

ИНФОРМАЦИОННОЕ СООБЩЕНИЕ

На заседании Общественного совета АО «ЕНПФ» УИП предоставили отчеты и презентовали свои стратегии

Состоялось очередное 27-е заседание Общественного совета при АО «ЕНПФ», участие в котором приняли представители управляющих инвестиционным портфелем (УИП) - АО «ВСС Invest», АО «Halyk Global Markets», АО «Jusan Invest», АО «Сентрас Секьюритиз», АО «Halyk Finance». В рамках утвержденной повестки каждый из них презентовал свою инвестиционную стратегию, предоставил отчеты и ответил на вопросы участников встречи.

В своем выступлении представитель АО «ВСС Invest» отметил, что в своей деятельности компания придерживается консервативного подхода. В частности, 91,49% активов вложены в инструменты фиксированной доходности, оставшиеся 8,51% находятся в долевыми инструментах (акции, паи). Валютное распределение портфеля разделено следующим образом: 83,13% в национальной валюте, 16,87% в долларах США. Доходность пенсионных активов по итогам 2023г. составила 13,05%. Представитель компании отметил следующие вопросы, по которым совместная ведется работа АФК, УИП, АФРР и ЕНПФ: разработка и утверждение бэнчмарка для управляющих компаний; применение принципов рыночной оценки активов; оперативное реагирование на рыночные условия; формирование разных портфелей по риск-профилю; корректировка нормативной документации к требованиям рынка

АО «Halyk Global Markets» и «АО «Halyk Finance» в 2023 году продолжили инвестиции в корпоративные облигации казахстанских эмитентов и увеличивали свои валютные позиции. В частности, 69,1% портфеля «АО «Halyk Finance» находятся в национальной валюте, 30,80% в долларах США и 0,2% в Евро. Касаемо портфеля АО «Halyk Global Markets», то 69,4% распределено в национальную валюту, оставшиеся активы в доллары США. В результате доходность «Halyk Finance» за 2023 год составила 17,2%, АО «Halyk Global Markets» - 15,55%. В планах инвестиционной компании поддержание в портфеле доли долговых инструментов, а также увеличение долевыми инструментами (до 30%) и наращивание валютной позиции (до 50%) с целью повышения доходности и нивелирования рисков.

Согласно докладу представителя АО «Jusan Invest» структура портфеля по валюте выглядит следующим образом: 60% - в национальной валюте, 40% - в долларах США. В портфеле акций значатся ГЦБ в тенге – 30,88%, казначейские облигации США – 6,68%, локальные акции – 15,42%. Доходность по итогам 2023 года была на уровне 13,48%. Основной подход этого УИП заключается в использовании стратегии «Паритета Риска». Данная стратегия фокусируется на распределении риска, а не самого капитала (риском считается волатильность рынка). Основная идея стратегии в том, что активы распределены таким образом, что при падении одного вида активов, другой вид активов компенсирует это падение, тем самым оказывая положительное влияние на общую динамику портфеля.

Доходность пенсионных активов АО «Сентрас Секьюритиз» за 2023 г. составила 10,67%. По приведенным данным активы инвестиционного портфеля компании распределены следующим образом: ГЦБ РК – 26,70%, РЕПО – 19,86%, облигации квазигосударственных организаций РК – 14,38%. Относительно структуры портфеля в разрезе валют, то отмечено, что 66% находятся в национальной валюте, 32% - в долларах США и 2% - в канадских долларах.

Отвечая на вопросы членов Общественного совета, представители УИП отметили, что стратегия инвестирования пенсионных активов направлена на их рост и доходность и важная роль в деятельности УИП отводится прозрачности и надежности.

Более подробно с материалами, представленными на заседании Общественного Совета при АО «ЕНПФ», можно ознакомиться на сайте enpf.kz в разделе «Общественный Совет» - Протоколы заседаний и [презентации](#).

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 не востребованной 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).