

# Пенсионные накопления в доверительном управлении у управляющего инвестиционным портфелем (УИП)

Как и куда были инвестированы пенсионные активы под управлением УИП по состоянию на 1 октября 2022 года





## ЦЕЛИ ИНВЕСТИРОВАНИЯ ПА ЕНПФ:

- обеспечение сохранности пенсионных накоплений вкладчиков и получение инвестиционного дохода



## СОЦИАЛЬНАЯ ОТВЕТСТВЕННОСТЬ:

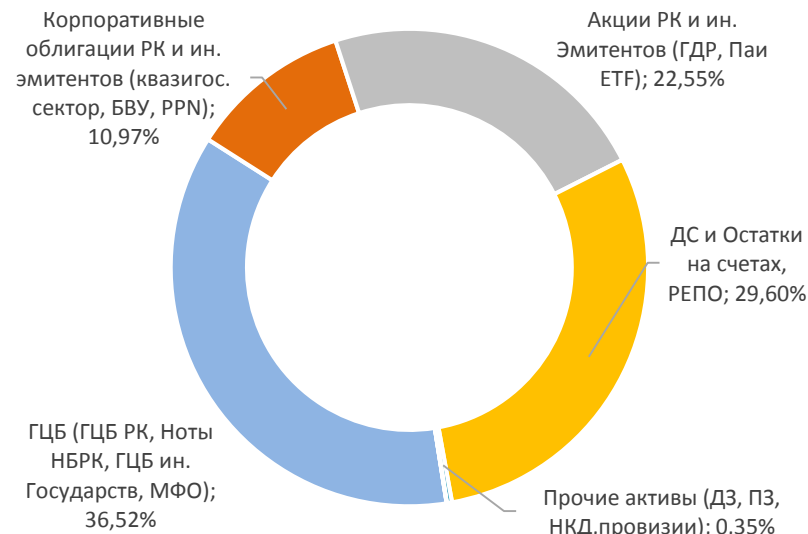
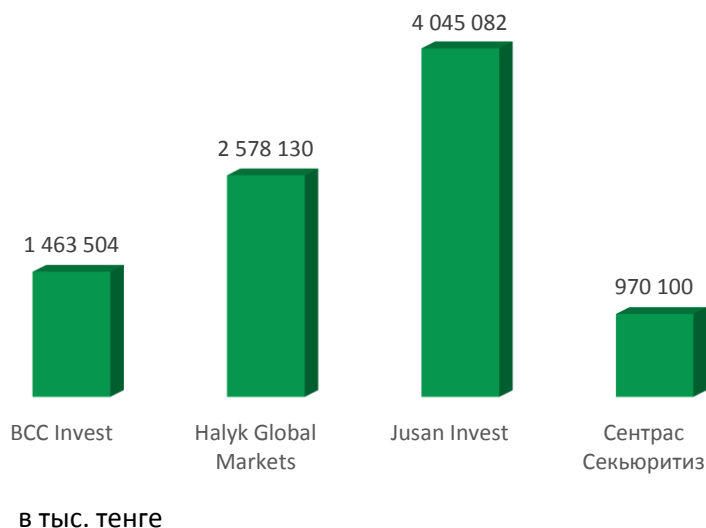
- инвестирование ПА ЕНПФ осуществляется в интересах вкладчиков



## ЗАЩИТА ОТ РИСКА (ДИВЕРСИФИКАЦИЯ):

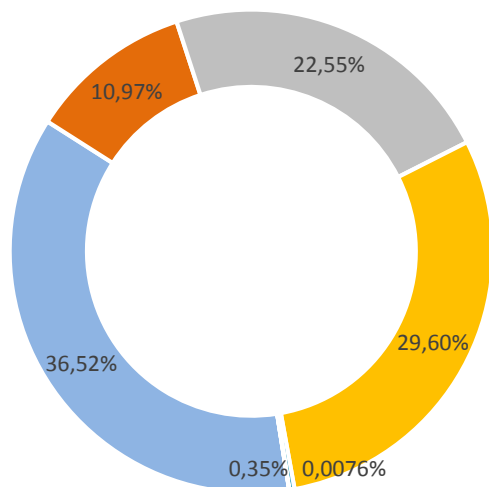
- получение реальной доходности в долгосрочной перспективе, за счет оптимального сочетания различных видов финансовых инструментов (путем обеспечения соотношения риск – доходность)

