доходностью 8,6% 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 АО «НУХ «Байтерек» на сумму 20,0 млрд. тенге с доходностью 9,5% годовых;
- приобретены облигации АО «Банк Развития Казахстан» на сумму 11,2 млрд. тенге с доходностью 10,0% годовых;
- приобретены облигации АО «Казактелеком» на сумму 38,2 млрд. тенге с доходностью 11,5% 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.

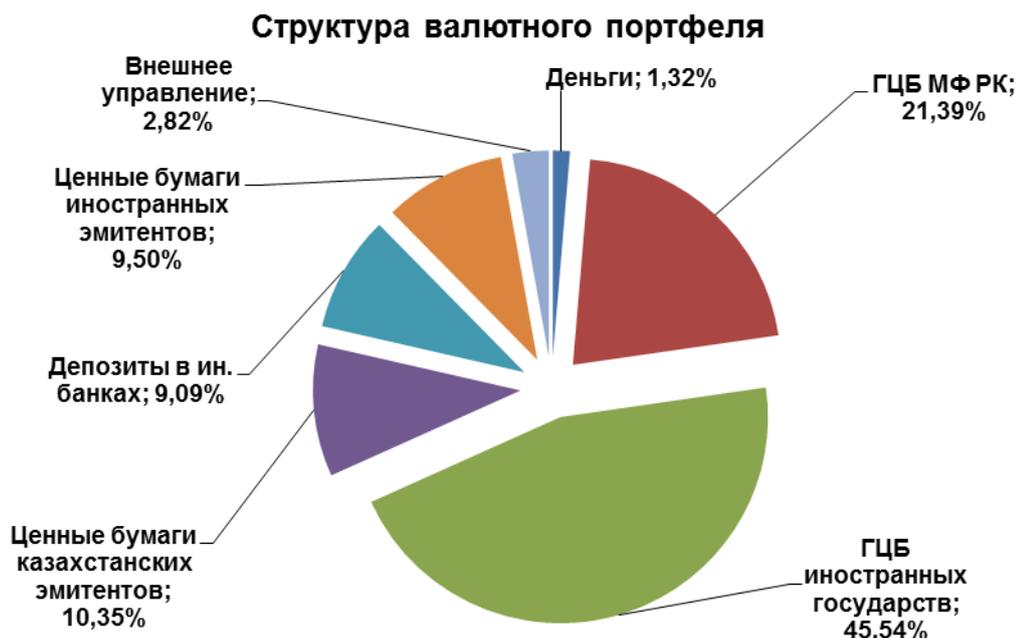
Погашения и продажи в тенге. В июне 2019 года реализована часть облигаций АО «DTJ» на сумму 1,1 млрд. тенге.

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 0,4 млрд. тенге.

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

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.



Инвестиции в иностранной валюте. В июне 2019 года объем инвестирования пенсионных активов, номинированных в иностранной валюте, составил **135,6 млрд. тенге**. На указанный объем приобретены ГЦБ Правительства США со средневзвешенной доходностью 2,2% годовых.

Погашения в иностранной валюте.

В июне 2019 года в соответствии со сроками, установленными в проспектах эмиссии ценных бумаг, произошло погашение основного долга по ГЦБ Правительства США на сумму 215,5 млрд. тенге, а также произошло частичное погашение основного долга по международным облигациям АО «ForteBank» на сумму 0,06 млрд. тенге.

Результаты инвестиционной деятельности. Размер начисленного инвестиционного дохода с начала 2019 года составил **285,2 млрд. тенге**. Доходность пенсионных активов, распределенная на счета вкладчиков (получателей) с начала 2019 года, составила 2,69%.

При этом по состоянию на 1 июля 2019 года доходность пенсионных активов за последние 12 месяцев (с июля 2018 года по июнь 2019 года) для вкладчиков (получателей) ЕНПФ составила **9,36%** при инфляции в размере 5,4%. Таким образом, за последние 12 месяцев реальная доходность по пенсионным активам ЕНПФ составила **3,96%**.

Более подробную информацию можно получить по телефону:

+7 (727) 2704591 (вн. 5556)

e-mail: press@nationalbank.kz

www.nationalbank.kz