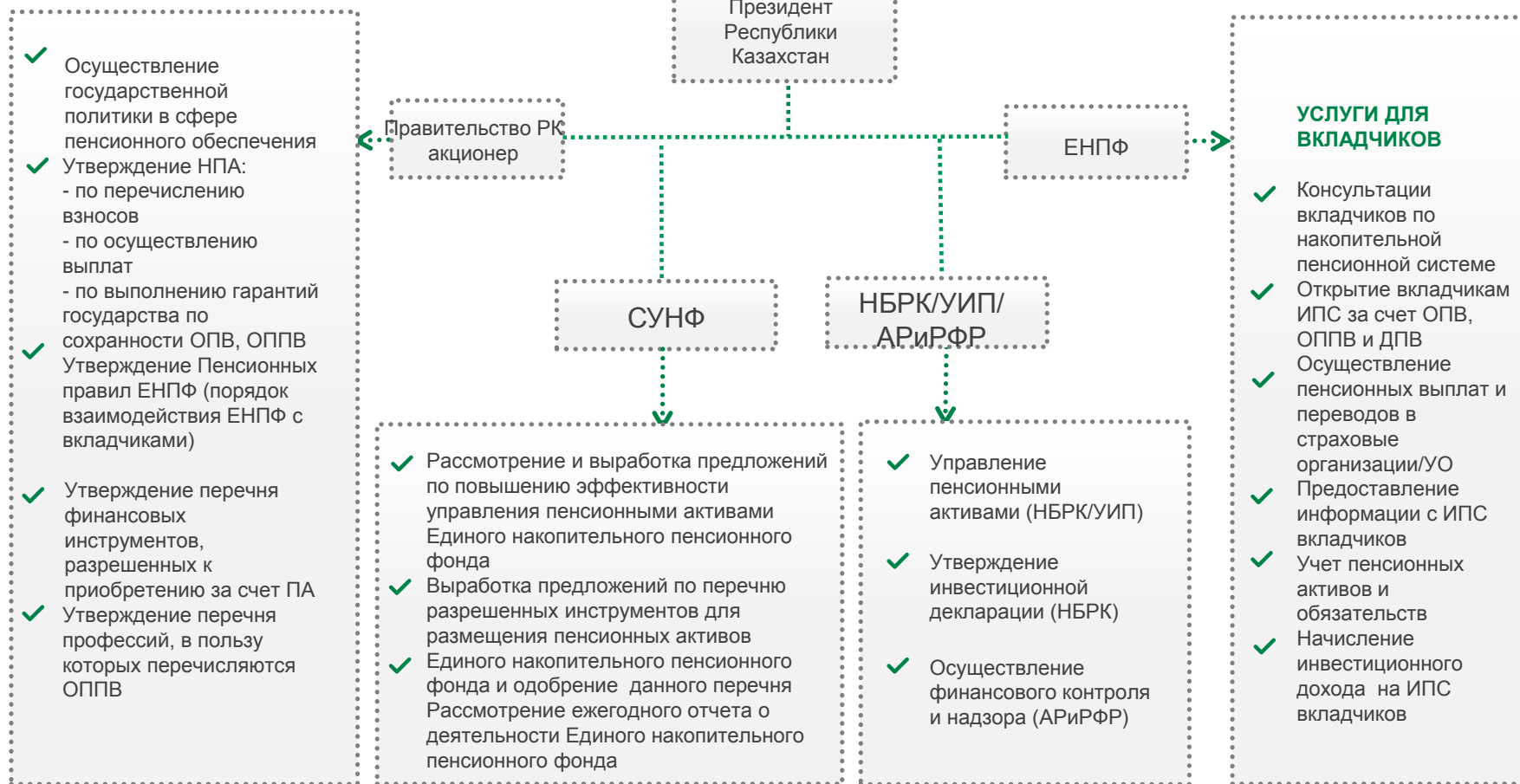


Пенсионные накопления в доверительном управлении у управляющего инвестиционным портфелем (УИП)

Как и куда были инвестированы пенсионные активы под управлением УИП по состоянию на 1 октября 2021 года



УЧАСТНИКИ НАКОПИТЕЛЬНОЙ ПЕНСИОННОЙ СИСТЕМЫ





ЦЕЛИ ИНВЕСТИРОВАНИЯ ПА ЕНПФ:

- обеспечение сохранности пенсионных накоплений вкладчиков и получение инвестиционного дохода