# Объемы инвестиции в УИП и Структура инвестиционного портфеля пенсионных активов, %

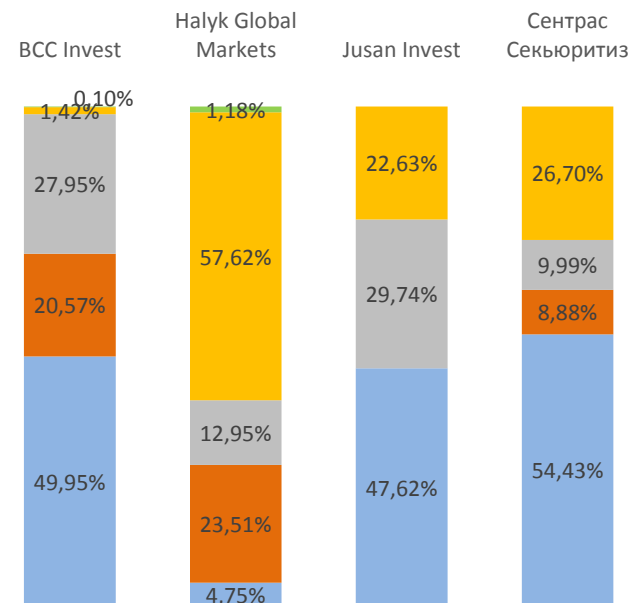


- ✓ По состоянию на 1 октября 2022 года пенсионные активы ЕНПФ находящиеся в доверительном управлении УИП составили **9,05** млрд тенге;
- ✓ В основном большая часть инвестиций по видам финансовых инструментов распределена по ГЦБ Министерства Финансов Республики Казахстан и долевым ценным бумагам эмитентов (Акции, ГДР и Паи (ETF)).

# Структура портфелей пенсионных активов по видам ФИ в разрезе УИП, %

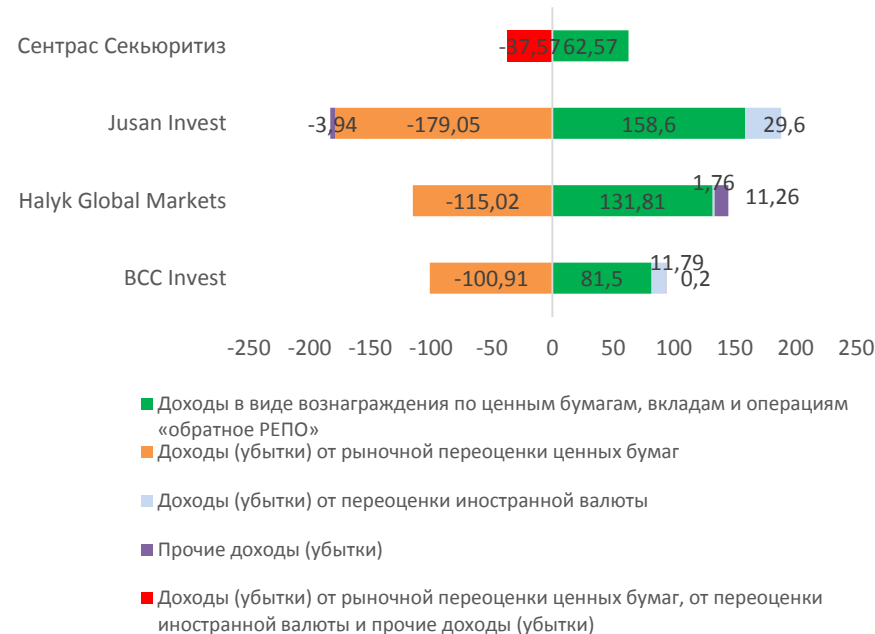
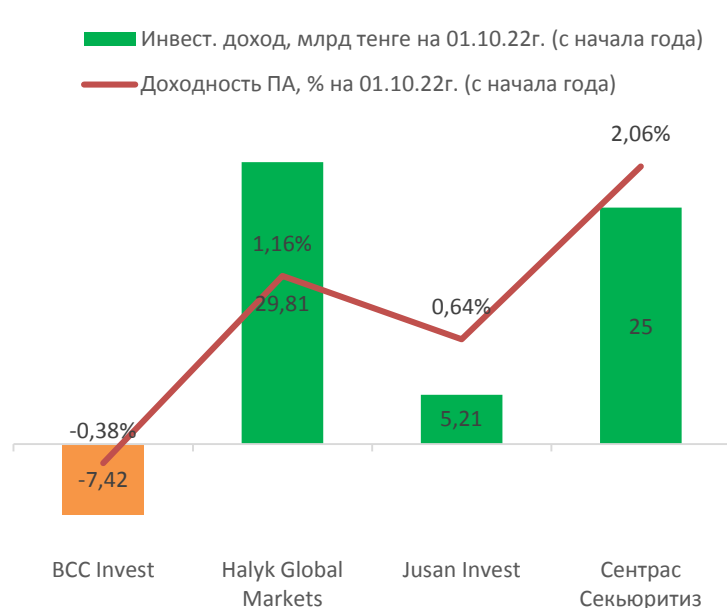


