

Структура инвестиционного портфеля пенсионных активов – диверсификация обеспечивает доходность

По состоянию на 1 февраля 2018 года пенсионные активы ЕНПФ, находящиеся в доверительном управлении Национального Банка Республики Казахстан, составили 7, 8 трлн тенге.

Основную долю в портфеле – 44,47% – составляют государственные ценные бумаги Республики Казахстан, доля которых снизилась с начала года на 3,18 %. Текущая стоимость ГЦБ составляет 3 473,64 млрд тенге. На отчетную дату доходность к погашению этих инструментов, номинированных в тенге, составляет 7,9% годовых.

На втором месте по объему инвестированных пенсионных активов находятся облигации банков второго уровня Республики Казахстан, чья доля в портфеле равна 15,82%, текущая стоимость составила 1 235,92 млрд тенге, средневзвешенная доходность к погашению 10,6%.

Кроме того, в инвестиционном портфеле на 1 февраля 2018 года находятся государственные ценные бумаги иностранных государств (12,61%), облигации квазигосударственных организаций Республики Казахстан (10,11%), депозиты в казахстанских (4,20%) и иностранных (5,25%) банках и другие инструменты, обеспечивающие рациональное соотношение риска и доходности портфеля.

Если говорить о валютной структуре портфеля, то инструменты, номинированные в национальной валюте составляют 70,81 %, доля инструментов в иностранной валюте 29,19, из которых 28,61 % составляют доллары США.

В результате инвестиционной деятельности, а также вследствие волатильности курсов иностранных валют и изменения рыночной стоимости финансовых инструментов, размер чистого инвестиционного дохода за январь 2018 года составил 9,8 млрд. тенге.

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, который возглавляет Президент Республики Казахстан.

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).

Пресс-центр АО «ЕНПФ»
Контакты для СМИ: press@enpf.kz