

ИНФОРМАЦИОННОЕ СООБЩЕНИЕ

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

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

Общий объем пенсионных активов на 1 мая 2021 года составил 12,6 трлн тенге. При этом пенсионные активы ЕНПФ, находящиеся в доверительном управлении НБРК, составили 12 593,67 млрд тенге. Пенсионные активы ЕНПФ, переведенные вкладчиками в казахстанские управляющие компании, составили более 2,8 млрд тенге.

Инвестиционный портфель пенсионных активов под управлением НБРК

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

- государственные ценные бумаги РК, выпущенные Министерством финансов РК, текущая стоимость которых составляет 5 292,61 млрд тенге (42,3% 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 1 756,42 млрд тенге (13,95%). 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 1 049,25 млрд тенге (8,33%). Средневзвешенная доходность к погашению по облигациям БВУ РК, номинированным в тенге, составила 10% годовых. Текущая стоимость размещенных в БВУ депозитов составила 248,86 млрд тенге (или 1,98% портфеля). Средневзвешенная доходность к погашению вкладов БВУ РК на отчетную дату составила 9,1% годовых.

- активы, находящиеся во внешнем управлении, в размере 1 134,51 млрд тенге (9,01% от портфеля). Прирост по сравнению с 1 января 2021 года составил 38,94%.

Инвестиционный портфель финансовых инструментов в разрезе валют, в которых номинированы финансовые инструменты, приобретенные за счет пенсионных активов ЕНПФ, представлен следующим образом:

инвестиции в национальной валюте – 68,14%, в долларах США – 31,71%, 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» 284,76 млрд тенге;
- доходы от рыночной переоценки ценных бумаг 26,47 млрд тенге;
- доходы от переоценки иностранной валюты 49,23 млрд тенге;
- доходы по активам, находящимся во внешнем управлении 64,15 млрд тенге;
- прочие доходы составили 63,91 млрд тенге.

Таким образом, размер начисленного инвестиционного дохода с начала 2021 года составил 488,52 млрд. тенге. Доходность пенсионных активов ЕНПФ, распределенная на счета вкладчиков (получателей) с начала 2021 года, составила 3,8% при инфляции 2,7 %.

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

Управляющие инвестиционным портфелем

Пенсионные активы, находящиеся в доверительном управлении *АО «Jysan Invest»*, составили 1,2 млрд тенге. На них были приобретены ГЦБ Министерства финансов РК (26,09%), ноты НБРК (27,28% портфеля), паи Exchange Traded Funds (ETF) составляют 46,36% портфеля, остальные активы (0,27%) находятся в денежных средствах на инвестиционных счетах. Доля портфеля в тенге составила 53,64%, в долларах США – 46,36%. Размер начисленного инвестиционного дохода за период с 15.03.2021 года по 30.04.2021 года составил 30,24 млн тенге. В результате инвестиционной деятельности, а также вследствие волатильности курсов иностранных валют и изменения рыночной стоимости финансовых инструментов, доходность пенсионных активов составила 3,69%.

Пенсионные активы, находящиеся в доверительном управлении *АО «Halyk Global Markets»* на 1 мая составили 751,2 млн тенге. В структуре портфеля операции обратного РЕПО (73,42%), облигации БВУ (6,71%), долевые инструменты иностранных эмитентов (19,73%) и денежные средства на счетах. В национальной валюте номинировано 80,27% портфеля, 19,73% - в долларах США. Размер начисленного инвестиционного дохода за период с 15.03.2021 года по 30.04.2021 года составил 5,01 млн. тенге, доходность пенсионных активов за аналогичный период - 0,8%.

По состоянию на 1 мая 2021 года пенсионные активы, находящиеся в доверительном управлении *АО «BCC Invest»*, составили 540,54 млн тенге. Они распределены в облигации квазигосударственных организаций РК (16,65%), облигации БВУ РК (10,66%), паи (ETF на индексы) (28,34%), акции и депозитарные расписки иностранных эмитентов (17,29%), денежные средства на инвестиционных счетах (5,04%). В национальной валюте номинировано 54,3% портфеля, в долларах США 45,7%. Размер начисленного инвестиционного дохода за период с 15.03.2021 года по 30.04.2021 года составил 5,02 млн тенге, доходность пенсионных активов за аналогичный период составила 1,26%.

По состоянию на 1 мая 2021 года пенсионные активы ЕНПФ, находящиеся в доверительном управлении *АО «Сентрас Секьюритиз»*, составили 337,35 млн тенге. Они инвестированы в ГЦБ МФ РК (79,3%), РЕПО (20,47%) и денежные средства на инвестиционных счетах. Все инвестиции произведены в национальной валюте. Размер начисленного инвестиционного дохода за период с 01.04.2021 года по 30.04.2021 года составил 2,64 млн. тенге. В результате инвестиционной деятельности и изменения рыночной стоимости финансовых инструментов, доходность пенсионных активов составила 0,87%.

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