- Прочие активы (ДЗ, ПЗ, НКД, провизии)
- ДС и Остатки на счетах, РЕПО
- Акции РК и ин. Эмитентов (ГДР, Паи ETF)
- Корпоративные облигации РК и ин. эмитентов (квазигос. сектор, БВУ, РРН)
- ГЦБ (ГЦБ РК, Ноты НБРК, ГЦБ ин. Государств, МФО)



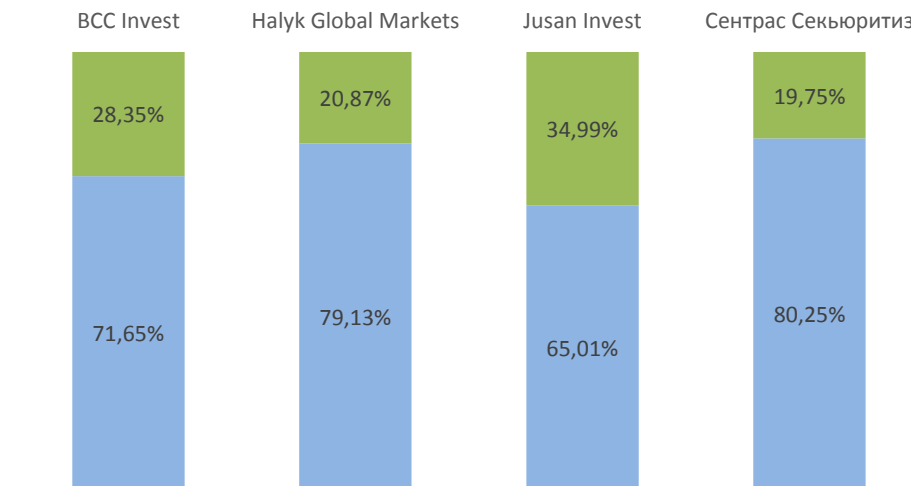
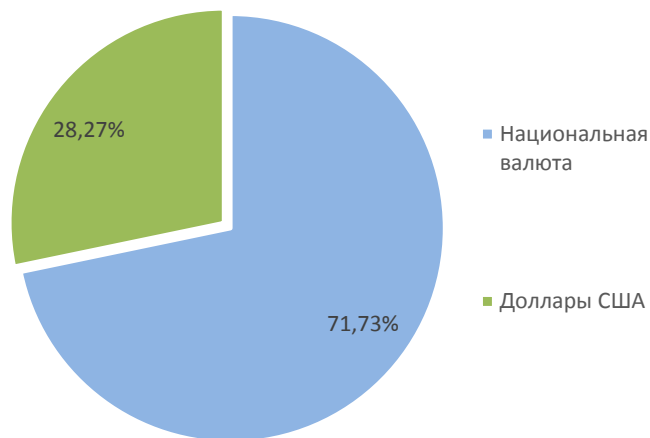
- ✓ По состоянию на 1 октября 2022 года пенсионные активы ЕНПФ находящиеся в доверительном управлении УИП составили **9,05** млрд тенге;
- ✓ В основном большая часть инвестиций по видам финансовых инструментов распределена по ГЦБ Министерства Финансов Республики Казахстан и долевым ценным бумагам эмитентов (Акции, ГДР и Паи (ETF)).