СОЦИАЛЬНАЯ ОТВЕТСТВЕННОСТЬ:

- инвестирование ПА ЕНПФ осуществляется в интересах вкладчиков



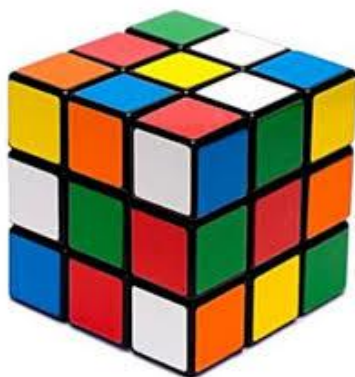
ЗАЩИТА ОТ РИСКА (ДИВЕРСИФИКАЦИЯ):

- получение реальной доходности в долгосрочной перспективе, за счет оптимального сочетания различных видов финансовых инструментов (путем обеспечения соотношения риск – доходность)



Портфель подвержен риску:

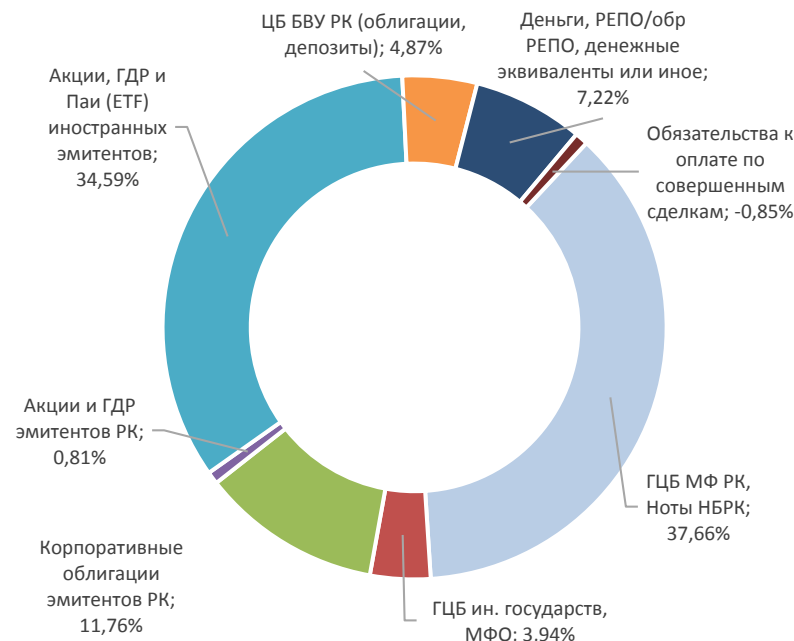
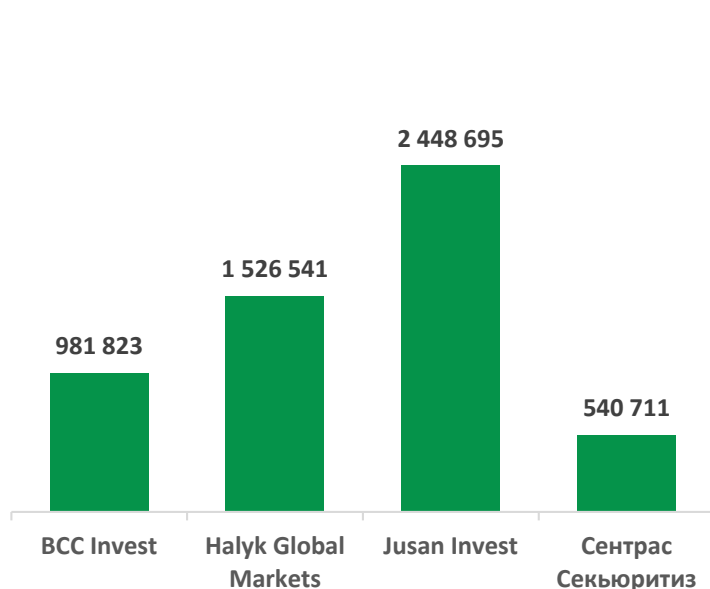
- за счет высокой концентрации пенсионных активов на одном виде финансовых инструментов (секторе, валюте, стране и т.д.).



