

ИНФОРМАЦИОННОЕ СООБЩЕНИЕ

22 апреля 2020

Инвестиционный портфель пенсионных активов ЕНПФ по состоянию на 1 апреля 2020 года

Подробный отчет об управлении пенсионными активами размещен на сайте enpf.kz

Доходность пенсионных активов остается положительной

Алматы, Казахстан – По состоянию на 1 апреля 2020 года пенсионные активы ЕНПФ, находящиеся в доверительном управлении Национального Банка Республики Казахстан, составили 11 679,12 млрд. тенге, увеличившись с начала года на 881 млрд тенге. За период управления пенсионными активами ЕНПФ, осуществляемого Национальным Банком РК с сентября 2013^[1] года, инвестиционный доход в структуре пенсионных накоплений граждан, составил порядка 30% или 3,9 трлн тенге.

Подробная информация об инвестиционной деятельности по управлению портфелем пенсионных активов размещена на официальном сайте ЕНПФ в разделе «Показатели»-«Инвестиционная деятельность»

<https://www.enpf.kz/upload/medialibrary/c34/c3419bf8f94bbe1019f9afe924a0f6ea.pdf>.

Доходность пенсионных активов за последние 12 месяцев (с апреля 2019 года по март 2020 года) для вкладчиков (получателей) ЕНПФ составила 11,87% при инфляции в размере 6,4 %. Т.е. за последние 12 месяцев реальная доходность по пенсионным активам ЕНПФ является положительной и составила 5,5 %.

В результате инвестиционной деятельности, а также вследствие волатильности курсов иностранных валют и изменения рыночной стоимости финансовых инструментов, размер начисленного инвестиционного дохода с начала 2020 года составил 667,73 млрд. тенге

Структура начисленного инвестиционного дохода выглядит следующим образом:

- доходы в виде вознаграждения по ценным бумагам, в том числе по размещенным вкладам и операциям «обратное РЕПО» 183,19 млрд тенге;
- доходы (убытки) от рыночной переоценки ценных бумаг (18,49) млрд тенге;
- доходы (убытки) от переоценки иностранной валюты 523,19 млрд тенге;
- доходы от переоценки прочих активов (ПФИ) (80,07) млрд тенге;
- доходы (убытки) по активам, находящимся во внешнем управлении 59,78 млрд тенге;
- прочие доходы составили 0,13 млрд тенге.

Инвестиционный портфель финансовых инструментов в разрезе валют, в которые номинированы финансовые инструменты, приобретенные за счет пенсионных активов ЕНПФ, представлен следующим образом:

инвестиции в национальной валюте – 63,99%, в долларах США – 32,08 %, в других валютах – 3,93 % портфеля пенсионных активов.

В марте наблюдалось укрепление курса доллара США по отношению к тенге с 381 до 448 тенге за 1 доллар США. Соответственно, положительная валютная переоценка пенсионных активов, размещенных в валютные инструменты, обеспечила прирост пенсионных активов.

Наибольшую долю в портфеле пенсионных активов ЕНПФ (36,73%) составили государственные ценные бумаги Республики Казахстан, как стабильный и доходный инструмент инвестирования. Текущая стоимость ГЦБ в портфеле пенсионных активов составила 4 289,30 млрд. тенге, увеличившись с начала года на 9,30%. На отчетную дату средневзвешенная

^[1] с учетом выплаченного инвестиционного дохода при выплатах и переводах пенсионных накоплений

доходность к погашению по ГЦБ РК, номинированным в тенге, составила 8 % годовых, в долларах США – 4,4% годовых.

Облигации квазигосударственных организаций Республики Казахстан на 1 апреля 2020 года составляют 14,86% инвестиционного портфеля пенсионных активов. Текущая стоимость этого вида инструментов составила 1 735,38 млрд тенге. На отчетную дату средневзвешенная доходность к погашению по облигациям квазигосударственных организаций РК, номинированным в тенге, составила 10,5% годовых, в долларах США – 5,0% годовых.

Финансовые инструменты казахстанских банков второго уровня представлены следующим образом: 10,13% портфеля размещено в облигации, средневзвешенная доходность которых составляет 10,0% годовых в национальной валюте и 6,4% в долларах США; доля депозитов составляет 2,15% со средневзвешенной доходностью 9,1% годовых в тенге.

Структурное распределение портфеля пенсионных активов ЕНПФ, находящихся в доверительном управлении, соответствует требованиям Инвестиционной декларации ЕНПФ. Диверсификация инвестиций пенсионных накоплений в надежные финансовые инструменты в различных валютах обеспечивает защиту от рисков валютной и рыночной переоценки. При этом поскольку инвестирование пенсионных активов осуществляется в длительном временном промежутке (от года и более), их доходность должна оцениваться в долгосрочной перспективе.

ЕНПФ создан 22 августа 2013 года на базе АО «НПФ «ГНПФ». Учредителем и акционером ЕНПФ является Правительство Республики Казахстан в лице ГУ «Комитет государственного имущества и приватизации» Министерства финансов Республики Казахстан. Доверительное управление пенсионными активами ЕНПФ осуществляет Национальный Банк Республики Казахстан. С 1 января 2016 года функции по выработке предложений по повышению эффективности управления пенсионными активами переданы Совету по управлению Национальным фондом. В соответствии с пенсионным законодательством ЕНПФ осуществляет привлечение обязательных пенсионных взносов, обязательных профессиональных пенсионных взносов, добровольных пенсионных взносов, пенсионные выплаты, индивидуальный учет пенсионных накоплений и выплат, предоставляет вкладчику (получателю) информацию о состоянии его пенсионных накоплений (подробнее на www.enpf.kz).