

ИНФОРМАЦИОННОЕ СООБЩЕНИЕ

Инвестиционные портфели пенсионных активов под управлением НБРК и УИП по состоянию на 1 апреля 2022 года

На сайте enpf.kz в разделе «Показатели – Инвестиционная деятельность» размещена подробная информация об инвестировании пенсионных активов Национальным Банком Республики Казахстана (НБРК) и управляющими инвестиционным портфелем (УИП), а также обзоры инвестиционной деятельности по состоянию на 1 апреля 2022 года.

Из представленных отчетов следует: общий объем пенсионных активов, находящихся в управлении на 1 апреля 2022 года, составили 13,0 трлн тенге. При этом пенсионные активы ЕНПФ, находящиеся в доверительном управлении НБРК, составили 12 982,64 млрд тенге. Пенсионные активы под управлением УИП составили 8,6 млрд тенге.

Инвестиционный портфель пенсионных активов под управлением НБРК

На 1 апреля 2022 года в рамках направлений, одобренных Советом по управлению Национальным фондом РК, основные инвестиции НБРК (как доверительным управляющим) в финансовые инструменты представлены следующим образом:

- основную долю в портфеле ПА ЕНПФ занимают ГЦБ Министерства финансов РК, текущая стоимость которых составила 5 182,93 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 39,92%. На 1 апреля 2022 года средневзвешенная доходность к погашению по ГЦБ Министерства финансов РК, номинированным в тенге, составила 9,7% годовых, в долларах США – 3,4% годовых.

- облигации квазигосударственных организаций РК текущая стоимость 1 700,04 млрд тенге (доля в портфеле составила 13,09%). Средневзвешенная доходность к погашению по облигациям квазигосударственных организаций РК, номинированным в тенге, составила 10,8% годовых, в долларах США – 5,5% годовых.

- облигации банков второго уровня РК на сумму 928,04 млрд тенге (7,15%). На отчетную дату средневзвешенная доходность к погашению по облигациям БВУ РК составила 10,2% годовых.

- государственные ценные бумаги иностранных государств составили 713,74 млрд тенге. Их доля в портфеле составила 5,50%. Средневзвешенная доходность к погашению ГЦБ иностранных государств в портфеле ПА ЕНПФ на отчетную дату составила 0,4% годовых.

- облигации международных финансовых организаций составили 399,54 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 3,08%. Средневзвешенная доходность к погашению по облигациям международных финансовых организаций составила 10,0% годовых.

Инвестиционный портфель в разрезе валют, в которые номинированы финансовые инструменты, приобретенные за счет пенсионных активов, представлен следующим образом:

инвестиции в национальной валюте – 66,78%, в долларах США – 33,15%, в другой валюте – 0,06% портфеля пенсионных активов.

В результате инвестиционной деятельности, а также вследствие волатильности курсов иностранных валют и изменения рыночной стоимости финансовых инструментов, размер начисленного инвестиционного дохода с начала 2022 года сложился положительным и составил 304,90 млрд. тенге.

Доходность пенсионных активов ЕНПФ, распределенная на счета вкладчиков (получателей) с начала 2022 года, составила 2,19%.

При этом по состоянию на 1 апреля 2022 года доходность пенсионных активов за последние 12 месяцев (с апреля 2021 года по март 2022 года) для вкладчиков (получателей) ЕНПФ составила 10,43%.

[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, находящихся под управлением УИП составляют **8,6 млрд тенге**.

Пенсионные активы, находящиеся в доверительном управлении **АО «Jusan Invest»**, составили 3,93 млрд тенге. На них были приобретены: паи Exchange Traded Funds (ETF) они составляют 29,02%, активы в денежных средствах на инвестиционных счетах - 28,18%, ноты НБРК (20,24% портфеля), ГЦБ Министерства финансов РК (18,68%), Репо - 3,84%. Отметим, что 56,93% портфеля представлено в тенге, 43,07% в долларах США.

В результате инвестиционной деятельности доходность пенсионных активов под управлением АО «Jusan Invest» с начала года составила 5,05%.

[Подробная структура](#) 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 апреля 2022 года составили 2,42 млрд тенге. В структуре портфеля операции обратного РЕПО составляют 44,68%, инструменты иностранных эмитентов (Паи ETF) 18,74%, облигации квазигосударственных организаций РК 12,23%, акции и депозитарные расписки иностранных эмитентов 7,62%, облигации банков второго уровня РК 6,49%, корпоративные облигации организаций РК 5,05%, МФО 5,09%, денежные средства на счетах 0,05%, прочие активы (дебиторская задолженность, просроченная задолженность, провизии) 0,04%. Инвестиции в национальной валюте составили 73,59% портфеля, в долларах США - 26,41%. Доходность пенсионных активов под управлением АО «Halyk Global Markets» с 01.01.2022г. по 31.03.2022г. составила 4,04%.

[Подробная структура](#) 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 апреля текущего года составили 1,41 млрд тенге. Они распределены в Репо 29,49%, паи (ETF на индексы) 25,84%, облигации квазигосударственных организаций РК 14,67%, акции и депозитарные расписки иностранных эмитентов 10,77%, облигации МФО 6,89%, облигации БВУ РК 6,11%, корпоративные облигации эмитентов-резидентов РК 5,80%, денежные средства на инвестиционных счетах 0,34%, прочие активы (дебиторская задолженность, просроченная задолженность, провизии) 0,09%. В инструменты в национальной валюте инвестировано 63,28% портфеля, в долларах США – 36,72%.

В результате инвестиционной деятельности доходность пенсионных активов под управлением АО «BCC Invest» с начала текущего года составила 5,54%.

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

По состоянию на 1 апреля 2022 года пенсионные активы ЕНПФ, находящиеся в доверительном управлении **АО «Сентрас Секьюритиз»**, составили 0,87 млрд тенге. Они инвестированы в ГЦБ МФ РК 63,11%, облигации квазигосударственных организаций РК 16,56%, долевые инструменты иностранных эмитентов (Паи ETF) 5,09%, денежные средства на инвестиционных счетах 3,38%. Все инвестиции произведены в национальной валюте.

В результате инвестиционной деятельности доходность пенсионных активов под управлением АО «Сентрас Секьюритиз» с начала 2022 года составила (-0,72%).

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