

## ИНФОРМАЦИОННОЕ СООБЩЕНИЕ

### Каким образом казахстанцы получили инвестиционный доход в 1 триллион тенге?

*Инвестиционные портфели пенсионных активов под управлением НБРК и УИП по состоянию на 1 октября 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 октября 2021 года размещены на сайте [enpf.kz](http://enpf.kz) в разделе «Показатели – Инвестиционная деятельность».

Отметим, что общий объем пенсионных активов, находящихся в управлении на 1 октября 2021 года, составил 13,1 трлн тенге. При этом пенсионные активы ЕНПФ, находящиеся в доверительном управлении НБРК, составили 13 088,87 млрд тенге. Пенсионные активы под управлением УИП составили порядка 5,4 млрд тенге.

В результате инвестиционной деятельности общий размер начисленного инвестиционного дохода за период с 01.01.2021г. по 30.09.2021г. составил 1,1 трлн тенге. в том числе:

#### **Инвестиционный портфель пенсионных активов под управлением НБРК**

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

- государственные ценные бумаги РК, выпущенные Министерством финансов РК, текущая стоимость которых составляет 4 958,73 млрд. тенге (37,89% от всего портфеля). Средневзвешенная доходность к погашению по ГЦБ Министерства финансов РК, номинированным в тенге, составила 9,3% годовых, в долларах США – 3,8% годовых.

- облигации квазигосударственных организаций РК (текущая стоимость 1 737,85 млрд. тенге (доля в портфеле составила 13,28%). 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 1 340,12 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 10,24%. Средневзвешенная доходность к погашению ГЦБ иностранных государств в портфеле ПА ЕНПФ на отчетную дату составила 0,4% годовых.

- облигации банков второго уровня РК на сумму 1 042,37 млрд тенге (7,96%). На отчетную дату средневзвешенная доходность к погашению по облигациям БВУ РК составила 10,0% 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 – 67,91%, в долларах США – 32,02%, в российских рублях и другой валюте – 0,07% 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» 660,61 млрд тенге;
- доходы от рыночной переоценки ценных бумаг 128,94 млрд тенге;
- доходы от переоценки иностранной валюты 30,45 млрд тенге;
- доходы по активам, находящимся во внешнем управлении 137,02 млрд тенге;
- прочие доходы составили 161,86 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 1 118,88 млрд. тенге. Доходность пенсионных активов ЕНПФ, распределенная на счета вкладчиков (получателей) с начала 2021 года, составила 8,89% при инфляции 6,20%. Таким образом, реальная доходность по пенсионным активам ЕНПФ составила 2,69%.

При этом по состоянию на 1 октября 2021 года доходность пенсионных активов за последние 12 месяцев для вкладчиков (получателей) ЕНПФ составила 10,08% при инфляции в размере 8,90%. Таким образом, за последние 12 месяцев реальная доходность по пенсионным активам ЕНПФ составила 1,18%.

[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 5,4 млрд тенге.

Пенсионные активы, находящиеся в доверительном управлении **АО «Jusan Invest»**, составили 2,4 млрд тенге. На них были приобретены: паи Exchange Traded Funds (ETF) они составляют 45,85%, ноты НБРК (35,67% портфеля), ГЦБ Министерства финансов РК (16,96%), остальные активы в денежных средствах на инвестиционных счетах - 2,92%. 54,11% портфеля представлено в тенге, 45,89% – 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 01.10.2021 г. составил 35,85 млн тенге. Доходность пенсионных активов составила 4,10%

[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 октября составили 1,5 млрд тенге. В структуре портфеля ноты НБРК составляют 20,86% портфеля, Паи ETF (17,99%), облигации квазигосударственных организаций РК (16,26%), облигации БВУ (10,09%), операции обратного РЕПО (9,30%). акции и депозитарные расписки иностранных эмитентов (8,54%), корпоративные облигации организаций РК (8,02%), МФО (7,88%) и денежные средства на счетах (1,05%). Инвестиции в национальной валюте составили 72,49% портфеля, в долларах США - 27,51%.

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 01.10.2021 г. составил 56,61 млн. тенге. Доходность пенсионных активов составила 4,94%.

[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 октября составили 981,8 млн тенге. Они распределены в паи (ETF на индексы) (29,75%), облигации квазигосударственных организаций РК (19,78%), облигации БВУ РК (11,60%), облигации МФО (9,80%), операции обратного РЕПО (8,88%), корпоративные облигации эмитентов-резидентов РК (8,31%), акции и депозитарные расписки иностранных эмитентов (8,21%), денежные средства на

инвестиционных счетах (4,82%). В инструменты в национальной валюте инвестировано 60,06% портфеля, в долларах США – 39,94%.

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 01.10.2021 г. составил 33,56 млн. тенге. Доходность пенсионных активов составила 4,49%.

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

По состоянию на 1 октября 2021 года пенсионные активы ЕНПФ, находящиеся в доверительном управлении АО «Сентрас Секьюритиз», составили 540,71 млн. тенге. Они инвестированы в ГЦБ МФ РК (85,69%), акции и депозитарные расписки эмитентов РК (8,22%), денежные средства на инвестиционных счетах (6,09%). 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 01.10.2021 г. составил 29,92 млн. тенге. В результате инвестиционной деятельности и изменения рыночной стоимости финансовых инструментов, доходность пенсионных активов составила 6,57%.

[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](http://www.enpf.kz)).*