

ИНФОРМАЦИОННОЕ СООБЩЕНИЕ

Инвестиционные портфели пенсионных активов под управлением НБРК и УИП по состоянию на 1 августа 2021 года

По состоянию на 1 августа 2021 года в результате инвестиционной деятельности общий размер начисленного инвестиционного дохода за период с 01.01.2021г. по 31.07.2021г. превысил 821,5 млрд тенге. В том числе размер начисленного инвестиционного дохода, заработанного с начала 2021 года Национальным Банком Республики Казахстан как доверительным управляющим, составил 821,40 млрд тенге.

Структура инвестиционного дохода, а также подробная информация об инвестировании пенсионных активов Национальным Банком Республики Казахстан (НБРК) и управляющими инвестиционным портфелем (УИП), обзоры инвестиционной деятельности по состоянию на 1 августа 2021 года размещены на сайте enpf.kz в разделе «Показатели – Инвестиционная деятельность».

Инвестиционный портфель пенсионных активов под управлением НБРК

На 1 августа 2021 года пенсионные активы ЕНПФ, находящиеся в доверительном управлении Национального Банка Республики Казахстан, составили 12 811,56 млрд тенге.

В рамках направлений, одобренных Советом по управлению Национальным фондом РК на 2021 год, основные направления инвестирования представлены [следующим образом](#):

- государственные ценные бумаги РК, выпущенные Министерством финансов РК, текущая стоимость которых составляет 4 966,95 млрд. тенге (38,77% от всего портфеля). С начала года доля ГЦБ в портфеле уменьшилась более чем на 12%. Средневзвешенная доходность к погашению по ГЦБ Министерства финансов РК, номинированным в тенге, составила 9,1% годовых, в долларах США – 4,2% годовых.

- облигации квазигосударственных организаций РК (текущая стоимость 1 749,38 млрд тенге (13,65%). 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 1 193,86 млрд тенге. Их доля в портфеле составила 9,32%. Средневзвешенная доходность к погашению ГЦБ иностранных государств в портфеле ПА ЕНПФ на отчетную дату составила 0,2% годовых.

- облигации банков второго уровня РК на сумму 1 069,10 млрд тенге (8,34%). На отчетную дату средневзвешенная доходность к погашению по облигациям БВУ РК составила 10,0% годовых.

- активы, находящиеся во внешнем управлении в размере 1 239,35 млрд тенге (9,67% от портфеля). Прирост по сравнению с 1 января 2021 года составил 51,78%.

Инвестиции в национальной валюте составляют 68,2% портфеля, в долларах США – 31,74%, в российских рублях и другой валюте – 0,06% 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» 517,44 млрд тенге;
 - доходы от рыночной переоценки ценных бумаг 48,65 млрд тенге;
 - доходы от переоценки иностранной валюты 22,59 млрд тенге;
 - доходы по активам, находящимся во внешнем управлении 104,95 млрд тенге;
 - прочие доходы составили 127,77 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 821,4 млрд тенге. Доходность пенсионных активов ЕНПФ, распределенная на счета вкладчиков (получателей) с начала 2021 года, составила 6,48% при инфляции 5,30%.

[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 4,7 млрд тенге.

Пенсионные активы, находящиеся в доверительном управлении **АО «Jusan Invest»**, составили на 1 августа порядка 2,1 млрд тенге. На них были приобретены: паи Exchange Traded Funds (ETF) - они составляют 45,98%, ноты НБРК (35,85% портфеля), ГЦБ Министерства финансов РК (18,1%). В национальной валюте представлено 54,02% портфеля, в долларах США – 45,98%.

В результате инвестиционной деятельности, а также вследствие волатильности курсов иностранных валют и изменения рыночной стоимости финансовых инструментов, размер начисленного инвестиционного дохода на 1 августа с 15 марта 2021г. составил 38,22 млн тенге. Доходность пенсионных активов составила 4,13%

[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 августа составили 1,33 млрд тенге. В структуре портфеля ноты НБРК составляют 35,75% портфеля, долевые инструменты иностранных эмитентов 19,39%, операции обратного РЕПО составляют 13,4%. Приобретены в портфель также корпоративные облигации казахстанских эмитентов (9%), облигации квазигосударственных организаций РК облигации (7,46%), акции и депозитарные расписки иностранных эмитентов (7,42%), облигации БВУ (3,72%). Инвестиции в национальной валюте составили 69,48 % портфеля, в долларах США – 30,52%.

В результате инвестиционной деятельности, размер начисленного инвестиционного дохода с 15 марта по 1 августа 2021 года составил 28,54 млн тенге. Доходность пенсионных активов составила 2,96%.

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

По состоянию на 1 августа 2021 года пенсионные активы, находящиеся в доверительном управлении **АО «BCC Invest»**, составили 859,0 млн тенге. Они распределены в паи (ETF на индексы) – 29,41%, долговые инструменты: облигации квазигосударственных организаций РК (14,79%), корпоративные облигации эмитентов РК (9,33%), облигации МФО (7,65%), облигации БВУ (6,51%). Операции обратного РЕПО составляют 15,61% портфеля, акции и депозитарные расписки 6,98%. Денежные средства на счетах составляют 9,72% портфеля. В инструменты в национальной валюте инвестировано 53,94% портфеля, в долларах США – 46,06%.

Размер начисленного инвестиционного дохода за период с 15.03.2021 года по 31.07.2021 составил 16,55 млн. тенге. Доходность пенсионных активов составила 2,77%.

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

По состоянию на 1 августа 2021 года пенсионные активы ЕНПФ, находящиеся в доверительном управлении АО «Сентрас Секьюритиз», составили 477,35 млн тенге. Они инвестированы в ГЦБ МФ РК (94,8%), акции и депозитарные расписки эмитентов РК (5,2%). Все инвестиции произведены в национальной валюте.

Размер начисленного инвестиционного дохода за период с 01.04.2021 года по 31.07.2021 года составил 16,72 млн тенге. В результате инвестиционной деятельности и изменения рыночной стоимости финансовых инструментов, доходность пенсионных активов составила 3,99 %.

[Подробная структура](#) портфеля 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).