

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

По состоянию на 1 октября 2024 года пенсионные активы, сформированные за счет обязательных пенсионных взносов работодателя (далее – ПА ОПВР), находящиеся в доверительном управлении НБРК, составили 169,20 млрд. тенге<sup>1</sup>.

Средневзвешенная доходность к погашению (УТМ) долговых финансовых инструментов, находящихся в инвестиционном портфеле ПА ОПВР, составила 12,50% 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	Текущая стоимость на 01.01.2024г.	Текущая стоимость на 01.10.2024г.	Доля на 01.10.2024г.	Прирост/снижение с начала года
ГЦБ МФ РК	-	150,10	88,71%	100%
Депозиты НБРК	-	2,32	1,37%	100%
Денежные средства на инвестиционных счетах	-	0,75	0,45%	100%
Операции РЕПО	-	16,02	9,47%	100%
<b>Итого ПА ОПВР, находящиеся в управлении НБРК</b>	-	<b>169,20</b>	<b>100,00%</b>	<b>100%</b>
Деньги на счетах пенсионных взносов	-	0,79		
<b>Итого ПА ОПВР</b>	-	<b>169,99</b>		

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 за отчетный месяц увеличилась на 6,62 млрд. тенге и составила 150,10 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 88,71%.

В рассматриваемом периоде были приобретены ГЦБ Министерства финансов РК на сумму 6,18 млрд. тенге (6,94 млрд. тенге по номинальной стоимости) со средневзвешенной доходностью 13,41% годовых.

На отчетную дату средневзвешенная доходность к погашению по ГЦБ Министерства финансов РК составила 12,38% годовых.

### **Депозиты в Национальном Банке РК**

Текущая стоимость депозитов в Национальном Банке РК на отчетную дату составила 2,32 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 1,37%.

В отчетном месяце в рамках управления текущей ликвидностью с целью поддержания доходности по ПА ОПВР осуществлено инвестирование в депозиты Национального Банка РК. Средний объем сделок составил 3,29 млрд. тенге со средневзвешенной доходностью 13,25% годовых.

### **Результаты инвестиционной деятельности**

Размер начисленного инвестиционного дохода по ПА ОПВР с начала управления составил 9,19 млрд. тенге.

По состоянию на 1 октября 2024 доходность ПА ОПВР за период с начала управления составила 8,87%.

<sup>1</sup> без учета денег на счетах пенсионных взносов и выплат

### **Информация о соблюдении параметров инвестиционной декларации**

Структурное распределение ПА ОПВР, находящихся в доверительном управлении НБРК, соответствует требованиям Инвестиционной декларации ЕНПФ<sup>2</sup>. Сведения о соблюдении лимитов инвестирования по ПА ОПВР по состоянию на 1 октября 2024 года представлены в Таблице 2.

**Таблица 2. Лимиты инвестирования по ПА ОПВР**

№	Вид финансового инструмента	Фактическое значение (в процентах от общего объема ПА ОПВР)	Выполнение (да/нет)
	Деньги на инвестиционном счете	0,45%	
	Операции РЕПО	9,47%	
1	<b>Казахстанские финансовые инструменты:</b>	<b>90,09%</b>	<b>да</b>
1.1	Государственные ценные бумаги Республики Казахстан, выпущенные Министерством финансов Республики Казахстан, Национальным Банком Республики Казахстан	88,71%	да
1.2	Депозиты Национального Банка Республики Казахстан	1,37%	да
1.3	Долговые ценные бумаги субъектов квазигосударственного сектора	0,00%	да
2	Зарубежные финансовые инструменты, в том числе инструменты, обращающиеся на зарубежных финансовых рынках:	0,00%	да
2.1	Долговые ценные бумаги международных финансовых организаций, имеющие рейтинговую оценку ценной бумаги и/или эмитента не ниже «BBB-» по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинговой оценкой аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств	0,00%	да
2.2	Корпоративные долговые ценные бумаги, имеющие рейтинговую оценку ценной бумаги и (или) эмитента не ниже «BBB-» по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинговой оценкой аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств	0,00%	да

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

**Таблица 3. Сведения по приобретению финансовых инструментов в отчетном месяце**

Вид инструмента	Валюта	Эмитент ценной бумаги	Номинальная стоимость в тенге
ГЦБ РК	KZT	Правительство РК	6 938 104 000
<b>Итого</b>			<b>6 938 104 000</b>

<sup>2</sup> Инвестиционная декларация ЕНПФ утверждена постановлением Правления Национального Банка Республики Казахстан от 23 октября 2023 года №82