

ИНФОРМАЦИОННОЕ СООБЩЕНИЕ

На сайте enpf.kz представлен отчет об управлении пенсионными активами

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

Вся информация о том, как инвестируются пенсионные сбережения, размещена на сайте enpf.kz в разделе «Показатели – Инвестиционная деятельность». Здесь представлен ежемесячный подробный отчет об инвестировании пенсионных активов Национальным Банком Республики Казахстан (НБРК) и управляющими инвестиционным портфелем (УИП), а также обзоры инвестиционной деятельности.

Как уже [сообщалось](#), общий объем пенсионных активов на 1 ноября 2022 года, превысил 14,15 трлн тенге. При этом пенсионные активы ЕНПФ, [находящиеся в доверительном управлении НБРК](#), составили **14 135,78 млрд тенге**. [Пенсионные активы под управлением УИП](#) составили **9,06 млрд тенге**.

Инвестиционный портфель пенсионных активов под управлением НБРК

Основные направления инвестирования пенсионных активов НБРК на 1 ноября 2022 года представлены следующим образом:

- 47,7% составляют государственные ценные бумаги Республики Казахстан,
- 25,5% - иностранные активы (в том числе активы, находящиеся в индексном управлении, а также ГЦБ иностранных государств, корпоративные облигации иностранных эмитентов),
- порядка 13% - инструменты квазигоссектора,
- более 8% - инструменты БВУ,
- 2,7% - МФО,
- прочие активы.

В целях повышения доходности в долгосрочном периоде и снижения рисков проводится работа по дальнейшей диверсификации портфеля пенсионных активов, увеличению в нем более доходных инструментов.

Инвестиционный портфель в разрезе валют, в которые номинированы финансовые инструменты, приобретенные за счет пенсионных активов, по состоянию на 1 ноября выглядит так:

инвестиции в национальной валюте – 70,53%, в долларах США – 28,41%, в другой валюте – 0,06% портфеля пенсионных активов.

Надо отметить, что с 2014 года, периода передачи всех пенсионных активов под управление НБРК, валютная доля пенсионных активов увеличилась с 17% до порядка 28,5%.

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 672,49 млрд тенге. Доходность пенсионных активов за 10 месяцев 2022 года составила 4,82 %, за последние 12 месяцев (с ноября 2021 года по октябрь 2022 года) составила 5,97 %. За период с 2014 по октябрь 2022 года накопленный инвестиционный доход составил **6,7 трлн тенге**, а накопленная доходность пенсионных активов составляет **119,5%** при инфляции **115,2%**.

[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 в доверительном управлении **АО «Jusan Invest»** составили **4,079 млрд тенге**. На них были приобретены: паи Exchange Traded Funds (ETF) - они составляют 30,65% портфеля; ноты НБРК (22,36% портфеля); ГЦБ Министерства финансов РК (17,67%). 24,69% портфеля находится в РЕПО, 4,59% - в ГЦБ иностранных государств. Отметим, что 64,73% портфеля представлено в тенге, 35,27 % в долларах США.

В результате инвестиционной деятельности доход с начала года составил 39,17 млн тенге, доходность пенсионных активов за период составила 1,43%.

[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 ноября 2022 года составили 2,61 млрд тенге. В структуре портфеля обратное РЕПО (не более 90 календарных дней) составляет 49,26 %; облигации квазигосударственных организаций РК 13,23%; долевые инструменты иностранных эмитентов (паи ETF) также 13,23%; ценные бумаги, имеющие статус государственных, выпущенные центральными правительствами иностранных государств – 6,88%; облигации банков второго уровня РК 5,71%; корпоративные облигации организаций РК 4,49%; облигации МФО 4,24%, прочие активы. Инвестиции в национальной валюте составили 79,10 % портфеля, в долларах США - 20,90%.

Размер инвестиционного дохода с начала года составил 60,09 млн тенге, доходность пенсионных активов под управлением АО «Halyk Global Markets» с 01.01.2022г. по 01.11.2022г. составила 2,29%.

[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 ноября текущего года составили 1,48 млрд тенге. Они распределены в государственные облигации РК – 44,06%; облигации квазигосударственных организаций РК 15,74 %; паи (ETF на индексы) – 11,93%; акции и депозитарные расписки иностранных эмитентов 8,34%; облигации МФО 5,88%; облигации БВУ РК 5,51%; корпоративные облигации эмитентов-резидентов РК 5,22%; денежные средства на инвестиционных счетах 3,25%; прочие активы. В инструменты в национальной валюте инвестировано 70,77% портфеля, в долларах США – 29,23%.

В результате инвестиционной деятельности доход с начала года составил 4,43 млн тенге, доходность пенсионных активов под управлением АО «BCC Invest» за десять месяцев составила 0,35%.

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

По состоянию на 1 ноября 2022 года пенсионные активы ЕНПФ, находящиеся в доверительном управлении **АО «Сентрас Секьюритиз»**, составили 0,98 млрд тенге. Они

инвестированы в ГЦБ МФ РК 54,6%; РЕПО – 15,39%; денежные средства на инвестиционных счетах 11,86 %; облигации квазигосударственных организаций – 8,34%; акции и депозитарные расписки эмитентов РК - 8,06 %; долевые инструменты иностранных эмитентов (Паи ETF) 1,76%. В инструменты в национальной валюте инвестировано 80,72% портфеля, в долларах США – 19,28%.

В результате инвестиционной деятельности размер инвестиционного дохода составил с начала года 29,4 млн тенге, доходность пенсионных активов под управлением АО «Сентрас Секьюритиз» за период составила 2,48%.

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, действующих 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).