

ИНФОРМАЦИОННОЕ СООБЩЕНИЕ

Инвестиционный портфель пенсионных активов ЕНПФ по состоянию на 1 января 2021 года

По состоянию на 1 января 2021 года пенсионные активы ЕНПФ, находящиеся в доверительном управлении Национального Банка Республики Казахстан, составили порядка 12,9 трлн тенге.

Структура инвестиционного портфеля финансовых инструментов, сформированного за счет пенсионных активов ЕНПФ по состоянию на отчетную дату, размещена на официальном сайте ЕНПФ в разделе «Показатели»-«Инвестиционная деятельность».

В рамках направлений, одобренных Советом по управлению Национальным фондом РК на 2020 год, НБ РК (как доверительным управляющим) основные направления инвестирования представлены следующим образом:

- государственные ценные бумаги РК, выпущенные Министерством финансов РК, текущая стоимость которых составляет 5 648,4 млрд тенге (43,8 % от всего портфеля), средневзвешенная доходность ГЦБ, номинированных в тенге, составила 8,8 % годовых, в долларах США – 4,4% годовых;

- облигации квазигосударственных организаций РК (текущая стоимость 1 821,67 млрд тенге (14,13 %), средневзвешенная доходность по этим инструментам, номинированным в тенге, составила 10,8 % годовых, в долларах США – 5,2 % годовых;

- облигации банков второго уровня РК на сумму 1 158,49 млрд тенге (8,98 %). По сравнению с началом года доля облигаций БВУ уменьшилась на 2,1 %. Средневзвешенная доходность к погашению по облигациям БВУ РК, номинированным в тенге, составила 10,1 % годовых, в долларах США – 6,3% годовых;

- активы, находящиеся во внешнем управлении в размере 816,53 млрд тенге (6,33 % от портфеля). Прирост на 285,36% по сравнению с 1 января 2020 года обусловлен произведенными согласно условиям мандата инвестициями в течение отчетного периода.

Активы диверсифицированы также в депозиты иностранных и казахстанских банков (соответственно, 2,19 % и 1,95 % от всего портфеля), депозиты Национального Банка Республики Казахстан (для составляет 2, 58%), акции и депозитарные расписки казахстанских эмитентов (доля 2,28%), акции и депозитарные расписки иностранных эмитентов (0,24%) и другие финансовые инструменты на рыночных условиях.

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 – 70,91 %, в долларах США – 28,9 %, в других валютах – 0,19 % портфеля пенсионных активов.

Структура начисленного инвестиционного дохода выглядит следующим образом:

- доходы в виде вознаграждения по ценным бумагам, в том числе по размещенным вкладам и операциям «обратное РЕПО» 831,68 млрд тенге;

- доходы (убытки) от рыночной переоценки ценных бумаг 85,76 млрд тенге;

- доходы (убытки) от переоценки иностранной валюты 291,02 млрд тенге;

- доходы (убытки) от переоценки прочих активов (ПФИ) (5,49) млрд тенге;

- доходы (убытки) по активам, находящимся во внешнем управлении 50,25 млрд тенге;

- прочие доходы составили 9,28 млрд тенге.

В результате инвестиционной деятельности, а также вследствие волатильности курсов иностранных валют и изменения рыночной стоимости финансовых инструментов, размер начисленного инвестиционного дохода с начала 2020 года составил 1,3 трлн тенге. Доходность пенсионных активов ЕНПФ, распределенная на счета вкладчиков (получателей) с начала 2020 года, составила 10,92 %, при инфляции 7,5 %.

Инвестиционный доход, полученный вкладчиками с начала действия накопительной пенсионной системы, превысил 5,6 трлн тенге. Инвестиционная доходность с 1998 года (начала функционирования накопительной пенсионной системы) с нарастающим итогом составила 602,90%. При этом инфляция составила 496,65%. Таким образом, реальная доходность пенсионных активов на 1 января 2021 года составила 106,25 %.

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).