



## ИНФОРМАЦИОННОЕ СООБЩЕНИЕ

25 октября 2019 года

### Краткий обзор инвестиционной деятельности по пенсионным активам ЕНПФ за сентябрь 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.

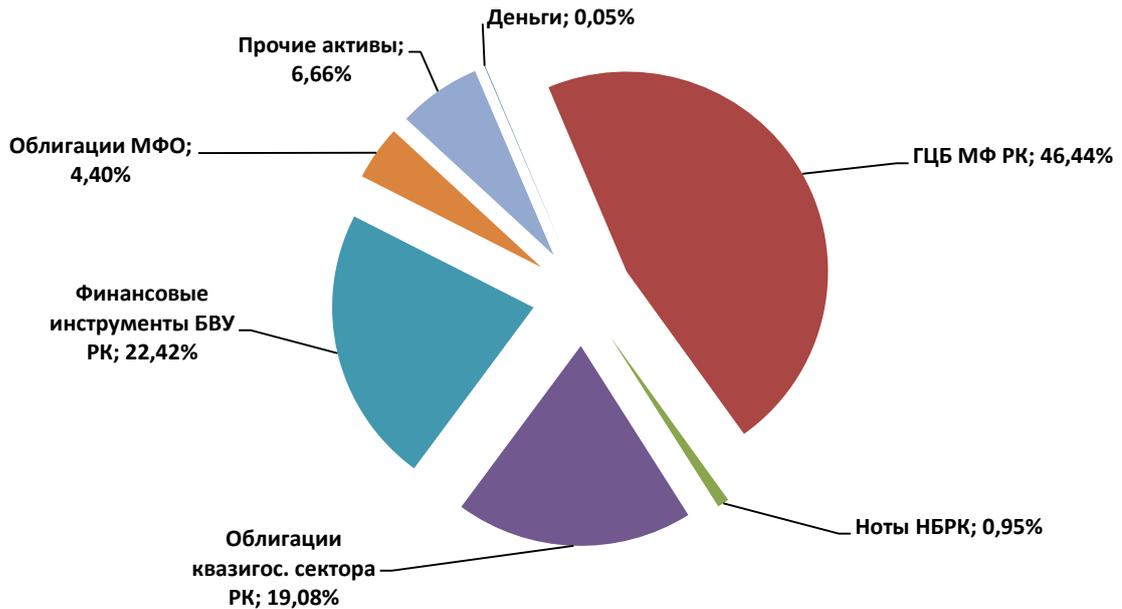
По состоянию на 1 октября 2019 года объем портфеля пенсионных активов ЕНПФ составил **10 426,3 млрд. тенге**. Денежные средства и финансовые инструменты, номинированные в тенге, составили **6 850,6 млрд. тенге** или 65,7%, номинированные в иностранной валюте – **3 575,7 млрд. тенге** или 34,3%.



\*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 сентябре 2019 года объем инвестирования пенсионных активов, номинированных в тенге, составил **55,3 млрд. тенге** (без учета инвестиций в инструменты денежного рынка<sup>1</sup>), в том числе:

- приобретены ГЦБ Министерства финансов РК на общую сумму 20,3 млрд. тенге со средневзвешенной доходностью 8,9% годовых;
- приобретены облигации АО «НК «КТЖ» на сумму 20,0 млрд. тенге с доходностью 11,5% годовых;
- приобретены облигации АО «Банк «Bank RBK» на сумму 15,0 млрд. тенге с доходностью 10,95% 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.

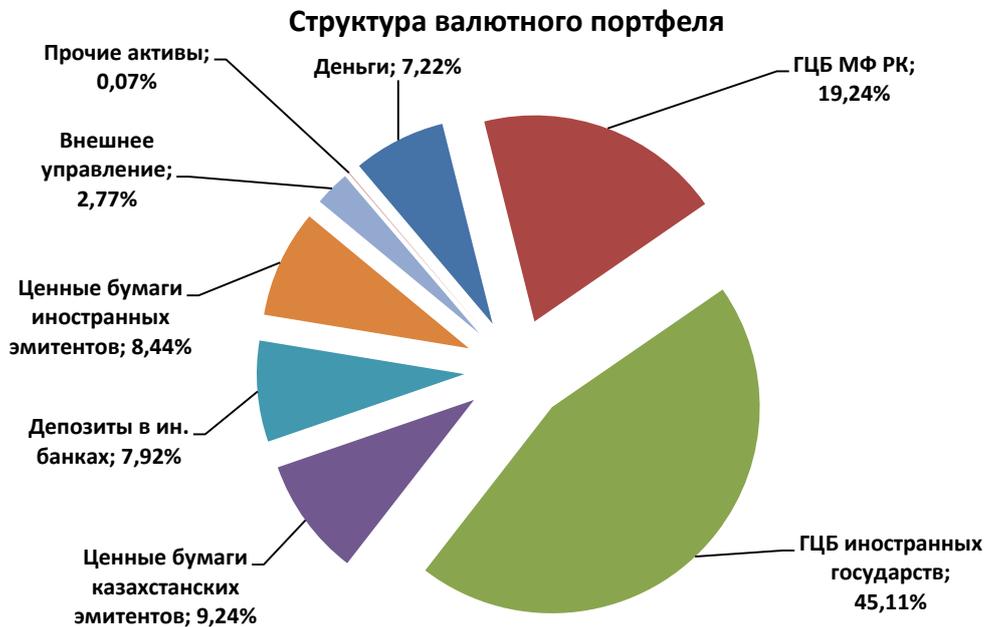
**Погашения в тенге.** В сентябре 2019 года в соответствии со сроками, установленными в проспектах эмиссии ценных бумаг, произошло погашение основного долга по ГЦБ Министерства финансов РК на общую сумму 16,9 млрд. тенге.

В соответствии с условиями, установленными в договорах банковского вклада, произведены также досрочные частичные погашения основного долга по депозитам БВУ РК на общую сумму 1,4 млрд. тенге.

<sup>1</sup> Ноты и депозиты НБРК, «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 сентябре 2019 года объем инвестирования пенсионных активов, номинированных в иностранной валюте, составил **211,4 млрд. тенге**. На указанный объем приобретены ГЦБ Правительства США со средневзвешенной доходностью 1,9% годовых.

В рассматриваемом периоде были заключены сделки валютного свопа USD/EUR объемом 440,0 млн. долларов США на срок от 6 до 9 месяцев. В рамках данных сделок в портфель пенсионных активов ЕНПФ были получены 398,2 млн. евро.

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 сентябре 2019 года в соответствии со сроками, установленными в проспектах эмиссии ценных бумаг, произошло погашение основного долга по ГЦБ Правительства США на сумму 169,0 млрд. тенге. Также были реализованы краткосрочные ГЦБ США на общую сумму 78,8 млрд. тенге.

**Результаты инвестиционной деятельности.** Размер начисленного инвестиционного дохода с начала 2019 года составил **525,2 млрд. тенге**. Доходность пенсионных активов, распределенная на счета вкладчиков (получателей) с начала 2019 года, составила 4,98%.

При этом по состоянию на 1 октября 2019 года доходность пенсионных активов за последние 12 месяцев (с октября 2018 года по сентябрь 2019 года) для вкладчиков (получателей) ЕНПФ составила **8,4%** при инфляции в размере 5,3%. Таким образом, за последние 12 месяцев реальная доходность по пенсионным активам ЕНПФ составила **3,1%**.

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](mailto:press@nationalbank.kz)

[www.nationalbank.kz](http://www.nationalbank.kz)