Минимизация рисков портфеля:

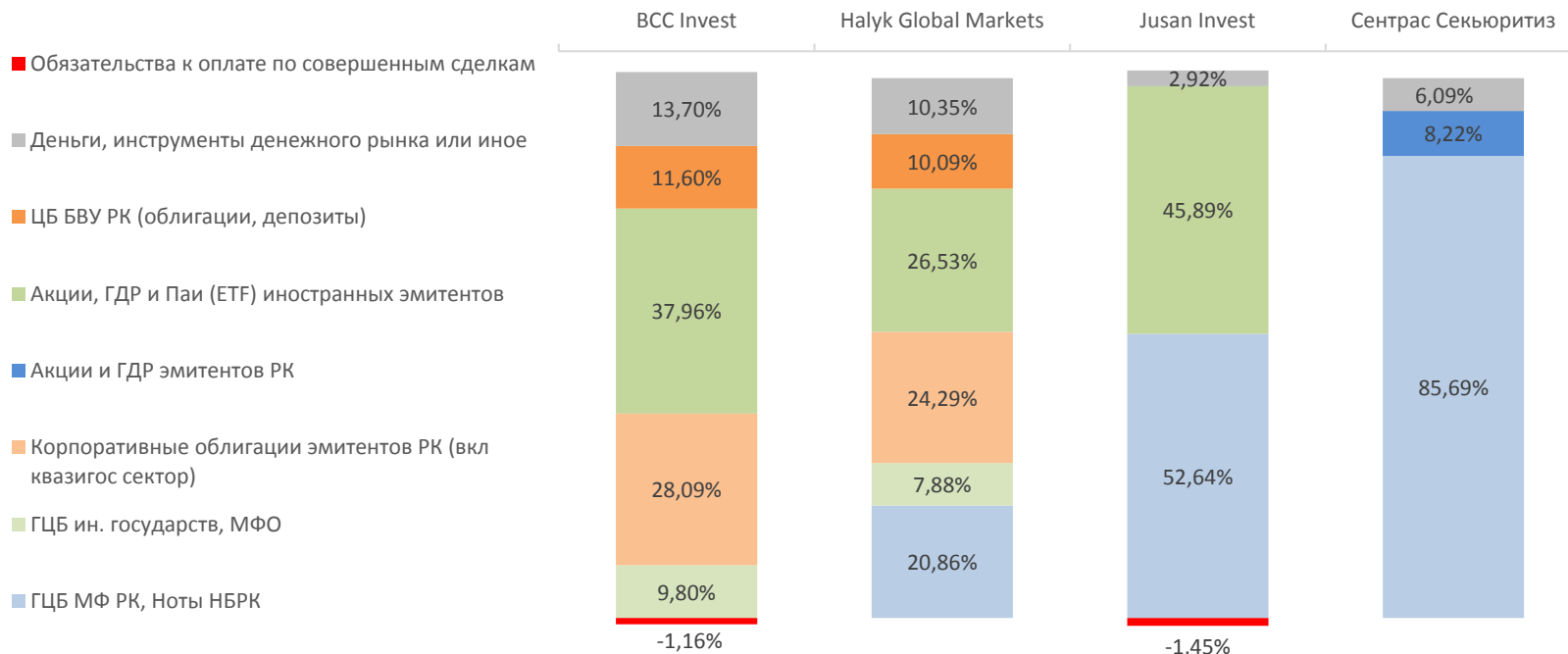
- за счет оптимального сочетания различных видов финансовых инструментов (секторов, валют, стран и т.д.) обеспечивается сохранность пенсионных активов.

Структура портфелей пенсионных активов по видам ФИ в разрезе управляющих компаний, %



- ✓ По состоянию на 1 октября 2021 года пенсионные активы ЕНПФ находящиеся в доверительном управлении УИП составили **5,54** млрд тенге;
- ✓ В основном большая часть инвестиций по видам финансовых инструментов распределена по ГЦБ Министерства Финансов Республики Казахстан и долевым ценным бумагам иностранных эмитентов (Акции, ГДР и Паи (ETF)).

