

ИНФОРМАЦИОННОЕ СООБЩЕНИЕ

В какие инструменты вложены пенсионные активы казахстанцев?

Инвестиционные портфели пенсионных активов под управлением НБРК и УИП по состоянию на 1 февраля 2022 года

Общий объем пенсионных активов, находящихся в управлении на 1 февраля 2022 года, составили 13,1 трлн тенге. Пенсионные активы ЕНПФ, [находящиеся в доверительном управлении НБРК](#), составили 13 096,03 млрд тенге. [Пенсионные активы под управлением УИП](#) составили 7,7 млрд тенге.

Подробная информация об инвестировании пенсионных активов Национальным Банком Республики Казахстана (НБРК) и управляющими инвестиционным портфелем (УИП), а также обзоры инвестиционной деятельности по состоянию на 1 февраля 2022 года размещены на сайте enpf.kz в разделе «Показатели – Инвестиционная деятельность».

Инвестиционный портфель пенсионных активов под управлением НБРК

На 1 февраля 2022 года в рамках направлений, одобренных Советом по управлению Национальным фондом РК, основные инвестиции НБРК (как доверительным управляющим) в финансовые инструменты представлены [следующим образом](#):

- государственные ценные бумаги РК, выпущенные Министерством финансов РК, текущая стоимость которых составляет 5 106,21 млрд тенге (38,99% от всего портфеля). Средневзвешенная доходность к погашению по ГЦБ Министерства финансов РК, номинированным в тенге, составила 9,4% годовых, в долларах США – 3,4% годовых.

- государственные ценные бумаги иностранных государств составили 2 257,71 млрд тенге. Их доля в портфеле составила 17,24%. Средневзвешенная доходность к погашению ГЦБ иностранных государств в портфеле ПА ЕНПФ на отчетную дату составила 1,6% годовых.

- облигации квазигосударственных организаций РК (текущая стоимость 1 676,01 млрд тенге (доля в портфеле составила 12,80%). Средневзвешенная доходность к погашению по облигациям квазигосударственных организаций РК, номинированным в тенге, составила 10,8% годовых, в долларах США – 5,5% годовых.

- облигации банков второго уровня РК на сумму 949,57 млрд тенге (7,25%). На отчетную дату средневзвешенная доходность к погашению по облигациям БВУ РК составила 10,2% годовых.

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

инвестиции в национальной валюте – 68,17%, в долларах США – 31,77%, в российских рублях и другой валюте – 0,06% портфеля пенсионных активов.

В результате снижения рынка акций и роста доходностей на облигации как на внешних, так и на внутреннем рынках, произошедших на фоне ожиданий более стремительных темпов ужесточения монетарной политики ФРС, размер начисленного инвестиционного дохода с начала 2022 года составил 12,13 млрд. тенге. По состоянию на 1 февраля 2022 года доходность пенсионных активов за последние 12 месяцев (с февраля 2021 года по январь 2022 года) для вкладчиков (получателей) ЕНПФ составила 9,73% при инфляции в размере 8,50%. Таким образом, за последние 12 месяцев реальная доходность по пенсионным активам ЕНПФ составила 1,23%.

[Подробная структура](#) инвестиционного портфеля финансовых инструментов под управлением НБРК с указанием эмитентов и обзор инвестиционной деятельности размещены на официальном сайте ЕНПФ.

Управляющие инвестиционным портфелем

Общий объем средств, переданных в казахстанские управляющие компании, составляет 7,7 млрд тенге.

Пенсионные активы, находящиеся в доверительном управлении **АО «Jusan Invest»**, составили 3,48 млрд тенге. На них были приобретены: ноты НБРК (36,73% портфеля), паи Exchange Traded Funds (ETF) они составляют 27,83%, ГЦБ Министерства финансов РК (24,75%), активы в денежных средствах на инвестиционных счетах - 10,69%. Отметим, что 66,88% портфеля представлено в тенге, 33,12% в долларах США.

В результате инвестиционной деятельности доходность пенсионных активов с момента передачи в доверительное управление составила 7,36%.

[Подробная структура](#) инвестиционного портфеля финансовых инструментов под управлением АО «Jusan Invest» с указанием эмитентов представлена на сайте ЕНПФ.

Пенсионные активы, находящиеся в доверительном управлении **АО «Halyk Global Markets»**, на 1 февраля 2022 года составили 2,15 млрд тенге. В структуре портфеля операции обратного РЕПО составляют 42,35%, паи ETF (16,54%), облигации квазигосударственных организаций РК (13,93%), акции и депозитарные расписки иностранных эмитентов (8,36%), облигации БВУ (7,19%), корпоративные облигации организаций РК (5,91%), МФО (5,65%), денежные средства на счетах (2,01%), прочие активы (0,02%), обязательства к оплате по совершенным сделкам (1,95%). Инвестиции в национальной валюте составили 75,08% портфеля, в долларах США - 24,92%.

В результате инвестиционной деятельности доходность пенсионных активов с момента передачи в доверительное управление составила 8,00%.

[Подробная структура](#) инвестиционного портфеля финансовых инструментов под управлением АО «Halyk Global Markets» с указанием эмитентов представлена на сайте ЕНПФ.

Пенсионные активы, находящиеся в доверительном управлении **АО «BCC Invest»**, на 1 февраля текущего года составили 1,24 млрд тенге. Они распределены в паи (ETF на индексы) (24,27%), операции обратного РЕПО (19,24%), облигации квазигосударственных организаций РК (16,89%), акции и депозитарные расписки иностранных эмитентов (10,36%), облигации МФО (7,92%), денежные средства на инвестиционных счетах (7,75%), облигации БВУ РК (6,77%), корпоративные облигации эмитентов-резидентов РК (6,44%), прочие активы (0,36%). В инструменты в национальной валюте инвестировано 57,75% портфеля, в долларах США – 42,25%.

В результате инвестиционной деятельности доходность пенсионных активов с момента передачи в доверительное управление составила 8,12%.

[Подробная структура](#) инвестиционного портфеля финансовых инструментов под управлением АО «BCC Invest» с указанием эмитентов представлена на сайте ЕНПФ.

По состоянию на 1 февраля 2022 года пенсионные активы ЕНПФ, находящиеся в доверительном управлении **АО «Сентрас Секьюритиз»**, составили 816,10 млн. тенге. Они инвестированы в ГЦБ МФ РК (68,21%), РЕПО (17,40%), акции и депозитарные расписки эмитентов РК (13,90%), денежные средства на инвестиционных счетах (0,35%), прочие активы (дебиторская задолженность, просроченная задолженность, провизии) 0,14%. Все инвестиции произведены в национальной валюте.

В результате инвестиционной деятельности доходность пенсионных активов с момента передачи в доверительное управление составила 8,23%.

[Подробная структура](#) инвестиционного портфеля финансовых инструментов под управлением АО «Сентрас Секьюритиз» с указанием эмитентов представлена на сайте ЕНПФ.

Кроме того, на сайте ЕНПФ во вкладке «Показатели» имеется раздел «Краткий обзор инвестиционного портфеля пенсионных активов», в котором представлена общая информация по структуре инвестиционного портфеля.

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).