

ИНФОРМАЦИОННОЕ СООБЩЕНИЕ

23 января 2020

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

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

Алматы, Казахстан – По состоянию на 1 января 2020 года пенсионные активы ЕНПФ, находящиеся в доверительном управлении Национального Банка Республики Казахстан, составили 10 798,31 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/537/537c3ac3e7b78cde3f0b15da304e1a25.pdf>.

Доходность пенсионных активов за 2019 год составила 6,57 % при инфляции 5,4 % за аналогичный период, что свидетельствует о реальной положительной доходности.

Начисленный инвестиционный доход за 2019 год составил 699,77 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» 665,06 млрд тенге;
- доходы (убытки) от рыночной переоценки ценных бумаг (35,35) млрд тенге;
- доходы (убытки) от переоценки иностранной валюты (7,37) млрд тенге;
- доходы от внешнего управления 12,94 млрд тенге;
- доходы от переоценки прочих активов (ПФИ) 19,8 млрд тенге;
- прочие доходы составили 44,69 млрд тенге.

Наибольшую долю в портфеле пенсионных активов ЕНПФ (40,45%) составили государственные ценные бумаги Республики Казахстан, как стабильный и доходный инструмент инвестирования. Текущая стоимость ГЦБ в портфеле пенсионных активов составила 4 368,01 млрд тенге, увеличившись с начала года на 7,64%. На отчетную дату средневзвешенная доходность к погашению по ГЦБ РК, номинированным в тенге, составила 7,8 % годовых, в долларах США – 4,4% годовых.

Текущая стоимость государственных ценных бумаг иностранных государств на 1 января 2020 года составила 1 235,06 млрд тенге, их доля в портфеле - 11,44%. Средневзвешенная доходность к погашению портфеля ГЦБ иностранных государств на отчетную дату составила 2,2 % годовых в иностранной валюте.

Облигации квазигосударственных организаций Республики Казахстан на 1 января 2020 года составляют 14,86% инвестиционного портфеля пенсионных активов. Текущая стоимость этого вида инструментов составила 1 604,96 млрд тенге, увеличившись с начала года на 23,47%. На отчетную дату средневзвешенная доходность к погашению по облигациям квазигосударственных организаций РК, номинированным в тенге, составила 10,4% годовых, в долларах США – 5,0% годовых.

Финансовые инструменты казахстанских банков второго уровня представлены следующим образом: 10,96 % портфеля размещено в облигации, средневзвешенная доходность которых составляет 10,0% годовых в национальной валюте и 6,4% в долларах США; доля депозитов составляет 2,36% с средневзвешенной доходностью 9,1% годовых в тенге. Надо отметить, что за 2019 год объемы размещения в депозиты казахстанских БВУ были снижены на 22,74 млрд тенге (или на 8,19%).

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 – 66,69%, в долларах США – 30,20%, в других валютах – 3,11% 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).

