

ИНФОРМАЦИОННОЕ СООБЩЕНИЕ

25 октября 2019 года

Инвестиционный портфель пенсионных активов ЕНПФ по состоянию на 1 октября 2019 года

Алматы, Казахстан – По состоянию на 1 октября 2019 года пенсионные активы ЕНПФ, находящиеся в доверительном управлении Национального Банка Республики Казахстан, составили 10 426,25 млрд. 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/38e/38ebe0caa880688b624195743aa0f1c6.pdf>

Здесь представлен подробный отчет о том, в какие ценные бумаги и в каком количестве, по какой рыночной цене инвестируются пенсионные накопления вкладчиков.

Доходность пенсионных активов за последние 12 месяцев составила 8,4 % при инфляции 5,3 % за аналогичный период, что в свою очередь свидетельствует о реальной положительной доходности.

Начисленный инвестиционный доход за январь-сентябрь 2019 года составил 525,2 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» 493,08 млрд тенге;
- убытки от рыночной переоценки ценных бумаг (32,54) млрд тенге;
- доходы от переоценки иностранной валюты 40,33 млрд тенге;
- доходы от внешнего управления 16,12 млрд тенге;
- прочие доходы составили 8,2 млрд тенге.

Таким образом, благодаря диверсификации портфеля, отрицательная переоценка отдельных инструментов перекрывается доходностью по другим ценным бумагам. Остановимся на некоторых позициях.

По состоянию на 01.10.2019г. средневзвешенная доходность к погашению долговых финансовых инструментов, находящихся в инвестиционном портфеле ПА ЕНПФ, составила 7,0% годовых, в том числе по номинированным в тенге – 8,6% годовых, в иностранной валюте – 3,5% годовых.

Основную долю в портфеле пенсионных активов ЕНПФ (37,74%) составили государственные ценные бумаги Республики Казахстан, текущая стоимость которых составила 3 934,35 млрд тенге. На отчетную дату средневзвешенная доходность к погашению по ГЦБ РК, номинированным в тенге, составила 7,6 % годовых, в долларах США – 4,4% годовых.

Текущая стоимость государственных ценных бумаг иностранных государств на 1 октября 2019 года составила 1 612,9 млрд тенге, увеличившись с начала года на 35,3%. Их доля в портфеле составила 15,47%. Средневзвешенная доходность к погашению ГЦБ иностранных государств в портфеле ПА ЕНПФ на отчетную дату составила 2,9% годовых.

Облигации квазигосударственных организаций Республики Казахстан на 1 октября 2019 года составляют 14,1% инвестиционного портфеля пенсионных активов. На отчетную дату средневзвешенная доходность к погашению по облигациям квазигосударственных организаций РК, номинированным в тенге, составила 10,2% годовых, в долларах США – 5,0% годовых.

Финансовые инструменты казахстанских банков второго уровня представлены следующим образом: 12,08% портфеля размещено в облигации, средневзвешенная доходность которых

составляет 9,9% годовых в национальной валюте и 6,4% в долларах США; доля депозитов составляет 2,46% с средневзвешенной доходностью 9,3% годовых.

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 - 65,7%, в долларах США – 32,29%, в других валютах – 2,01% портфеля пенсионных активов.

Структурное распределение портфеля пенсионных активов ЕНПФ, находящихся в доверительном управлении, соответствует требованиям Инвестиционной декларации ЕНПФ.

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).