Структура портфелей пенсионных активов по видам ФИ в разрезе управляющих компаний, %

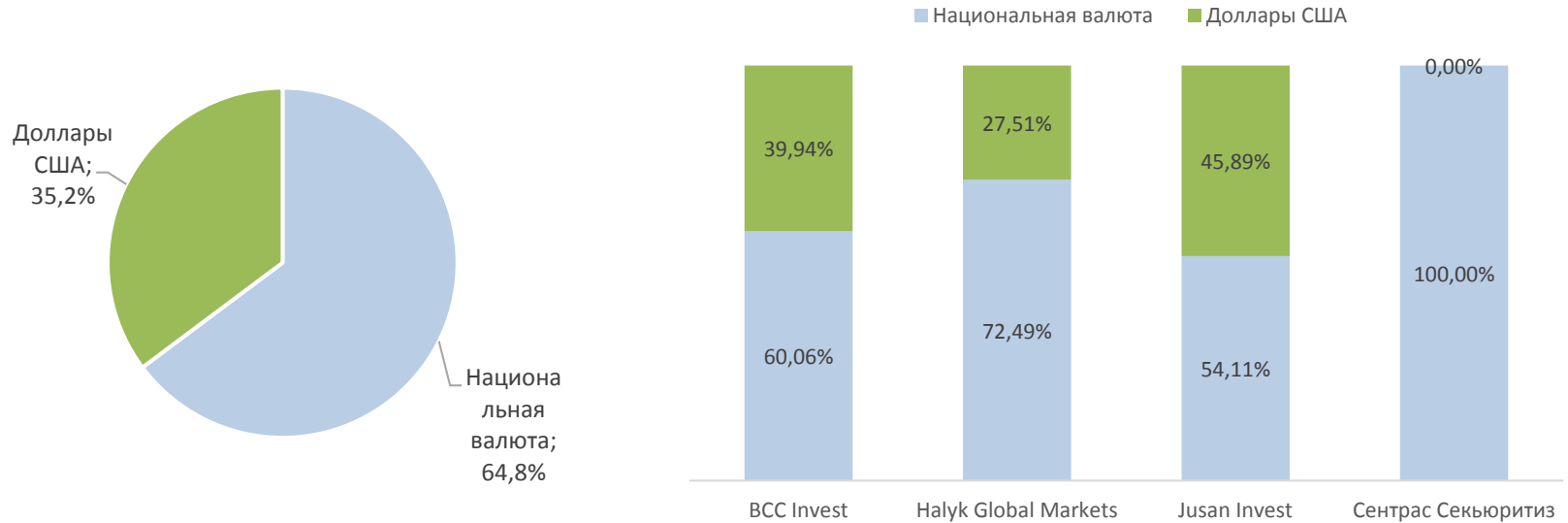


Пенсионные активы инвестируются на рыночных условиях в различные виды как казахстанских, так и зарубежных финансовых инструментов;



При инвестировании ПА по видам финансовых инструментов УИП-ами соблюдается принцип диверсификации.

Структура портфелей пенсионных активов по валютам в разрезе управляющих компаний, %

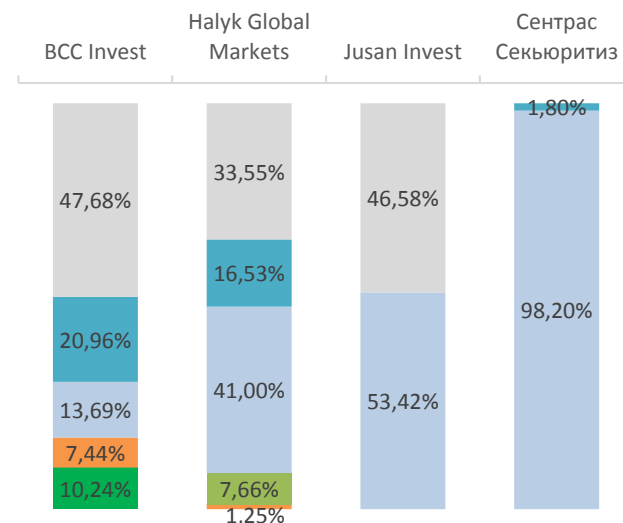
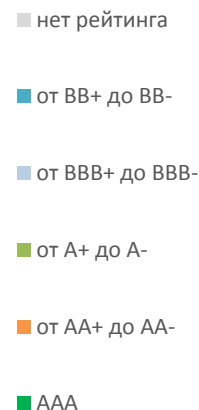
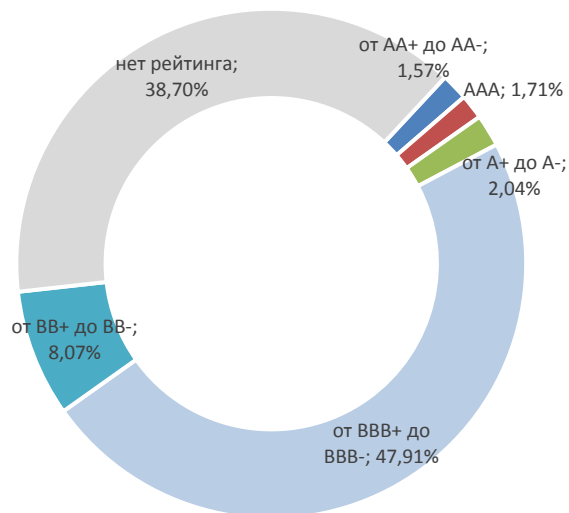


