

ИНФОРМАЦИОННОЕ СООБЩЕНИЕ

29 июля 2019 года

Инвестиционный портфель пенсионных активов ЕНПФ по состоянию на 1 июля 2019 года

Алматы, Казахстан – На официальном сайте ЕНПФ размещена подробная информация об инвестиционной деятельности по управлению портфелем пенсионных активов: <https://www.enpf.kz/upload/medialibrary/a65/a650446e3c2fde2aefc14647e3bba902.pdf>.

Детальный отчет об инвестиционной деятельности включает данные о том, в какие ценные бумаги и в каком количестве, по какой рыночной цене инвестируются пенсионные накопления вкладчиков.

По состоянию на 1 июля 2019 года пенсионные активы ЕНПФ, находящиеся в доверительном управлении Национального Банка Республики Казахстан, составили 9,99 трлн тенге.

Доходность пенсионных накоплений за последние 12 месяцев (июль 2018 г. – июнь 2019 г.) составила 9,4 % при инфляции за аналогичный период 5,4 %.

Начисленный инвестиционный доход с начала 2019 года превысил 285,2 млрд тенге.

Структура начисленного инвестиционного дохода выглядит следующим образом:

- доходы в виде вознаграждения по ценным бумагам, в том числе по размещенным вкладам и операциям «обратное РЕПО» 330,57 млрд тенге;
- убытки от рыночной переоценки ценных бумаг (31,79) млрд тенге;
- убытки от переоценки иностранной валюты (24,10) млрд тенге;
- доходы от внешнего управления 6,68 млрд тенге;
- прочие доходы составили 3,85 млрд тенге.

По состоянию на 01.07.2019г. средневзвешенная доходность к погашению долговых финансовых инструментов, находящихся в инвестиционном портфеле ПА ЕНПФ, составила 7,0% годовых, в том числе по номинированным в тенге – 8,5% годовых, в иностранной валюте – 3,7% годовых.

Основную долю в портфеле пенсионных активов ЕНПФ (40,31%) составили государственные ценные бумаги Республики Казахстан. На отчетную дату средневзвешенная доходность к погашению по ГЦБ РК, номинированным в тенге, составила 7,5% годовых, в долларах США – 4,5% годовых.

Текущая стоимость государственных ценных бумаг иностранных государств на 1 июля 2019 года составила 1 446,22 млрд тенге, увеличившись с начала года на 21,34%. Их доля в портфеле составила 14,47%. Средневзвешенная доходность к погашению ГЦБ иностранных государств в портфеле ПА ЕНПФ на отчетную дату составила 3,2% годовых.

Облигации квазигосударственных организаций Республики Казахстан на 1 июля 2019 года составляют 13,71% инвестиционного портфеля пенсионных активов. На отчетную дату средневзвешенная доходность к погашению по облигациям квазигосударственных организаций РК, номинированным в тенге, составила 10,2% годовых, в долларах США – 5,0% годовых.

Финансовые инструменты казахстанских банков второго уровня представлены следующим образом: 12,69% портфеля размещено в облигации, средневзвешенная доходность которых составляет 10% годовых в национальной валюте и 6,4% в долларах США; доля депозитов составляет 2,66% с средневзвешенной доходностью 9,4% 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 - 68,23 %, в долларах США – 31,36 %, в других валютах – 0,42% портфеля пенсионных активов.

Структурное распределение портфеля пенсионных активов ЕНПФ, находящихся в доверительном управлении, соответствует требованиям Инвестиционной декларации 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).

