

ИНФОРМАЦИОННОЕ СООБЩЕНИЕ

Доходность пенсионных активов под управлением НБРК за год составила 13,65%

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

На сайте enpf.kz в разделе «Показатели – Инвестиционная деятельность» размещена подробная информация об инвестировании пенсионных активов Национальным Банком Республики Казахстана (НБРК) и управляющими инвестиционным портфелем (УИП), а также обзоры инвестиционной деятельности по состоянию на 1 марта 2022 года.

Из представленных отчетов следует: общий объем пенсионных активов, находящихся в управлении на 1 марта 2022 года, составили 13,6 трлн тенге. При этом пенсионные активы ЕНПФ, [находящиеся в доверительном управлении НБРК](#), составили 13 580,07 млрд тенге. [Пенсионные активы под управлением УИП](#) составили 8,2 млрд тенге.

Инвестиционный портфель пенсионных активов под управлением НБРК

На 1 марта 2022 года в рамках направлений, одобренных Советом по управлению Национальным фондом РК, основные инвестиции НБРК (как доверительным управляющим) в финансовые инструменты представлены [следующим образом](#):

- государственные ценные бумаги РК, выпущенные Министерством финансов РК, текущая стоимость которых составляет 5 116,81 млрд тенге (37,68% от всего портфеля). Средневзвешенная доходность к погашению по ГЦБ Министерства финансов РК, номинированным в тенге, составила 9,6% годовых, в долларах США – 3,4% годовых.

- облигации квазигосударственных организаций РК (текущая стоимость 1 687,72 млрд тенге (доля в портфеле составила 12,43%). Средневзвешенная доходность к погашению по облигациям квазигосударственных организаций РК, номинированным в тенге, составила 10,8% годовых, в долларах США – 5,5% годовых.

- облигации банков второго уровня РК на сумму 937,98 млрд тенге (6,91%). На отчетную дату средневзвешенная доходность к погашению по облигациям БВУ РК составила 10,2% годовых.

- государственные ценные бумаги иностранных государств составили 757,46 млрд тенге. Их доля в портфеле составила 5,58%. Средневзвешенная доходность к погашению ГЦБ иностранных государств в портфеле ПА ЕНПФ на отчетную дату составила 0,4% годовых.

- облигации международных финансовых организаций составили 396,29 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 2,92%. Средневзвешенная доходность к погашению по облигациям международных финансовых организаций составила 10,0% годовых.

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

инвестиции в национальной валюте – 65,67%, в долларах США – 34,27%, в другой валюте – 0,05% 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 534,17 млрд. тенге. Доходность пенсионных активов ЕНПФ, распределенная на счета вкладчиков (получателей) с начала 2022 года, составила 4,00% при инфляции 1,50%. Таким образом, реальная доходность по пенсионным активам ЕНПФ составила 2,50%.

При этом по состоянию на 1 марта 2022 года доходность пенсионных активов за последние 12 месяцев (с марта 2021 года по февраль 2022 года) для вкладчиков (получателей) ЕНПФ составила

13,65% при инфляции в размере 8,70%. Таким образом, за последние 12 месяцев реальная доходность по пенсионным активам ЕНПФ составила 4,95%.

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

Управляющие инвестиционным портфелем

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

Пенсионные активы, находящиеся в доверительном управлении **АО «Jusan Invest»**, составили 3,81 млрд тенге. На них были приобретены: ноты НБРК (31,05% портфеля), паи Exchange Traded Funds (ETF) они составляют 29,77%, ГЦБ Министерства финансов РК (22,54%), активы в денежных средствах на инвестиционных счетах - 15,41%, Репо - 1,23%. Отметим, что 54,89% портфеля представлено в тенге, 45,11% в долларах США.

В результате инвестиционной деятельности доходность пенсионных активов с начала года составила 5,79%.

[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 марта 2022 года составили 2,27 млрд тенге. В структуре портфеля операции обратного РЕПО составляют 40,74%, инструменты иностранных эмитентов (Паи ETF) 19,79%, облигации квазигосударственных организаций РК 12,94%, акции и депозитарные расписки иностранных эмитентов 8,49%, облигации банков второго уровня РК 6,85%, корпоративные облигации организаций РК 5,34%, МФО 5,38%, денежные средства на счетах 0,43%, прочие активы (дебиторская задолженность, просроченная задолженность, провизии) 0,04%. Инвестиции в национальной валюте составили 71,38% портфеля, в долларах США - 28,62%. Доходность пенсионных активов с 01.01.2022г. по 01.03.2022г. составила 3,45%.

[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 марта текущего года составили 1,35 млрд тенге. Они распределены в паи (ETF на индексы) 27,69%, Репо 20,69%, облигации квазигосударственных организаций РК 15,15%, акции и депозитарные расписки иностранных эмитентов 11,37%, облигации МФО 7,35%, облигации БВУ РК 6,29%, корпоративные облигации эмитентов-резидентов РК 5,98%, денежные средства на инвестиционных счетах 5,45%, прочие активы (дебиторская задолженность, просроченная задолженность, провизии) 0,02%. В инструменты в национальной валюте инвестировано 55,55% портфеля, в долларах США – 44,45%.

В результате инвестиционной деятельности доходность пенсионных активов с начала текущего года составила 5,74%.

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

По состоянию на 1 марта 2022 года пенсионные активы ЕНПФ, находящиеся в доверительном управлении **АО «Сентрас Секьюритиз»**, составили 814,62 млн. тенге. Они инвестированы в ГЦБ МФ РК 66,56%, Репо 18,54%, акции и депозитарные расписки эмитентов РК 13,20%, денежные средства на инвестиционных счетах 1,57%, прочие активы (дебиторская

задолженность, просроченная задолженность, провизии) 0,12%. Все инвестиции произведены в национальной валюте.

В результате инвестиционной деятельности доходность пенсионных активов с начала 2022 года составила (-2,60%).

Подробная структура инвестиционного портфеля финансовых инструментов под управлением АО «Сентрас Секьюритиз» с указанием эмитентов представлена на сайте ЕНПФ.

Кроме того, на сайте ЕНПФ во вкладке «Показатели» имеется раздел «Краткий обзор инвестиционного портфеля пенсионных активов», в котором представлена общая информация по структуре инвестиционного портфеля.

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).