

ИНФОРМАЦИОННОЕ СООБЩЕНИЕ

ЕНПФ представляет подробный отчет об инвестировании пенсионных накоплений

Инвестиционные портфели пенсионных активов на 1 июня 2023 года

На сайте enpf.kz представлен отчет об управлении пенсионными активами НБРК и УИП по состоянию на 1 июня 2023 года. Подробный отчет об инвестировании пенсионных сбережений размещен на сайте enpf.kz в разделе «Показатели - Инвестиционная деятельность», в котором ежемесячно предоставляется информация об управлении пенсионными активами Национальным Банком Республики Казахстан (НБРК) и управляющими инвестиционным портфелем (УИП). Общий объем пенсионных активов на 1 июня 2023 года составил порядка **15 846,7 млрд тенге**. При этом пенсионные активы ЕНПФ, [находящиеся в доверительном управлении Национального Банка Республики Казахстан](#), составили **15 833,03 млрд тенге**. [Пенсионные активы под управлением УИП](#) составили **9,08 млрд тенге**.

Инвестиционный портфель пенсионных активов под управлением НБРК

Основные направления инвестирования пенсионных активов НБРК на 1 июня 2023 года выглядят следующим образом: государственные ценные бумаги Министерства финансов РК – 46,96%, облигации квазигосударственных компаний – 10,72%, облигации и депозиты банков второго уровня Республики Казахстан – 5,68%, ГЦБ иностранных государств – 4,70%, ценные бумаги международных финансовых организаций – 2,38%, корпоративные облигации казахстанских эмитентов – 0,10%.

Инвестиционный портфель в разрезе валют, в которые номинированы финансовые инструменты, приобретенные за счет пенсионных активов, по состоянию на 1 июня 2023 г. выглядит таким образом: инвестиции в национальной валюте – 70,95%, в долларах США – 29,01%, в другой валюте – 0,05% портфеля пенсионных активов. Из анализа структуры полученного дохода следует, что доходы в виде вознаграждения по ценным бумагам, в том числе по размещенным вкладам и операциям «обратное РЕПО» и от рыночной переоценки ценных бумаг, составили 564,07 млрд тенге, по активам, находящимся во внешнем управлении – 28,53 млрд тенге, прочие доходы – 2,09 млрд тенге. При этом переоценка иностранной валюты принесла убыток в размере 86,2 млрд тенге. Таким образом, за счет диверсификации инвестиционного портфеля пенсионных активов по инструментам, отраслям и валютам общий доход за май 2023 г. является положительным.

В результате инвестиционной деятельности, а также вследствие волатильности курсов иностранных валют и изменения рыночной стоимости финансовых инструментов, размер начисленного инвестиционного дохода с начала 2023 года составил 508,06 млрд. тенге.

Доходность пенсионных активов ЕНПФ, распределенная на счета вкладчиков (получателей) с начала 2023 года, составила 3,13% при инфляции в размере 4,80%.

При этом по состоянию на 1 июня 2023 года доходность пенсионных активов за последние 12 месяцев (с июня 2022 года по май 2023 года) для вкладчиков (получателей) ЕНПФ составила 11,39%.

Напомним, что в средне- и долгосрочной перспективе обеспечивается положительная реальная (превышающая накопленную инфляцию) доходность пенсионных накоплений.

[Подробная структура](#) инвестиционного портфеля финансовых инструментов под управлением НБРК с указанием эмитентов и обзор инвестиционной деятельности размещены на официальном сайте ЕНПФ. Напомним, что в Казахстане действует модель государственной гарантии сохранности пенсионных накоплений. В соответствии со статьей 5 Закона Республики Казахстан «О пенсионном обеспечении в Республике Казахстан» государство гарантирует получателям сохранность обязательных пенсионных взносов и обязательных профессиональных пенсионных взносов в ЕНПФ в размере фактически внесенных взносов с учетом уровня инфляции на момент получения права на пенсионные выплаты.

Управляющие инвестиционным портфелем

Общий объем средств, находящихся под управлением УИП, составляет **9,08 млрд тенге**.

По состоянию на 01.06.2023 г. пенсионные активы, находящиеся в доверительном управлении АО «*Jusan Invest*», составили **3,87 млрд тенге**.

Самые значительные вложения компании: ГЦБ МФ РК – 37,58%, паи Exchange Traded Funds (ETF) – 33,5%, ноты НБРК – 11,67%; ГЦБ иностранных государств – 9,20% портфеля. Отметим, что 57,13% портфеля представлено в тенге; 42,87% – 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 года по состоянию на 1 июня составил 187,94 млн тенге. Доходность пенсионных активов составила 4,23%.