По состоянию на 1 октября 2021 года ПА под управлением УИП инвестированы в тенге (64,8%) и доллары США (35,2%);



Инвестиции в валюте управляющих компаний представлены в тенге и долларах США (за исключением Сентрас Секьюритиз).

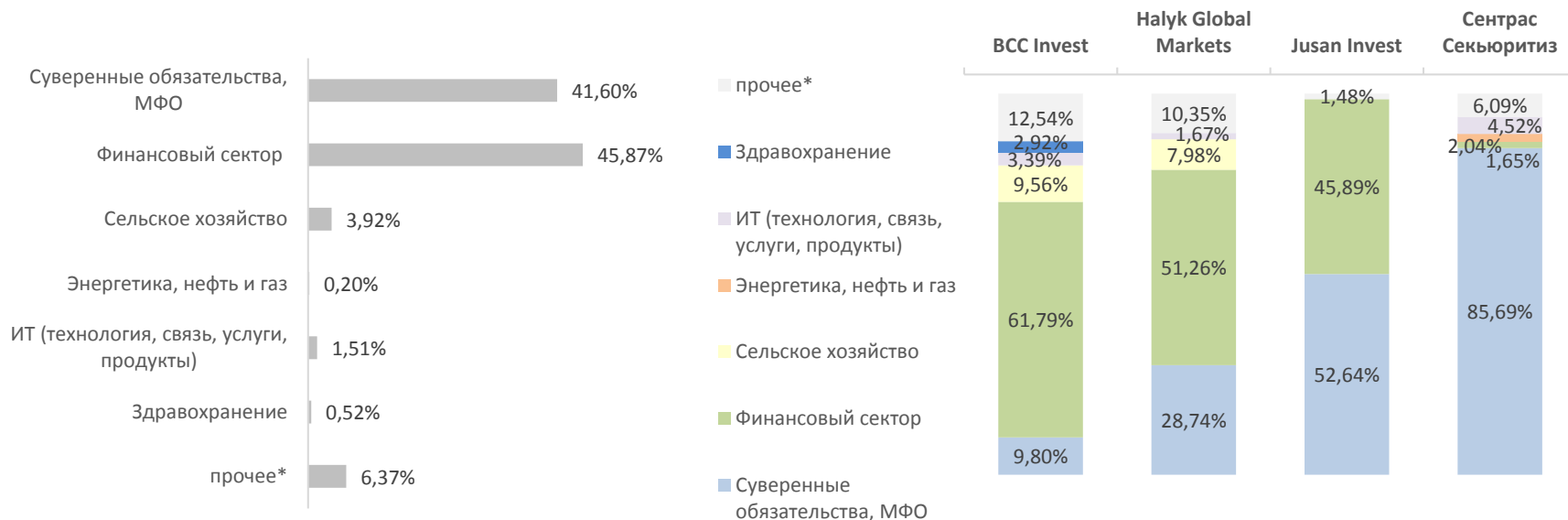
Структура портфелей пенсионных активов по кредитному качеству в разрезе управляющих компаний, %



- ✓ Финансовые инструменты с минимальным уровнем риска, с рейтингом ценных бумаг/эмитента по международной шкале от «AAA» до «BBB-» составляют 53,23% инвестиционного портфеля*;
- ✓ Финансовые инструменты с рейтингом по международной шкале от «BB+» до «B-» составляют 8,07%;
- ✓ Финансовые инструменты без рейтинговых оценок составляют 38,7%. В этой связи, наибольшую часть активов составляют долевые финансовые инструменты иностранных эмитентов (акции, депозитарные расписки, Паи ETF).

* - Активы, находящиеся в инвестиционном портфеле, за исключением остатков на счетах, денег в пути и пр.

