

ИНФОРМАЦИОННОЕ СООБЩЕНИЕ

Инвестиционные портфели пенсионных активов под управлением НБРК и УИП по состоянию на 1 сентября 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 сентября 2024 года составил **20 904,73 млрд тенге**. По состоянию на эту дату пенсионные активы 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 **20 698,49 млрд тенге**¹. Объем пенсионных активов, сформированных за счет обязательных пенсионных взносов работодателя (далее - ОПВР), **находящихся в доверительном управлении НБРК, - 148,44 млрд тенге**.

Пенсионные активы под управлением УИП составили более **57,8 млрд тенге**.

Инвестиционный портфель пенсионных активов под управлением НБРК

Основные направления инвестирования пенсионных активов, сформированных за счет ОПВ, ОППВ, ДПВ, на 1 сентября 2024 года выглядят следующим образом: государственные ценные бумаги Министерства финансов РК – 42,93%, облигации квазигосударственных компаний – 9,36%, государственные ценные бумаги иностранных государств – 4,93%, облигации банков второго уровня Республики Казахстан – 4,32%, операции РЕПО – 2,19%, акции и депозитарные расписки эмитентов РК – 1,87%, МФО – 1,67%.

Инвестиционный портфель в разрезе валют, в которые номинированы финансовые инструменты, приобретенные за счет ОПВ, ОППВ, ДПВ, по состоянию на 1 сентября 2024 г. выглядит так: инвестиции в национальной валюте – 61,97%, в долларах США – 38,02% 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 1 036,01 млрд тенге, по активам, находящимся во внешнем управлении – 543,44 млрд тенге, от переоценки иностранной валюты - 232,17 млрд тенге, от рыночной переоценки ценных бумаг - 132,87 млрд тенге. Прочие доходы составили 1,57 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 2024 года по состоянию на 1 сентября составил 1,95 трлн тенге. Доходность пенсионных активов ЕНПФ, распределенная на счета вкладчиков (получателей), за 8 месяцев 2024 года составила 10,34%.

Направления инвестирования ОПВР на 1 сентября 2024 года выглядят следующим образом: государственные ценные бумаги Министерства финансов РК – 96,66%, депозиты НБРК – 2,83%, денежные средства на инвестиционных счетах – 0,51%,

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

¹ без учета денег на счетах пенсионных взносов и выплат

Размер начисленного инвестиционного дохода по ОПВР с начала 2024 г. по состоянию на 1 сентября составил 8,63 млрд тенге. Доходность ОПВР - 8,52%.

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 **57,8 млрд тенге**.

По состоянию на 01.09.2024 г. пенсионные активы, находящиеся в доверительном управлении АО «*Jusan Invest*», составили более **9,6 млрд тенге**.

Основные инвестиции компании: ГЦБ МФ РК – 31,69%, паи Exchange Traded Funds (ETF) – 23,82%, Репо – 12,48%, корпоративные облигации иностранных эмитентов – 8,63%, ГЦБ иностранных государств – 6,68%, облигации банков второго уровня РК – 6,66% портфеля. Отметим, что 67,62% портфеля представлено в тенге, 32,38% - в долларах США.

В результате инвестиционной деятельности размер начисленного инвестиционного дохода за 8 месяцев 2024 г. составил 998,97 млн тенге. Доходность пенсионных активов - 11,74%.

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

По состоянию на 01.09.2024 г. пенсионные активы, находящиеся в доверительном управлении АО «*Halyk Global Markets*», составили более **4,3 млрд тенге**.

Основные инвестиции в структуре портфеля таковы: государственные ценные бумаги Министерства финансов РК – 17,11%, корпоративные облигации иностранных эмитентов – 16,8%, «обратное РЕПО» (не более 90 календарных дней) – 13,96%, облигации квазигосударственных организаций РК – 13,61%, облигации банков второго уровня РК – 11,9%, корпоративные облигации организаций РК – 7,76%, долевые инструменты иностранных эмитентов (Паи ETF) – 7,67%, облигации МФО – 6,29%.

Инвестиции в национальной валюте составили 75,11% портфеля, в долларах США - 24,88%.

