

ИНФОРМАЦИОННОЕ СООБЩЕНИЕ

Каким образом вкладчики ЕНПФ получили инвестиционный доход свыше 1,3 триллиона тенге?

Инвестиционные портфели пенсионных активов под управлением НБРК и УИП по состоянию на 1 декабря 2021 года

Общий объем пенсионных активов, находящихся в управлении на 1 декабря 2021 года, составил 13,4 трлн тенге. Пенсионные активы ЕНПФ, **находящиеся в доверительном управлении НБРК**, составили 13 366,46 млрд тенге. **Пенсионные активы под управлением УИП** составили порядка 6,2 млрд тенге.

В результате инвестиционной деятельности размер начисленного инвестиционного дохода с начала 2021 года до 1 декабря составил **1,38 трлн тенге**.

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 декабря 2021 года размещены на сайте enpf.kz в разделе «Показатели – Инвестиционная деятельность».

Инвестиционный портфель пенсионных активов под управлением НБРК

На 1 декабря 2021 года в рамках направлений, одобренных Советом по управлению Национальным фондом РК на 2021 год, основные инвестиции НБРК (как доверительным управляющим) в финансовые инструменты представлены **следующим образом**:

- государственные ценные бумаги РК, выпущенные Министерством финансов РК, текущая стоимость которых составляет 5 094,12 млрд тенге (38,11% от всего портфеля). Средневзвешенная доходность к погашению по ГЦБ Министерства финансов РК, номинированным в тенге, составила 9,4% годовых, в долларах США – 3,4% годовых.

- государственные ценные бумаги иностранных государств составили 2 179,87 млрд тенге. Их доля в портфеле составила 16,31%. Средневзвешенная доходность к погашению ГЦБ иностранных государств в портфеле ПА ЕНПФ на отчетную дату составила 0,9% годовых.

- облигации квазигосударственных организаций РК (текущая стоимость 1 732,38 млрд тенге (доля в портфеле составила 12,96%). Средневзвешенная доходность к погашению по облигациям квазигосударственных организаций РК, номинированным в тенге, составила 10,7% годовых, в долларах США – 5,5% годовых.

- облигации банков второго уровня РК на сумму 1 035,84 млрд тенге (7,75%). На отчетную дату средневзвешенная доходность к погашению по облигациям БВУ РК 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 – 67,61%, в долларах США – 32,32%, в российских рублях и другой валюте – 0,06% портфеля пенсионных активов.

Структура начисленного с начала года инвестиционного дохода, полученного НБРК, выглядит следующим образом:

- доходы в виде вознаграждения по ценным бумагам, в том числе по размещенным вкладам и операциям «обратное РЕПО» 803,91 млрд тенге;
- доходы от рыночной переоценки ценных бумаг 156,37 млрд тенге;
- доходы от переоценки иностранной валюты 83,08 млрд тенге;
- доходы по активам, находящимся во внешнем управлении 161,05 млрд тенге;
- прочие доходы составили 176,10 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 2021 года составил 1 380,51 млрд тенге. Доходность пенсионных активов ЕНПФ, распределенная на счета вкладчиков (получателей) с начала 2021 года, составила 11,00% при инфляции 7,80%. Таким образом, реальная доходность по пенсионным активам ЕНПФ составила 3,20%.

При этом по состоянию на 1 декабря 2021 года доходность пенсионных активов за последние 12 календарных месяцев (с декабря 2020 года по декабрь 2021 года) для вкладчиков (получателей) ЕНПФ составила 11,77% при инфляции в размере 8,70%. Таким образом, за последние 12 месяцев реальная доходность по пенсионным активам ЕНПФ составила 3,07%.

[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 порядка 6,2 млрд тенге.

Пенсионные активы, находящиеся в доверительном управлении **АО «Jusan Invest»**, составили 2,76 млрд тенге. На них были приобретены: ноты НБРК (38,30% портфеля), паи Exchange Traded Funds (ETF) они составляют 21,24%, ГЦБ Министерства финансов РК (18,56%), остальные активы в денежных средствах на инвестиционных счетах - 21,90%. Отметим, что 57,05% портфеля представлено в тенге, 42,95% – в долларах США.

В результате инвестиционной деятельности, изменения рыночной стоимости финансовых инструментов и курсов иностранных валют, размер начисленного инвестиционного дохода (с начала деятельности 15.03.2021) по на 01.12.2021 г. составил 120,23 млн тенге. Доходность пенсионных активов составила 7,42%.

[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 декабря составили 1,67 млрд тенге. В структуре портфеля ноты НБРК составляют 19,33% портфеля, паи ETF (16,96%), облигации квазигосударственных организаций РК (15,12%), операции обратного РЕПО (13,16%), акции и депозитарные расписки иностранных эмитентов (11,17%), облигации БВУ (9,40%), корпоративные облигации организаций РК (7,46%), МФО (7,32%) и денежные средства на счетах (0,06%). Инвестиции в национальной валюте составили 71,85% портфеля, в долларах США - 28,15%.

В результате инвестиционной деятельности, изменения рыночной стоимости финансовых инструментов и курсов иностранных валют, размер начисленного инвестиционного дохода (с начала деятельности 15.03.2021) по состоянию на 01.12.2021 г. составил 86,15 млн. тенге. Доходность пенсионных активов составила 6,87%.

[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 декабря составили 1,04 млрд тенге. Они распределены в паи (ETF на индексы) (29,64%), облигации квазигосударственных организаций РК (19,00%), акции и депозитарные расписки иностранных эмитентов (11,45%), облигации БВУ РК (11,18%), операции обратного РЕПО (9,87%), облигации МФО (9,41%), корпоративные облигации эмитентов-резидентов РК (8,00%), денежные средства на

инвестиционных счетах (4,57%). В инструменты в национальной валюте инвестировано 57,68% портфеля, в долларах США – 42,32%.

В результате инвестиционной деятельности, изменения рыночной стоимости финансовых инструментов и курсов иностранных валют, размер начисленного инвестиционного дохода (с начала деятельности 15.03.2021) по состоянию на 01.12.2021 г. составил 48,53 млн. тенге. Доходность пенсионных активов составила 5,96%.

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

По состоянию на 1 декабря 2021 года пенсионные активы ЕНПФ, находящиеся в доверительном управлении АО «Сентрас Секьюритиз», составили 668,75 млн. тенге. Они инвестированы в ГЦБ МФ РК (83,24%), акции и депозитарные расписки эмитентов РК (14,59%), РЕПО (1,79%), денежные средства на инвестиционных счетах (0,23%). Все инвестиции произведены в национальной валюте.

В результате инвестиционной деятельности и изменения рыночной стоимости финансовых инструментов размер начисленного инвестиционного дохода (с начала деятельности 01.04.2021) по состоянию на 01.12.2021 г. составил 40,83 млн. тенге. Доходность пенсионных активов составила 8,53%.

[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).