Структура портфелей пенсионных активов по секторам экономики в разрезе управляющих компаний, %



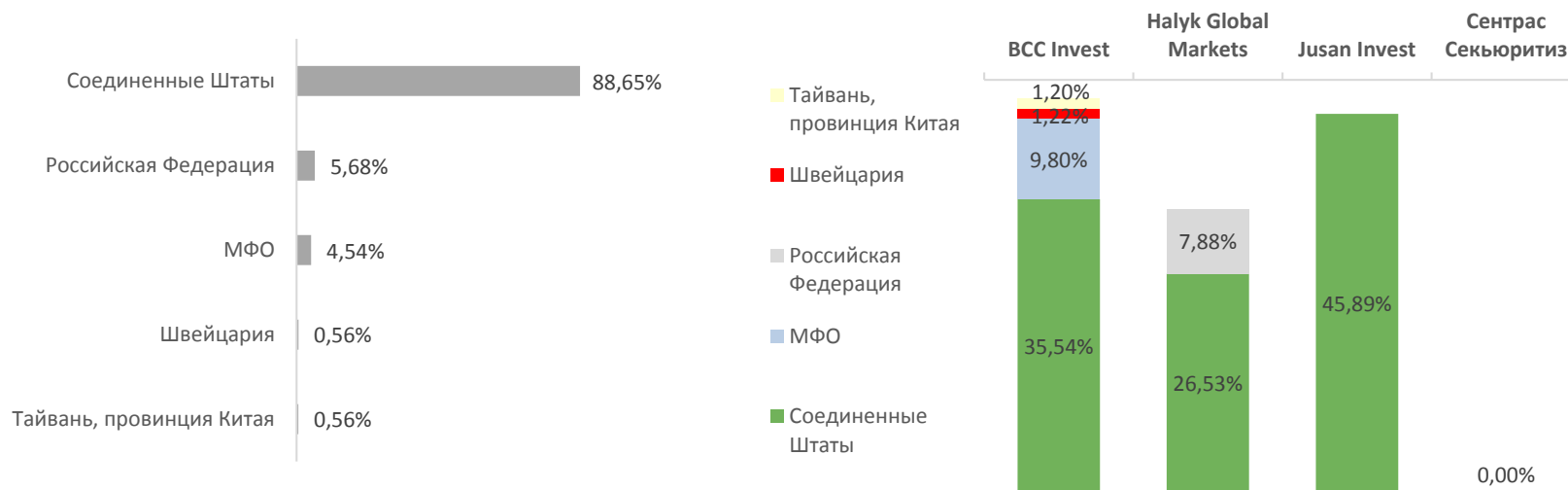
По состоянию на 1 октября 2021 года большая часть пенсионных накоплений переданные в доверительное управление УИП, была инвестирована в сектора экономики - Суверенные обязательства, МФО (41,60%), и в финансовый сектор (45,87%);



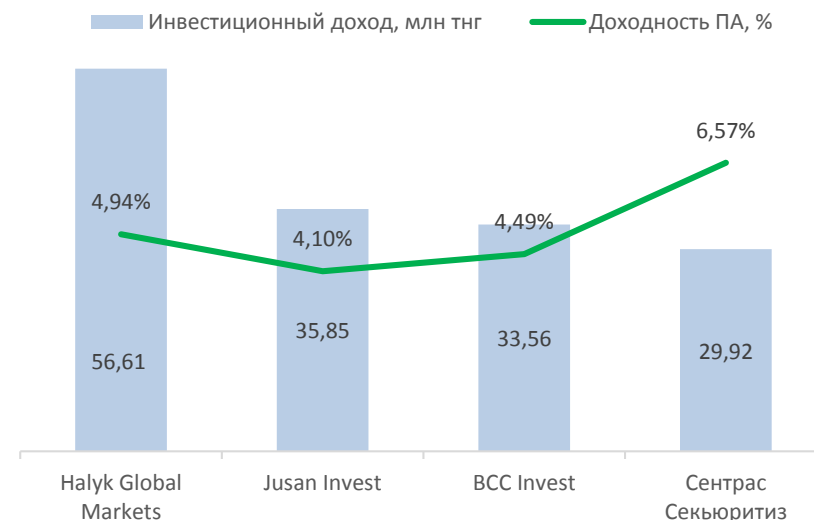
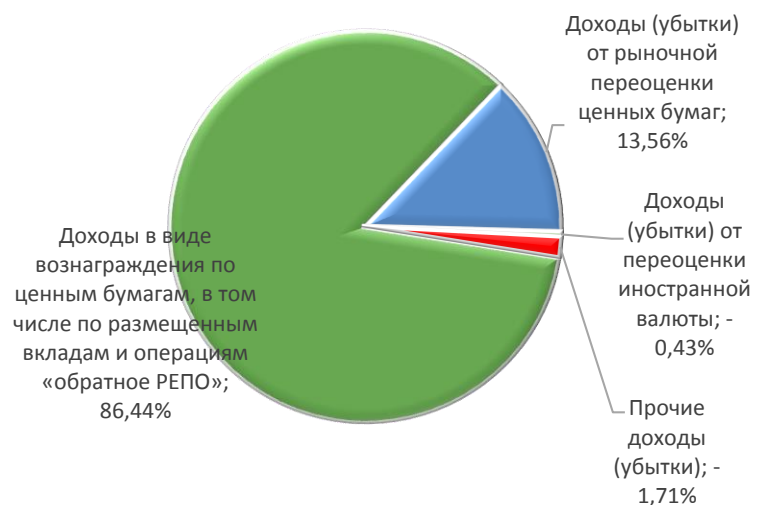
Порядка 85,69% инвестиционного портфеля Сентрас Секьюритиз инвестирована в сектор экономики - Суверенные обязательства, МФО.