# Структура доходов инвестиционных портфелей пенсионных активов УИП, %



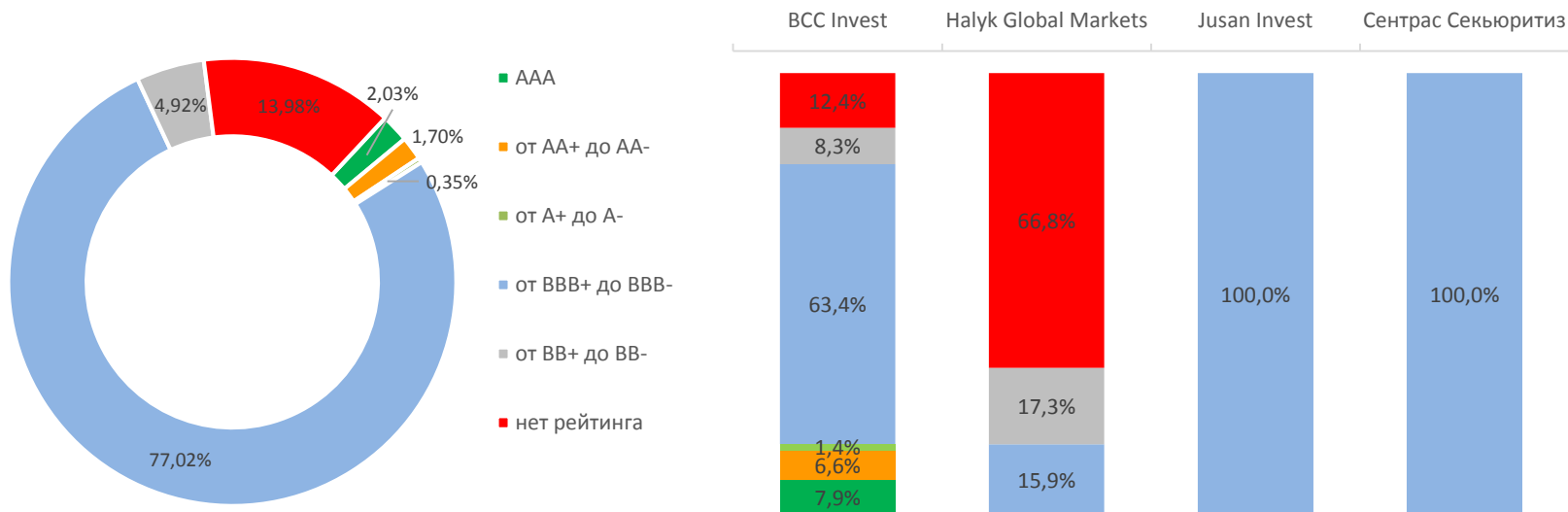
- ✓ По состоянию на 1 октября 2022 года размер начисленного инвестиционного дохода с начала года по пенсионным активам ЕНПФ в доверительном управлении УИП составил **52,6** млн тенге;
- ✓ В структуре доходов убытки начислены в основном по рыночной переоценке ценных бумаг и переоценки иностранной валюты.

# Структура портфелей пенсионных активов по валютам в разрезе УИП, %



По состоянию на 1 октября 2022 года ПА под управлением УИП инвестированы в тенге (71,73%) и доллары США (28,27%);

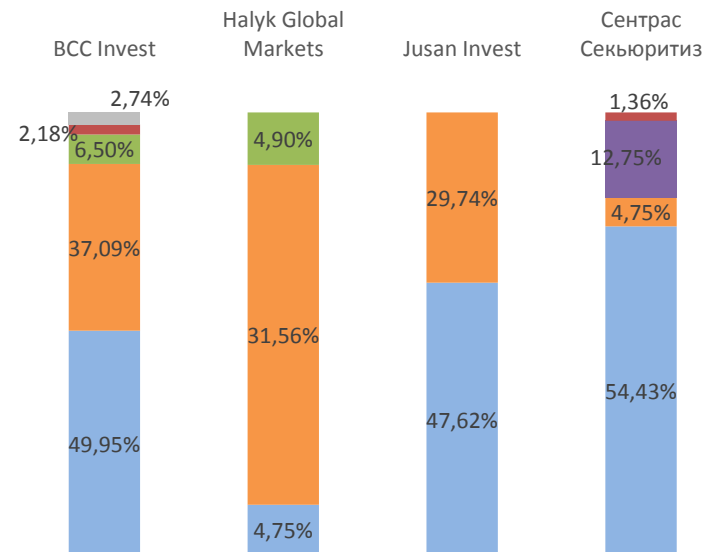
# Структура портфелей пенсионных активов по кредитному качеству в разрезе УИП, %



- ✓ Финансовые инструменты с минимальным уровнем риска, с рейтингом ценных бумаг/эмитента по международной шкале от «AAA» до «BBV-» составляют 81,1% инвестиционного портфеля\*;
- ✓ Финансовые инструменты с рейтингом по международной шкале от «BV+» до «B-» составляют 4,92%;
- ✓ Финансовые инструменты без рейтинговых оценок составляют 13,98%. АО «Казахстанский фонд устойчивости», Дочерний банк АО "Хоум Кредит энд Финанс Банк", АО "Жилищный строительный сберегательный банк "Отбасы банк" не имеют рейтинговых оценок эмитента по международной шкале. Агентством Fitch отозван рейтинг Евразийского банка развития.

