

Информация по инвестиционному управлению пенсионными активами АО «ЕНПФ», сформированные за счет обязательных пенсионных взносов работодателя

По состоянию на 1 марта 2024 года пенсионные активы, сформированные за счет обязательных пенсионных взносов работодателя (далее – ПА ОПВР), находящиеся в доверительном управлении НБРК, на отчетную дату составили 18,50 млрд. тенге. Средневзвешенная доходность к погашению (УТМ) долговых финансовых инструментов, находящихся в инвестиционном портфеле ПА ОПВР, составила 12,19% годовых.

Структура инвестиционного портфеля финансовых инструментов ПА ОПВР представлена в Таблице 1.

Таблица 1. Структура инвестиционного портфеля ПА ОПВР, находящихся в доверительном управлении НБРК, в разрезе финансовых инструментов

Наименование	<i>млрд. тенге</i>				
	Текущая стоимость на 01.01.2024г.	Доля на 01.01.2024г.	Текущая стоимость на 01.03.2024г.	Доля на 01.03.2024г.	Прирост/снижение с начала года
ГЦБ МФ РК	-	-	13,37	72,26%	100%
Денежные средства на инвестиционных счетах	-	-	1,69	9,16%	100%
операции РЕПО	-	-	3,43	18,58%	100%
Итого ПА ОПВР, находящиеся в управлении НБРК	-	-	18,50	100,00%	
<i>Деньги на счетах пенсионных взносов</i>			0,73		
Итого ПА ОПВР	-	-	19,23		100%

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

Государственные ценные бумаги Министерства финансов Республики Казахстан

Основную долю в портфеле ПА ОПВР занимают ГЦБ Министерства финансов РК, текущая стоимость которых составила 13,37 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 72,26%.

В рассматриваемом периоде были приобретены ГЦБ Министерства финансов РК на сумму 13,37 млрд. тенге (15,25 млрд. тенге по номинальной стоимости) со средневзвешенной доходностью 12,15% годовых.

На отчетную дату средневзвешенная доходность к погашению по ГЦБ Министерства финансов РК составила 12,19% годовых.

Результаты инвестиционной деятельности

Размер начисленного инвестиционного дохода по ПА ОПВР с начала 2024 года составил 14,58 млн. тенге.

По состоянию на 1 марта 2024 доходность ПА ОПВР за период с начала 2024 года составила 0,11%.

Информация о соблюдении параметров инвестиционной декларации

Структурное распределение ПА ОПВР, находящихся в доверительном управлении НБРК, соответствует требованиям Инвестиционной декларации ЕНПФ¹. Сведения о соблюдении лимитов инвестирования по ПА ОПВР по состоянию на 1 марта 2024 года представлены в Таблице 4.

¹ Инвестиционная декларация ЕНПФ утверждена постановлением Правления Национального Банка Республики Казахстан от 23 октября 2023 года №82

Таблица 4. Лимиты инвестирования по ПА ОПВР

№	Вид финансового инструмента	Фактическое значение (в процентах от общего объема ПА ОПВР)	Выполнение (да/нет)
1	Казахстанские финансовые инструменты:	0%	да
1.1	Государственные ценные бумаги Республики Казахстан, выпущенные Министерством финансов Республики Казахстан, Национальным Банком Республики Казахстан	72,26%	да
1.2	Депозиты Национального Банка Республики Казахстан	0%	да
1.3	Долговые ценные бумаги субъектов квазигосударственного сектора	0%	да
2	Зарубежные финансовые инструменты, в том числе инструменты, обращающиеся на зарубежных финансовых рынках:	0%	да
2.1	Долговые ценные бумаги международных финансовых организаций, имеющие рейтинговую оценку ценной бумаги и/или эмитента не ниже «ВВВ-» по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинговой оценкой аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств	0%	да
2.2	Корпоративные долговые ценные бумаги, имеющие рейтинговую оценку ценной бумаги и (или) эмитента не ниже «ВВВ-» по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинговой оценкой аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств	0%	да

Информация по покупкам, продажам и погашениям финансовых инструментов, находящихся в инвестиционном портфеле ПА ОПВР

Таблица 5. Сведения по приобретению финансовых инструментов в отчетном месяце

Вид инструмента	Валюта	Эмитент ценной бумаги	Номинальная стоимость в тенге
ГЦБ РК	KZT	Правительство РК	15 250 000 000
Итого			15 250 000 000