

ИНФОРМАЦИОННОЕ СООБЩЕНИЕ

Инвестиционные портфели пенсионных активов под управлением НБРК и УИП по состоянию на 1 июля 2024 года

АО «ЕНПФ» (далее - ЕНПФ) представляет отчет об управлении пенсионными активами Национальным Банком Республики Казахстан (далее - НБРК) и управляющими инвестиционным портфелем (далее - УИП) на сайте enpf.kz в разделе «Показатели - Инвестиционная деятельность».

Общий объем пенсионных активов на 1 июля 2024 года составил более **19 988,59 млрд тенге**. По состоянию на 1 июля 2024 года пенсионные активы¹ (далее - ПА) ЕНПФ, находящиеся в доверительном управлении НБРК, сформированные за счет обязательных пенсионных взносов (далее - ОПВ), обязательных профессиональных пенсионных взносов (далее - ОППВ), добровольных пенсионных взносов (далее - ДПВ), составили **19 838,39 млрд тенге**². Объем пенсионных активов НБРК, сформированных за счет обязательных пенсионных взносов работодателя (далее - ПА ОПВР), **находящихся в доверительном управлении НБРК, - 98 млрд тенге**.

Пенсионные активы под управлением УИП составили порядка **52,2 млрд тенге**.

Инвестиционный портфель пенсионных активов под управлением НБРК

Основные направления инвестирования **пенсионных активов НБРК, сформированных за счет ОПВ, ОППВ, ДПВ**, на 1 июля 2024 года выглядят следующим образом: государственные ценные бумаги Министерства финансов РК – 44,34%, облигации квазигосударственных компаний – 9,91%, облигации банков второго уровня Республики Казахстан – 4,08%, государственные ценные бумаги иностранных государств – 3,73%, акции и депозитарные расписки эмитентов РК – 1,89%, МФО – 1,73%.

Инвестиционный портфель в разрезе валют, в которые номинированы финансовые инструменты, приобретенные за счет ОПВ, ОППВ, ДПВ, по состоянию на 1 июля 2024 г. выглядит так: инвестиции в национальной валюте – 63,41%, в долларах США – 36,58% портфеля пенсионных активов.

Из анализа структуры полученного дохода следует, что доходы в виде вознаграждения по ценным бумагам, в том числе по размещенным вкладам и операциям «обратное РЕПО» и от рыночной переоценки ценных бумаг, составили 775,76 млрд тенге, по активам, находящимся во внешнем управлении – 357,44 млрд тенге, от переоценки иностранной валюты - 148,36 млрд тенге, прочие доходы – 1,69 млрд тенге. Убытки от рыночной переоценки ценных бумаг составили 49,79 млрд тенге.

За счет диверсификации инвестиционного портфеля пенсионных активов по инструментам, отраслям и валютам общий доход за январь-июнь 2024 г. является положительным.

В результате инвестиционной деятельности, а также вследствие волатильности курсов иностранных валют и изменения рыночной стоимости финансовых инструментов, размер начисленного инвестиционного дохода с начала 2024 года составил **1,23 трлн тенге**.

Доходность пенсионных активов ЕНПФ, распределенная на счета вкладчиков (получателей), с начала 2024 года по состоянию на 1 июля 2024 г. составила 6,59%.

¹ сформированные за счет обязательных пенсионных взносов, обязательных профессиональных пенсионных взносов и добровольных пенсионных взносов

² без учета денег на счетах пенсионных взносов и выплат

Направления инвестирования пенсионных активов за счет **ОПВР** на 1 июля 2024 года выглядят следующим образом: государственные ценные бумаги Министерства финансов РК – 94,38%, депозиты НБРК – 5,62%, денежные средства на инвестиционных счетах – 0,002%.

Инвестиционный портфель ОПВР включает только финансовые инструменты, номинированные в национальной валюте.

Размер начисленного инвестиционного дохода за счет ОПВР с начала 2024 года по состоянию на 1 июля составил **392,22 млн тенге**, доходность ОПВР - 1,84%.

Напомним, что в средне- и долгосрочной перспективе обеспечивается положительная реальная (превышающая накопленную инфляцию) доходность пенсионных накоплений.

[Подробная структура](#) инвестиционного портфеля финансовых инструментов под управлением НБРК с указанием эмитентов и обзор инвестиционной деятельности размещены на официальном сайте ЕНПФ. Также на сайте enpf.kz размещена информация о [структуре портфеля](#) по пенсионным активам, сформированным за счет ОПВР.

Управляющие инвестиционным портфелем

Общий объем пенсионных активов, находящихся под управлением УИП, составляет более **52,2 млрд тенге**.

По состоянию на 01.07.2024 г. пенсионные активы, находящиеся в доверительном управлении АО «*Jusan Invest*», составили **около 9 млрд тенге**.