\* - Активы, находящиеся в инвестиционном портфеле, за исключением остатков на счетах, денег в пути и пр.

# Структура портфелей пенсионных активов по секторам экономики в разрезе УИП, %

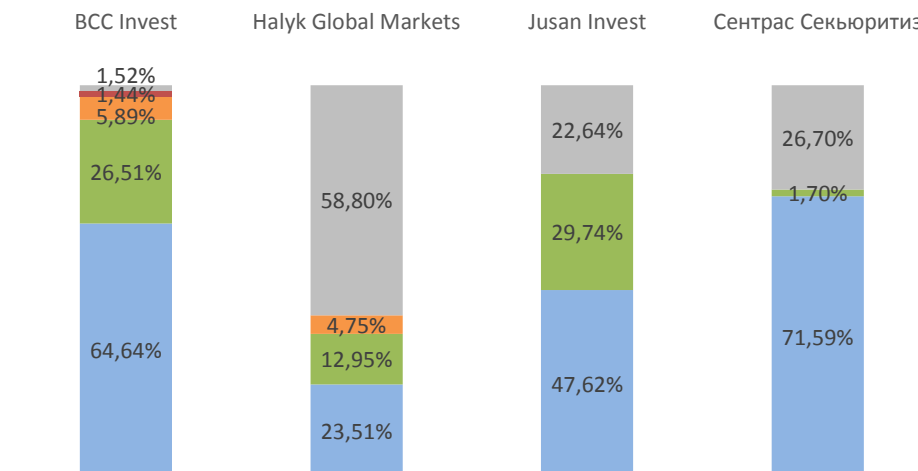
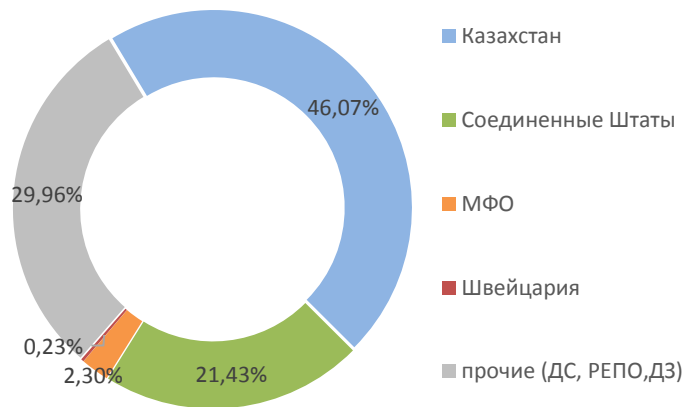


По состоянию на 1 октября 2022 года Суверенные обязательства, МФО (36,52%), и финансовый сектор (28,77%) занимают большую часть пенсионных накоплений под управлением УИП.

\* -дебиторская задолженность, остатки денежных средств на счетах и производные финансовые инструменты.

