

ИНФОРМАЦИОННОЕ СООБЩЕНИЕ

Вся информация об инвестировании пенсионных накоплений на сайте enpf.kz

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

На сайте enpf.kz в разделе «Показатели – Инвестиционная деятельность» размещен ежемесячный подробный отчет об инвестировании пенсионных активов Национальным Банком Республики Казахстана (НБРК) и управляющими инвестиционным портфелем (УИП), а также обзоры инвестиционной деятельности.

Общий объем пенсионных активов, находящихся в управлении на 1 октября 2022 года, превысил 14,1 трлн тенге. При этом пенсионные активы ЕНПФ, [находящиеся в доверительном управлении НБРК](#), составили **14 095,38 млрд тенге**. [Пенсионные активы под управлением УИП](#) составили **9,06 млрд тенге**.

Инвестиционный портфель пенсионных активов под управлением НБРК

На 1 октября 2022 года в рамках направлений, одобренных Советом по управлению Национальным фондом РК, значительную долю (порядка 46%) в портфеле ПА ЕНПФ занимают ГЦБ Министерства финансов РК, как наиболее надежные инструменты на фондовом рынке. Их текущая стоимость составляет ила 6 477,39 млрд. тенге. В сентябре 2022 года в портфель были приобретены ГЦБ Министерства финансов РК в объеме 195,1 млрд тенге со средневзвешенной доходностью 14,36 % годовых. В целом средневзвешенная доходность к погашению по ГЦБ Министерства финансов РК, номинированным в тенге, составила 11,6% годовых, в долларах США – 3,4% годовых.

Наряду с облигациями Министерства финансов РК пенсионные активы ЕНПФ также инвестируются в ценные бумаги квазигосударственных компаний (1 725,87 млрд тенге – 12,24% портфеля), банков второго уровня (облигации БВУ – 929,12 млрд тенге или 6,59% портфеля; депозиты БВУ – 197,09 млрд тенге, 1,4%), международных финансовых организаций (382,32 млрд тенге, 2,71%) и другие финансовые инструменты.

На внешнем рынке инвестирование пенсионных активов ЕНПФ осуществляется на индексной основе. Стратегическое распределение валютного портфеля, установленное Инвестиционной декларацией ЕНПФ, предусматривает инвестирование в такие основные зарубежные классы активов, как глобальные акции, облигации развитых и развивающихся рынков, корпоративные облигации эмитентов инвестиционного уровня.

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

инвестиции в национальной валюте – 70,17%, в долларах США – 29,75%, в другой валюте – 0,08% 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 составил 741,96 млрд. тенге. Доходность за 9 месяцев 2022 года составила 5,34%, за последние 12 месяцев по пенсионным активам, обеспеченная Национальным Банком РК (с октября 2021 года по сентябрь 2022 года), составила 7,52 %. Накопленная доходность пенсионных активов за 5 лет составила 55,8% при накопленной инфляции 53,7%.

[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 **9,06 млрд тенге**.

Пенсионные активы, находящиеся в доверительном управлении **АО «Jusan Invest»**, составили 4,045 млрд тенге. На них были приобретены: паи Exchange Traded Funds (ETF) они составляют 29,74%, ноты НБРК (30,01% портфеля), ГЦБ Министерства финансов РК (17,61%). 9,65% портфеля находится в РЕПО, 12,98% - в денежных средствах на счетах. Отметим, что 65,01 % портфеля представлено в тенге, 34,99 % в долларах США.

В результате инвестиционной деятельности доходность пенсионных активов под управлением АО «Jusan Invest» с начала года составила 0,64%, за 12 месяцев 4,83%.

[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 октября 2022 года составили 2,58 млрд тенге. В структуре портфеля обратное РЕПО (не более 90 календарных дней) составляет 50,11%, облигации квазигосударственных организаций РК 13,29%, долевые инструменты иностранных эмитентов (паи ETF) 12,95%, денежные средства на счетах 7,51%, облигации банков второго уровня РК 5,73%, облигации МФО 4,75%, корпоративные облигации организаций РК 4,49%, прочие активы. Инвестиции в национальной валюте составили 79,13 % портфеля, в долларах США - 20,87%. Доходность пенсионных активов под управлением АО «Halyk Global Markets» с 01.01.2022г. по 01.10.2022г. составила 1,16%, за 12 месяцев 4,5%.

[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 октября текущего года составили 1,46 млрд тенге. Они распределены в государственные облигации РК – 44, 06%, паи (ETF на индексы) – 19,72%, облигации квазигосударственных организаций РК 9,84 %, акции и депозитарные расписки иностранных эмитентов 8,23%, облигации МФО 5,89%, облигации БВУ РК 5,51%, корпоративные облигации эмитентов-резидентов РК 5,23%, денежные средства на инвестиционных счетах 1,42%, прочие активы (дебиторская задолженность, просроченная задолженность, провизии) 0,1%. В инструменты в национальной валюте инвестировано 71,65% портфеля, в долларах США – 28,35%.

В результате инвестиционной деятельности доходность пенсионных активов под управлением АО «BCC Invest» с начала текущего года составила (-0,38%), за 12 месяцев - 3,31%.

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

По состоянию на 1 октября 2022 года пенсионные активы ЕНПФ, находящиеся в доверительном управлении **АО «Сентрас Секьюритиз»**, составили 0,97 млрд тенге. Они инвестированы в ГЦБ МФ РК 54,43%, РЕПО – 14,04%, денежные средства на инвестиционных

счетах 12,66 %, облигации квазигосударственных организаций – 8,88%, акции и депозитарные расписки эмитентов РК - 8,29 %, долевые инструменты иностранных эмитентов (Паи ETF) 1,7%. В инструменты в национальной валюте инвестировано 80,25% портфеля, в долларах США – 19,75%.

В результате инвестиционной деятельности доходность пенсионных активов под управлением АО «Сентрас Секьюритиз» с начала 2022 года составила 2,06%, за 12 месяцев – 4,74%.

Подробная структура инвестиционного портфеля финансовых инструментов под управлением АО «Сентрас Секьюритиз» 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, действующим 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).