

ИНФОРМАЦИОННОЕ СООБЩЕНИЕ

Инвестиционные портфели пенсионных активов под управлением НБРК и УИП по состоянию на 1 сентября 2021 года

Подробная информация об инвестировании пенсионных активов [Национальным Банком Республики Казахстан \(НБРК\)](#), управляющими инвестиционным [портфелем \(УИП\)](#), а также обзоры инвестиционной деятельности по состоянию на 1 сентября 2021 года размещены на сайте enpf.kz в разделе «Показатели – Инвестиционная деятельность».

Отметим, что общий объем пенсионных активов, находящихся в управлении на 1 сентября 2021 года, составил 12,95 трлн тенге. При этом пенсионные активы ЕНПФ, находящиеся в доверительном управлении НБРК, составили 12 947,03 млрд тенге. Пенсионные активы под управлением УИП составили порядка 5,1 млрд тенге.

В результате инвестиционной деятельности общий размер начисленного инвестиционного дохода за период с 01.01.2021г. по 31.08.2021г. составил 966,20 млрд. тенге. в том числе:

Инвестиционный портфель пенсионных активов под управлением НБРК

На 1 сентября 2021 года в рамках направлений, одобренных Советом по управлению Национальным фондом РК на 2021 год, НБ РК (как доверительным управляющим) основные направления инвестирования представлены [следующим образом](#):

- государственные ценные бумаги РК, выпущенные Министерством финансов РК, текущая стоимость которых составляет 4 970,75 млрд. тенге (38,39% от всего портфеля). Средневзвешенная доходность к погашению по ГЦБ Министерства финансов РК, номинированным в тенге, составила 9,1% годовых, в долларах США – 4,1% годовых.

- облигации квазигосударственных организаций РК (текущая стоимость 1 727,32 млрд. тенге (доля в портфеле составила 13,34%). Средневзвешенная доходность к погашению по облигациям квазигосударственных организаций РК, номинированным в тенге, составила 10,8% годовых, в долларах США – 5,5% годовых.

- государственные ценные бумаги иностранных государств составили 1 326,59 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 10,25%. Средневзвешенная доходность к погашению ГЦБ иностранных государств в портфеле ПА ЕНПФ на отчетную дату составила 0,2% годовых.

- облигации банков второго уровня РК на сумму 1 058,40 млрд тенге (8,17%). На отчетную дату средневзвешенная доходность к погашению по облигациям БВУ РК составила 10,0% годовых.

- активы, находящиеся во внешнем управлении в размере 1 279,55 млрд тенге (9,88% от портфеля). Прирост по сравнению с 1 января 2021 года составил 56,71%.

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 – 68,20%, в долларах США – 31,74%, в российских рублях и другой валюте – 0,06% портфеля пенсионных активов.

Структура начисленного с начала года инвестиционного дохода, полученного НБРК, выглядит следующим образом:

- доходы в виде вознаграждения по ценным бумагам, в том числе по размещенным вкладам и операциям «обратное РЕПО» 589,42 млрд тенге;
- доходы от рыночной переоценки ценных бумаг 80,40 млрд тенге;
- доходы от переоценки иностранной валюты 28,70 млрд тенге;
- доходы по активам, находящимся во внешнем управлении 123,88 млрд тенге;

- прочие доходы составили 143,64 млрд тенге.

В результате инвестиционной деятельности, а также вследствие волатильности курсов иностранных валют и изменения рыночной стоимости финансовых инструментов, размер начисленного инвестиционного дохода с начала 2021 года составил 966,04 млрд. тенге. Доходность пенсионных активов ЕНПФ, распределенная на счета вкладчиков (получателей) с начала 2021 года, составила 7,65% при инфляции 5,80%.

При этом по состоянию на 1 сентября 2021 года доходность пенсионных активов за последние 12 месяцев (с сентября 2020 года по 31 августа 2021 года) для вкладчиков (получателей) ЕНПФ составила 10,68% при инфляции в размере 8,70%.

[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 порядка 5,1 млрд тенге.

Пенсионные активы, находящиеся в доверительном управлении **АО «Jusan Invest»**, составили 2,3 млрд тенге. На них были приобретены: паи Exchange Traded Funds (ETF) они составляют 46,26%, ноты НБРК (36,96% портфеля), ГЦБ Министерства финансов РК (16,69%), остальные активы в денежных средствах на инвестиционных счетах - 0,09%. 53,74% портфеля представлено в тенге, 46,26% – в долларах США.

В результате инвестиционной деятельности, а также вследствие волатильности курсов иностранных валют и изменения рыночной стоимости финансовых инструментов, размер начисленного инвестиционного дохода с начала деятельности 15.03.2021 на 01.09.2021 г. составил 59,52 млн тенге. Доходность пенсионных активов составила 5,10%

[Подробная структура](#) портфеля 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 сентября составили 1,4 млрд тенге. В структуре портфеля ноты НБРК составляют 33,29% портфеля, Паи ETF (19,27%), облигации БВУ (10,67%), денежные средства на счетах (9,41%), акции и депозитарные расписки иностранных эмитентов (9,21%), облигации квазигосударственных организаций РК (8,73%), корпоративные облигации организаций РК (8,44%) и операции обратного РЕПО (0,97%). Инвестиции в национальной валюте составили 70,51% портфеля, в долларах США - 29,49%.

В результате инвестиционной деятельности, а также вследствие волатильности курсов иностранных валют и изменения рыночной стоимости финансовых инструментов, размер начисленного инвестиционного дохода с начала деятельности 15.03.2021 на 01.09.2021 г. составил 53,24 млн. тенге. Доходность пенсионных активов составила 4,73%.

[Подробная структура](#) портфеля 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 сентября составили 932,7 млн тенге. Они распределены в паи (ETF на индексы) (29,86%), облигации квазигосударственных организаций РК (14,82%), операции обратного РЕПО (14,20%), облигации БВУ РК (12,04%), корпоративные облигации эмитентов-резидентов РК (8,67%), акции и депозитарные расписки иностранных эмитентов (7,69%), облигации МФО (7,10%), денежные

средства на инвестиционных счетах (5,61%). В инструменты в национальной валюте инвестировано 57,07% портфеля, в долларах США – 42,93%.

В результате инвестиционной деятельности, а также вследствие волатильности курсов иностранных валют и изменения рыночной стоимости финансовых инструментов, размер начисленного инвестиционного дохода с начала деятельности 15.03.2021 на 01.09.2021 г. составил 25,82 млн. тенге. Доходность пенсионных активов составила 3,72%.

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

По состоянию на 1 сентября 2021 года пенсионные активы ЕНПФ, находящиеся в доверительном управлении АО «Сентрас Секьюритиз», составили 499,37 млн. тенге. Они инвестированы в ГЦБ МФ РК (92,30%), акции и депозитарные расписки эмитентов РК (6,90%), денежные средства на инвестиционных счетах (0,80%). Все инвестиции произведены в национальной валюте.

В результате инвестиционной деятельности, а также вследствие волатильности курсов иностранных валют и изменения рыночной стоимости финансовых инструментов, размер начисленного инвестиционного дохода с начала деятельности 01.04.2021 на 01.09.2021 г. составил 26,52 млн. тенге. В результате инвестиционной деятельности и изменения рыночной стоимости финансовых инструментов, доходность пенсионных активов составила 5,92%.

[Подробная структура](#) портфеля 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).