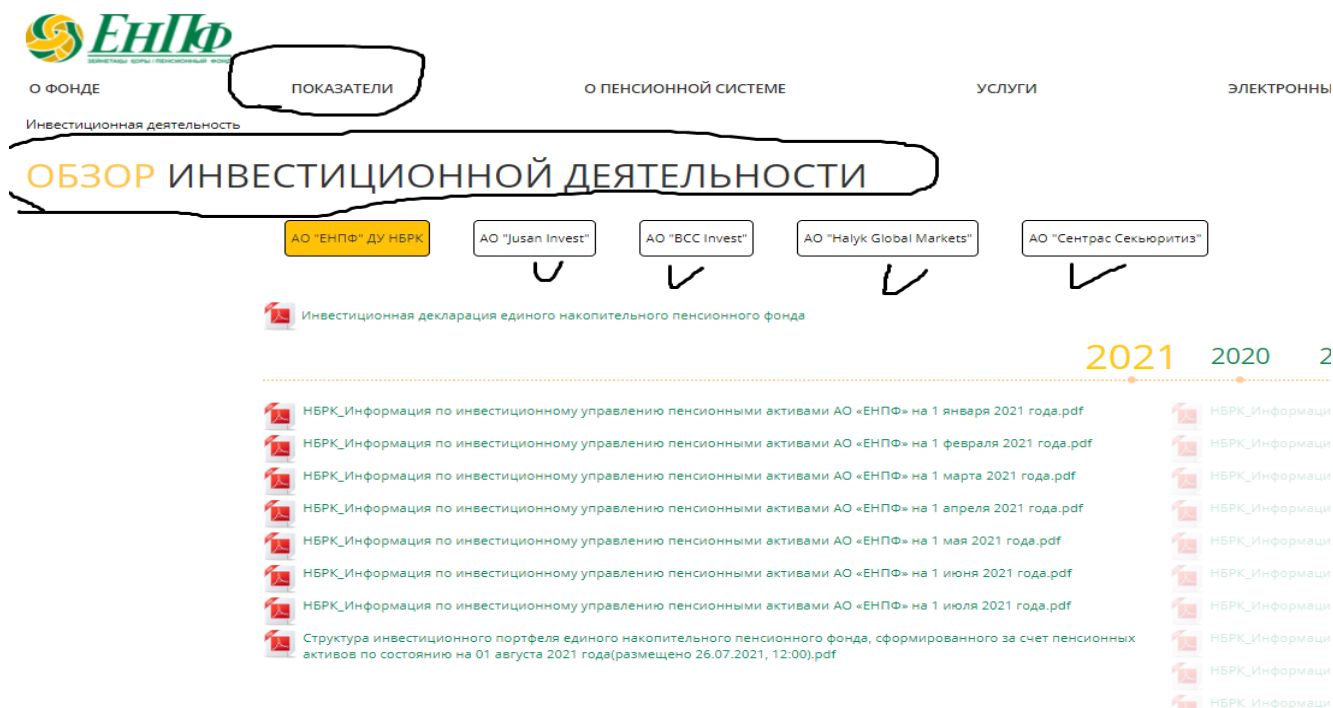


# Структура портфеля пенсионных активов по странам в разрезе УИП, %



По состоянию на 1 октября 2022 года порядка 21,5% пенсионных накоплений в доверительном управлении УИП, инвестированы в ценные бумаги государства США

# Подробная структура инвестиционного портфеля финансовых инструментов каждого УИП с указанием эмитентов и номинальной доходности и обзор инвестиционной деятельности размещены на официальном сайте ЕНПФ



ЕНПФ

О ФОНДЕ    **ПОКАЗАТЕЛИ**    О ПЕНСИОННОЙ СИСТЕМЕ    УСЛУГИ    ЭЛЕКТРОННЫ

Инвестиционная деятельность

## ОБЗОР ИНВЕСТИЦИОННОЙ ДЕЯТЕЛЬНОСТИ

АО "ЕНПФ" ДУ НБРК    АО "Jusan Invest"    АО "BCC Invest"    АО "Halyk Global Markets"    АО "Сентрас Секьюритиз"

Инвестиционная декларация единого накопительного пенсионного фонда

2021    2020    2

- НБРК\_Информация по инвестиционному управлению пенсионными активами АО «ЕНПФ» на 1 января 2021 года.pdf
- НБРК\_Информация по инвестиционному управлению пенсионными активами АО «ЕНПФ» на 1 февраля 2021 года.pdf
- НБРК\_Информация по инвестиционному управлению пенсионными активами АО «ЕНПФ» на 1 марта 2021 года.pdf
- НБРК\_Информация по инвестиционному управлению пенсионными активами АО «ЕНПФ» на 1 апреля 2021 года.pdf
- НБРК\_Информация по инвестиционному управлению пенсионными активами АО «ЕНПФ» на 1 мая 2021 года.pdf
- НБРК\_Информация по инвестиционному управлению пенсионными активами АО «ЕНПФ» на 1 июня 2021 года.pdf
- НБРК\_Информация по инвестиционному управлению пенсионными активами АО «ЕНПФ» на 1 июля 2021 года.pdf
- Структура инвестиционного портфеля единого накопительного пенсионного фонда, сформированного за счет пенсионных активов по состоянию на 01 августа 2021 года(размещено 26.07.2021, 12:00).pdf

**СПАСИБО ЗА  
ВНИМАНИЕ!**

Готовы ответить  
на ваши вопросы

