

ИНФОРМАЦИОННОЕ СООБЩЕНИЕ

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

Подробная информация об инвестировании пенсионных активов Национальным Банком Республики Казахстан, управляющими инвестиционным портфелем, а также обзоры инвестиционной деятельности по состоянию на 1 июня 2021 года размещены на сайте enpf.kz в разделе «Показатели – Инвестиционная деятельность».

Отметим, что общий объем пенсионных активов, находящихся в управлении на 1 июня 2021 года, составил 12,7 трлн тенге. При этом пенсионные активы ЕНПФ, находящиеся в доверительном управлении НБРК, составили 12 710,62 млрд тенге.

По состоянию на 01.06.2021 года средневзвешенная доходность к погашению (УТМ) долговых финансовых инструментов, находящихся в инвестиционном портфеле ПА ЕНПФ, составила 7,4% годовых, в том числе по номинированным в тенге – 9,3% годовых, в иностранной валюте – 1,2% годовых.

Инвестиционный портфель пенсионных активов под управлением НБРК

На 1 июня 2021 года в рамках направлений, одобренных Советом по управлению Национальным фондом РК на 2021 год, НБ РК (как доверительным управляющим) основные направления инвестирования представлены следующим образом:

- государственные ценные бумаги РК, выпущенные Министерством финансов РК, текущая стоимость которых составляет 5 148,94 млрд тенге (40,51% от всего портфеля). Средневзвешенная доходность к погашению по ГЦБ Министерства финансов РК, номинированным в тенге, составила 8,8% годовых, в долларах США – 4,2 % годовых.

- облигации квазигосударственных организаций РК (текущая стоимость 1 764,73 млрд тенге (13,88 %). Средневзвешенная доходность к погашению по облигациям квазигосударственных организаций РК, номинированным в тенге, составила 10,8% годовых, в долларах США – 6,6 % годовых.

- облигации банков второго уровня РК на сумму 1 053,49 млрд тенге (8,29%). Средневзвешенная доходность к погашению по облигациям БВУ РК, номинированным в тенге, составила 10 % годовых. Текущая стоимость размещенных в БВУ депозитов составила 249,82 млрд тенге (или 1,97 % портфеля). Средневзвешенная доходность к погашению вкладов БВУ РК на отчетную дату составила 9,1% годовых.

- активы, находящиеся во внешнем управлении в размере 1 180,03 млрд тенге (9,28% от портфеля). Прирост по сравнению с 1 января 2021 года составил 44,52%.

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 – 67,90%, в долларах США – 31,95%, в российских рублях – 0,14% портфеля пенсионных активов.

Структура начисленного с начала года инвестиционного дохода выглядит следующим образом:

- доходы в виде вознаграждения по ценным бумагам, в том числе по размещенным вкладам и операциям «обратное РЕПО» 354,08 млрд тенге;
- доходы от рыночной переоценки ценных бумаг 94,62 млрд тенге;
- доходы от переоценки иностранной валюты 49,36 млрд тенге;
- доходы по активам, находящимся во внешнем управлении 88,25 млрд тенге;

- прочие доходы составили 85,49 млрд тенге.

Таким образом, размер начисленного инвестиционного дохода с начала 2021 года составил 671,8 млрд. тенге. Доходность пенсионных активов ЕНПФ, распределенная на счета вкладчиков (получателей) с начала 2021 года, составила 5,28% при инфляции 3,50%. Таким образом, реальная доходность по пенсионным активам ЕНПФ составила 1,78%.

[Подробная структура инвестиционного портфеля](#) финансовых инструментов с указанием эмитентов и обзор инвестиционной деятельности размещены на официальном сайте ЕНПФ.

Управляющие инвестиционным портфелем

Общий объем средств, переданных в казахстанские управляющие компании, составляет более 2,8 млрд тенге.

Пенсионные активы, находящиеся в доверительном управлении *АО «Jusan Invest»*, составили 1,6 млрд тенге. На них были приобретены паи Exchange Traded Funds (ETF) они составляют 47,29%, ноты НБРК (28,41% портфеля), портфели ГЦБ Министерства финансов РК (20,18%), операции обратного РЕПО (4,05%), остальные активы (3,96%) в денежных средствах на инвестиционных счетах. 52,71% портфеля в тенге, 47,29% – в долларах США. Размер начисленного инвестиционного дохода за период с 15.03.2021 года по 31.05.2021 года составил 30,24 млн. тенге. В результате инвестиционной деятельности, а также вследствие волатильности курсов иностранных валют и изменения рыночной стоимости финансовых инструментов, размер начисленного инвестиционного дохода за 2021г. составил 46,48 млн тенге. Доходность пенсионных активов составила 4,68%.

Пенсионные активы, находящиеся в доверительном управлении *АО «Halyk Global Markets»* на 1 июня составили 964 млн. тенге. В структуре портфеля операции обратного РЕПО составляют 79,12%, долевые инструменты иностранных эмитентов (15,55%), облигации БВУ (5,27%) и денежные средства на счетах (0,05%). В национальной валюте номинировано 84,45% портфеля, 15,55% - в долларах США. В результате инвестиционной деятельности, размер начисленного инвестиционного дохода (по состоянию на 1 июня 2021 года с начала деятельности) составил 11,68 млн. тенге. Доходность пенсионных активов составила 1,55%.

По состоянию на 1 июня 2021 года пенсионные активы, находящиеся в доверительном управлении *АО «BCC Invest»*, составили 706,2 млн тенге. Они распределены в операции обратного РЕПО (43,24%), паи (ETF на индексы) (24,58%), облигации квазигосударственных организаций РК (12,85%), облигации БВУ РК (8,24%), акции и депозитарные расписки иностранных эмитентов (10,52%), денежные средства на инвестиционных счетах (0,57%). В национальной валюте номинировано 64.44% портфеля, в долларах США 35.56%. Размер начисленного инвестиционного дохода за период с 15.03.2021 года по 31.05.2021 составил 11,97 млн. тенге. Доходность пенсионных активов составила 2,25%.

По состоянию на 1 июня 2021 года пенсионные активы ЕНПФ, находящиеся в доверительном управлении *АО «Сентрас Секьюритиз»*, составили 396,99 млн. тенге. Они инвестированы в ГЦБ МФ РК (93,45%), денежные средства на инвестиционных счетах (6,55%). Все инвестиции произведены в национальной валюте. Размер начисленного инвестиционного дохода за период с 01.04.2021 года по 31.05.2021 года составил 9,35 млн. тенге. В результате инвестиционной деятельности и изменения рыночной стоимости финансовых инструментов, доходность пенсионных активов составила 2,54%.

[Подробная структура инвестиционного портфеля](#) финансовых инструментов каждого УИП с указанием эмитентов и обзор инвестиционной деятельности размещены на официальном 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).