В результате инвестиционной деятельности размер начисленного инвестиционного дохода по состоянию на 1 сентября 2024 года с начала 2024 года составил 393,52 млн тенге. Доходность пенсионных активов - 9,63%.

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

По состоянию на 01.09.2024 г. пенсионные активы ЕНПФ, находящиеся в доверительном управлении АО «*BCC Invest*», составили более **5 млрд тенге**.

Основные направления инвестиций: облигации квазигосударственных организаций Республики Казахстан – 30,34%, РЕПО – 15,55%, облигации БВУ РК – 12,26%, ГЦБ МФ РК – 11,36%, корпоративные облигации эмитентов-резидентов РК – 9,16%, корпоративные облигации иностранных эмитентов – 6,42%, паи (ETF на индексы) – 6,38%.

Инвестиции в национальной валюте составили 85,13% портфеля, в долларах США - 14,87%.

В результате инвестиционной деятельности размер начисленного инвестиционного дохода за 8 месяцев 2024 г. составил 430,81 млн тенге. Доходность пенсионных активов - 9,34%.

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

По состоянию на 01.09.2024 г. пенсионные активы ЕНПФ, находящиеся в доверительном управлении АО «**Сентрас Секьюритиз**», составили порядка **1,5 млрд тенге**.

В ГЦБ МФ РК инвестировано 24,16%, РЕПО – 20,86%, облигации квазигосударственных организаций – 13,46%, в акции и депозитарные расписки эмитентов РК – 10,12%, облигации БВУ РК – 7,76%, государственные облигации США – 7,50%, корпоративные облигации эмитентов РК – 7,39%.

Инвестиции в национальной валюте составили 73,34% портфеля, в долларах США - 25,07%, в канадских долларах - 1,59%.

В результате инвестиционной деятельности и изменения рыночной стоимости финансовых инструментов размер начисленного инвестиционного дохода по состоянию на 1 сентября с начала 2024 года составил 145,28 млн тенге. Доходность пенсионных активов - 11,49%.

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

По состоянию на 1 сентября 2024 года пенсионные активы, находящиеся в доверительном управлении АО «**ДО Народного Банка Казахстана «Halyk Finance»**», составили порядка **37,4 млрд тенге**.

Основные инвестиции в структуре портфеля выглядят так: ГЦБ МФ РК – 21,91%, «обратное РЕПО» (не более 90 календарных дней) – 17,07%, облигации квазигосударственных организаций Республики Казахстан – 11,63%, паи Exchange Traded Funds (ETF) – 12,71%, корпоративные облигации иностранных эмитентов – 8,87%, корпоративные облигации эмитентов РК – 8,50%, облигации банков второго уровня РК – 8,11%, ГЦБ иностранных государств – 5,98%.

В инструменты в национальной валюте инвестировано 70,05% портфеля, в долларах США - 29,95%.

В результате инвестиционной деятельности размер начисленного инвестиционного дохода по состоянию на 1 сентября с начала 2024 года составил 3 160,07 млн тенге. Доходность пенсионных активов - 10,14%.

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. В соответствии с пенсионным законодательством ЕНПФ осуществляет привлечение обязательных пенсионных взносов, обязательных пенсионных взносов работодателя, обязательных профессиональных пенсионных взносов, добровольных пенсионных взносов, а также зачисление и учет добровольных пенсионных взносов, сформированных за счет невостребованной суммы гарантийного возмещения по гарантируемому депозиту, перечисленной организацией, осуществляющей обязательное гарантирование депозитов, в соответствии с Законом Республики Казахстан "Об обязательном гарантировании депозитов, размещенных в банках второго уровня Республики Казахстан", обеспечивает осуществление пенсионных выплат. Также Фонд осуществляет

учет целевых активов и целевых требований, учет и зачисление целевых накоплений (ЦН) на целевые накопительные счета, выплат ЦН их получателю на банковские счета, учет возвратов ЦН в порядке, определенном Правительством Республики Казахстан в рамках программы «Национальный фонд – детям». (Подробнее на www.enpf.kz).