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

По состоянию на 01.06.2023 г. пенсионные активы, находящиеся в доверительном управлении АО «*Halyk Global Markets*», составили **2,53 млрд тенге**.

Основные инвестиции в структуре портфеля таковы: «обратное РЕПО» (не более 90 календарных дней) составляет 36,13%; облигации квазигосударственных организаций РК – 20,29%; долевые инструменты иностранных эмитентов (паи ETF) – 14,86%; облигации МФО – 10,7%, ценные бумаги, имеющие статус государственных, выпущенные центральными правительствами иностранных государств – 6,95%. Инвестиции в национальной валюте составили 77,69% портфеля, в долларах США – 22,31%.

В результате инвестиционной деятельности размер начисленного инвестиционного дохода с начала года по состоянию на 1 июня составил 177,65 млн тенге. Доходность пенсионных активов составила 6,52%.

[Подробная структура](#) инвестиционного портфеля финансовых инструментов под управлением АО «*Halyk Global Markets*» с указанием эмитентов представлена на сайте ЕНПФ.

Пенсионные активы ЕНПФ, находящиеся в доверительном управлении АО «*BCC Invest*», составили **1,43 млрд тенге**.

Среди основных направлений инвестиций можно выделить следующие: государственные облигации РК – 33,61%; облигации квазигосударственных организаций Республики Казахстан – 23,01%; РЕПО – 9,98 %, облигации МФО – 6,38%, корпоративные облигации эмитентов-резидентов

РК - 5,68%, акции и депозитарные расписки иностранных эмитентов – 4,42% портфеля. В инструменты в национальной валюте инвестировано 77,36% портфеля, в долларах США – 22,64%.

В результате инвестиционной деятельности размер начисленного инвестиционного дохода с начала года по состоянию на 1 июня составил 83,63 млн тенге. Доходность пенсионных активов составила 5,30%.

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

Пенсионные активы ЕНПФ, находящиеся в доверительном управлении АО «Сентрас Секьюритиз», составили 972,75 млн тенге.

59,13% активов инвестировано в ГЦБ МФ РК; денежные средства на инвестиционных счетах составляют 18,83%; акции и депозитарные расписки, выпущенные организациями Республики Казахстан – 9,58%, облигации квазигосударственных организаций - 8,36%. В инструменты в национальной валюте инвестировано 77,75% портфеля, в долларах США - 22,25%.

В результате инвестиционной деятельности и изменения рыночной стоимости финансовых инструментов размер начисленного инвестиционного дохода с начала года по состоянию на 1 июня составил 43,52 млн тенге. Доходность пенсионных активов составила 4,09%.

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

По состоянию на 1 мая 2023 года пенсионные активы, находящиеся в доверительном управлении АО «ДО Народного Банка Казахстана «Halyk Finance», составили **267,90 млн тенге**.

Основные инвестиции в структуре портфеля таковы: «обратное РЕПО» (не более 90 календарных дней) - 69,10%, ГЦБ МФ РК – 8,25%, корпоративные облигации эмитентов РК – 7,52%, МФО – 6,50%, облигации квазигосударственных организаций Республики Казахстан – 4,89%.

В инструменты в национальной валюте инвестировано 96,73% портфеля, в валюте евро - 3,27%. В результате инвестиционной деятельности размер начисленного инвестиционного дохода с начала года по состоянию на 1 июня составил 10,99 млн тенге. Доходность пенсионных активов составила 6,68%.

[Подробная структура](#) инвестиционного портфеля финансовых инструментов под управлением АО «ДО Народного Банка Казахстана «Halyk Finance» с указанием эмитентов представлена на сайте ЕНПФ.

Напомним, что после получения пенсионных активов от ЕНПФ УИП инвестирует их в разрешенные финансовые инструменты, указанные в Правилах осуществления деятельности по управлению инвестиционным портфелем, утвержденных постановлением Правления Национального Банка РК от 3 февраля 2014 года №10, и предусмотренные в Инвестиционной декларации УИП. При переводе пенсионных накоплений в управление УИП гарантия государства заменяется гарантией управляющей компании по обеспечению минимального уровня доходности пенсионных активов. Минимальный уровень доходности рассчитывается, исходя из средневзвешенной доходности пенсионных активов, переданных в управление УИП, действующих на рынке.

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)