Основные инвестиции компании: ГЦБ МФ РК – 33,99%, паи Exchange Traded Funds (ETF) – 31,64%, облигации банков второго уровня РК – 7,74%, ГЦБ иностранных государств – 6,82%, РЕПО – 3,46%. Отметим, что 59,34% портфеля представлено в тенге, 40,66% - в долларах США.

В результате инвестиционной деятельности размер начисленного инвестиционного дохода с начала года по состоянию на 1 июля 2024 г. составил 631,18 млн тенге. Доходность пенсионных активов - 7,64%.

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

По состоянию на 01.07.2024 г. пенсионные активы, находящиеся в доверительном управлении АО «*Halyk Global Markets*», составили более **4,1 млрд тенге**.

Основные инвестиции в структуре портфеля таковы: «обратное РЕПО» (не более 90 календарных дней) – 17,91%, корпоративные облигации иностранных эмитентов – 17,09%, облигации квазигосударственных организаций РК – 16,75%, государственные ценные бумаги Министерства финансов РК – 10,97%, корпоративные облигации организаций РК – 8,02%, долевые инструменты иностранных эмитентов (Паи ETF) – 6,37%.

Инвестиции в национальной валюте составили 69,05% портфеля, в долларах США - 30,95%.

В результате инвестиционной деятельности, размер начисленного инвестиционного дохода с начала 2024 года по состоянию на 1 июля 2024 г. составил 259,09 млн тенге. Доходность пенсионных активов - 6,44%.

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

По состоянию на 01.07.2024 г. пенсионные активы ЕНПФ, находящиеся в доверительном управлении АО «*BCC Invest*», составили порядка **4,8 млрд тенге**.

Основные направления инвестиций: облигации квазигосударственных организаций Республики Казахстан – 34,43%, ГЦБ МФ РК – 12,71%, облигации БВУ РК – 9,37%, корпоративные облигации эмитентов-резидентов РК – 9,29%, паи (ETF на индексы) – 6,59%, корпоративные облигации иностранных эмитентов – 6,85%.

В инструменты в национальной валюте инвестировано 84,72% портфеля, в долларах США - 15,28%.

В результате инвестиционной деятельности размер начисленного инвестиционного дохода с начала 2024 года по состоянию на 1 июля составил 335,23 млн тенге. Доходность пенсионных активов - 7,37%.

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

По состоянию на 01.07.2024 г. пенсионные активы ЕНПФ, находящиеся в доверительном управлении АО «**Сентрас Секьюритиз**», составили более **1,31 млрд тенге**.

В ГЦБ МФ РК инвестировано 26,06% активов, РЕПО – 19,24%, облигации квазигосударственных организаций – 14,43%, денежные средства на инвестиционных счетах – 11,99%, акции и депозитарные расписки эмитентов РК – 9,59%, корпоративные облигации эмитентов РК – 7,76%.

В инструменты в национальной валюте инвестировано 72,04% портфеля, в долларах США - 26,35%, в канадских долларах - 1,60%.

В результате инвестиционной деятельности и изменения рыночной стоимости финансовых инструментов, размер начисленного инвестиционного дохода с начала 2024 года по состоянию на 1 июля составил 101,30 млн тенге. Доходность пенсионных активов - 8,28%.

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

По состоянию на 1 июля 2024 года пенсионные активы, находящиеся в доверительном управлении АО «**ДО Народного Банка Казахстана «Halyk Finance»**, составили порядка **33 млрд тенге**.

Основные инвестиции в структуре портфеля выглядят так: «обратное РЕПО» (не более 90 календарных дней) – 25,32%, ГЦБ МФ РК – 15,62%, облигации квазигосударственных организаций Республики Казахстан – 13,09%, паи Exchange Traded Funds (ETF) – 12,07%, корпоративные облигации иностранных эмитентов – 9,77%.

В инструменты в национальной валюте инвестировано 67,98% портфеля, в долларах США - 32,00%, в евро - 0,02%.

В результате инвестиционной деятельности, размер начисленного инвестиционного дохода с начала 2024 года по состоянию на 1 июля составил 1 914,96 млн тенге. Доходность пенсионных активов - 6,50%.

Подробная структура инвестиционного портфеля финансовых инструментов под управлением АО «ДО Народного Банка Казахстана «Halyk Finance» с указанием эмитентов представлена на сайте ЕНПФ.

Напомним, что с 1 июля 2023 г. вкладчики могут передать в доверительное управление не более 50% пенсионных накоплений за счет обязательных пенсионных взносов (ОПВ) и обязательных профессиональных пенсионных взносов (ОППВ) без учета порога минимальной достаточности управляющим инвестиционным портфелем (УИП), выбрав такую компанию самостоятельно. Вкладчики, у которых есть добровольные пенсионные накопления, могут их передать их УИП в объеме 100%.

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)