

## ИНФОРМАЦИОННОЕ СООБЩЕНИЕ

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

Подробная информация об инвестировании пенсионных активов Национальным Банком Республики Казахстан (НБРК), управляющими инвестиционным портфелем (УИП), а также обзоры инвестиционной деятельности по состоянию на 1 июля 2021 года размещены на сайте [enpf.kz](http://enpf.kz) в разделе «Показатели – Инвестиционная деятельность».

Отметим, что общий объем пенсионных активов, находящихся в управлении на 1 июля 2021 года, составил 12,8 трлн тенге. При этом пенсионные активы ЕНПФ, находящиеся в доверительном управлении НБРК, составили 12 769,15 млрд тенге. Пенсионные активы под управлением УИП составили порядка 4,3 млрд тенге.

В результате инвестиционной деятельности общий размер начисленного инвестиционного дохода за период с 01.01.2021г. по 30.06.2021г. составил 774,23 млрд. тенге в том числе:

#### Инвестиционный портфель пенсионных активов под управлением НБРК

На 1 июля 2021 года в рамках направлений, одобренных Советом по управлению Национальным фондом РК на 2021 год, НБРК (как доверительным управляющим) основные направления инвестирования представлены следующим образом:

- государственные ценные бумаги РК, выпущенные Министерством финансов РК, текущая стоимость которых составляет 5 012,67 млрд. тенге (39,26% от всего портфеля). Средневзвешенная доходность к погашению по ГЦБ Министерства финансов РК, номинированным в тенге, составила 8,9% годовых, в долларах США – 4,3 % годовых.

- облигации квазигосударственных организаций РК (текущая стоимость 1 750,89 млрд тенге (13,71%). Средневзвешенная доходность к погашению по облигациям квазигосударственных организаций РК, номинированным в тенге, составила 10,8% годовых, в долларах США – 5,5 % годовых.

- государственные ценные бумаги иностранных государств составили 1 224,52 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 9,59%. Средневзвешенная доходность к погашению ГЦБ иностранных государств в портфеле ПА ЕНПФ на отчетную дату составила 0,2% годовых.

- облигации банков второго уровня РК на сумму 1 073,05 млрд тенге (8,40%). На отчетную дату средневзвешенная доходность к погашению по облигациям БВУ РК составила 10,0% годовых.

- активы, находящиеся во внешнем управлении в размере 1 211,80 млрд тенге (9,49% от портфеля). Прирост по сравнению с 1 января 2021 года составил 48,41%.

Инвестиционный портфель финансовых инструментов в разрезе валют, в которые номинированы финансовые инструменты, приобретенные за счет пенсионных активов ЕНПФ, представлен следующим образом:

инвестиции в национальной валюте – 67,91%, в долларах США – 32,02%, в российских рублях и другой валюте – 0,07% 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» 436,43 млрд тенге;
- доходы от рыночной переоценки ценных бумаг 83,77 млрд тенге;
- доходы от переоценки иностранной валюты 44,36 млрд тенге;
- доходы по активам, находящимся во внешнем управлении 98,63 млрд тенге;

- прочие доходы составили 110,95 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 774,14 млрд. тенге. Доходность пенсионных активов ЕНПФ, распределенная на счета вкладчиков (получателей) с начала 2021 года, составила 6,10%.

[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 4,3 млрд тенге.

Пенсионные активы, находящиеся в доверительном управлении **АО «Jusan Invest»**, составили 1,9 млрд тенге. На них были приобретены: паи Exchange Traded Funds (ETF) они составляют 42,59%, ноты НБРК (36,64% портфеля), ГЦБ Министерства финансов РК (17,16%), операции обратного РЕПО составляют 3,48%, остальные активы в денежных средствах на инвестиционных счетах - 0,14%. 57,32% портфеля представлено в тенге, 42,68% – в долларах США.

В результате инвестиционной деятельности, а также вследствие волатильности курсов иностранных валют и изменения рыночной стоимости финансовых инструментов, размер начисленного инвестиционного дохода на 01.07.2021 г. составил 41,42 млн тенге. Доходность пенсионных активов составила 4,30%

[Подробная структура](#) портфеля 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 июля составили 1,1 млрд тенге. В структуре портфеля операции обратного РЕПО составляют 66,28%, ноты НБРК (15,66% портфеля), долевые инструменты иностранных эмитентов (13,40%), облигации БВУ (4,58%) и денежные средства на счетах (0,07%). Инвестиции в национальной валюте составили 86,59% портфеля, в долларах США - 13,41%.

В результате инвестиционной деятельности, размер начисленного инвестиционного дохода (по состоянию на 1 июля 2021 года с начала деятельности) составил 20,36 млн. тенге. Доходность пенсионных активов составила 2,32%.

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

По состоянию на 1 июля 2021 года пенсионные активы, находящиеся в доверительном управлении **АО «BCC Invest»**, составили 818,0 млн тенге. Они распределены в операции обратного РЕПО (34,40%), паи (ETF на индексы) (26,45%), облигации квазигосударственных организаций РК (14,18%), акции и депозитарные расписки иностранных эмитентов (9,02%), облигации МФО (7,96%), облигации БВУ РК (6,94%), денежные средства на инвестиционных счетах (1,05%). В инструменты в национальной валюте инвестировано 63,98% портфеля, в долларах США - 36,02%.

Размер начисленного инвестиционного дохода за период с 15.03.2021 года по 30.06.2021 составил 18,13 млн. тенге. Доходность пенсионных активов составила 2,96%.

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

По состоянию на 1 июля 2021 года пенсионные активы ЕНПФ, находящиеся в доверительном управлении **АО «Сентрас Секьюритиз»**, составили 447,2 млн. тенге. Они инвестированы в ГЦБ  
Пресс-центр АО «ЕНПФ»

МФ РК (94,07%), акции и депозитарные расписки эмитентов РК (5,92%), денежные средства на инвестиционных счетах (0,01%). Все инвестиции произведены в национальной валюте.

Размер начисленного инвестиционного дохода за период с 01.04.2021 года по 30.06.2021 года составил 10,64 млн. тенге. В результате инвестиционной деятельности и изменения рыночной стоимости финансовых инструментов, доходность пенсионных активов составила 2,76%.

[Подробная структура](#) портфеля 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](http://www.enpf.kz)).*