* -дебиторская задолженность, остатки денежных средств на счетах и производные финансовые инструменты.

Структура портфеля пенсионных активов по странам в разрезе управляющих компаний, %



- ✔ По состоянию на 1 октября 2021 года большая часть пенсионных накоплений переданные в доверительное управление УИП, была инвестирована в ценные бумаги государства США (88,65%);
- ✔ Инвестиционный портфель пенсионных активов Сентрас Секьюритиз полностью сформирован из ценных бумаг Республики Казахстан.



- ✔ В результате инвестиционной деятельности, совокупный размер начисленного инвестиционного дохода (по состоянию на 01 октября 2021 года) с начала передачи пенсионных накоплений под управление УИП составил **155,9 млн тенге**;
- ✔ Основную часть инвестиционного дохода составляют вознаграждения по ценным бумагам, размещенным вкладам и операциям «обратное РЕПО» - 86,4%;
- ✔ Доходности пенсионных активов УИП представлены с момента передачи ПА в доверительное управление (апрель 2021г.). Учитывая волатильности курсов валют и изменения рыночной стоимости финансовых инструментов доходности ПА могут меняться, как в сторону увеличения, так и сторону снижения.

Подробная структура инвестиционного портфеля финансовых инструментов каждого УИП с указанием эмитентов и номинальной доходности и обзор инвестиционной деятельности размещены на официальном сайте ЕНПФ

О ФОНДЕ **ПОКАЗАТЕЛИ** О ПЕНСИОННОЙ СИСТЕМЕ УСЛУГИ ЭЛЕКТРОННЫ

Инвестиционная деятельность

ОБЗОР ИНВЕСТИЦИОННОЙ ДЕЯТЕЛЬНОСТИ

АО "ЕНПФ" ДУ НБРК АО "Jusan Invest" АО "BCC Invest" АО "Halyk Global Markets" АО "Сентрас Секьюритиз"

Инвестиционная декларация единого накопительного пенсионного фонда

2021 2020 2

- НБРК_Информация по инвестиционному управлению пенсионными активами АО «ЕНПФ» на 1 января 2021 года.pdf
- НБРК_Информация по инвестиционному управлению пенсионными активами АО «ЕНПФ» на 1 февраля 2021 года.pdf
- НБРК_Информация по инвестиционному управлению пенсионными активами АО «ЕНПФ» на 1 марта 2021 года.pdf
- НБРК_Информация по инвестиционному управлению пенсионными активами АО «ЕНПФ» на 1 апреля 2021 года.pdf
- НБРК_Информация по инвестиционному управлению пенсионными активами АО «ЕНПФ» на 1 мая 2021 года.pdf
- НБРК_Информация по инвестиционному управлению пенсионными активами АО «ЕНПФ» на 1 июня 2021 года.pdf
- НБРК_Информация по инвестиционному управлению пенсионными активами АО «ЕНПФ» на 1 июля 2021 года.pdf
- Структура инвестиционного портфеля единого накопительного пенсионного фонда, сформированного за счет пенсионных активов по состоянию на 01 августа 2021 года(размещено 26.07.2021, 12:00).pdf

**СПАСИБО ЗА
ВНИМАНИЕ!**

**Готовы ответить
на ваши вопросы**

