

Информация по инвестиционному управлению пенсионными активами АО «ЕНПФ»

По состоянию на 1 января 2026 года пенсионные активы¹ (далее – ПА) ЕНПФ, находящиеся в доверительном управлении Национального Банка Республики Казахстан (далее – НБРК), составили 25 103,96 млрд. тенге².

Структура инвестиционного портфеля в разрезе финансовых инструментов, сформированного за счет пенсионных активов ЕНПФ, представлена в Таблице 1.

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

Наименование	Текущая стоимость на 01.01.2025г.	Доля на 01.01.2025г.	Текущая стоимость на 01.01.2026г.	Доля на 01.01.2026г.	млрд. тенге Прирост/ снижение с начала года
ГЦБ МФ РК	9 317,68	41,57%	10 922,98	43,51%	17,23%
ГЦБ иностранных государств	16,12	0,07%	533,44	2,12%	3206,10%
МФО	283,73	1,27%	310,22	1,24%	9,33%
Корпоративные облигации эмитентов РК	12,20	0,05%	10,17	0,04%	-16,58%
Облигации квазигосударственных организаций РК	1 982,17	8,84%	2 372,47	9,45%	19,69%
Облигации БВУ РК	960,30	4,28%	623,47	2,48%	-35,08%
PPN (структурные ноты)	8,64	0,04%	8,71	0,03%	0,80%
Акции и депозитарные расписки эмитентов РК	378,64	1,69%	484,58	1,93%	27,98%
Депозиты НБРК	696,91	3,11%	1 116,71	4,45%	60,24%
Денежные средства на инвестиционных счетах	2,63	0,01%	19,39	0,08%	638,03%
Операции РЕПО	16,01	0,07%	-	0,00%	-100,00%
Прочие активы, в том числе:	0,02	0,00%	0	0,00%	-100,00%
дебиторская задолженность по депозитарным распискам эмитентов РК	0,02	0,00%	-	0,00%	-100,00%
Индексное управление активами, в том числе:	8 739,96	38,99%	9 376,95	37,35%	7,29%
активы развитых стран	2 571,58	11,47%	2 653,22	10,57%	3,17%
активы развивающихся стран	1 367,36	6,10%	1 471,37	5,86%	7,61%
активы, находящиеся во внешнем управлении	4 801,02	21,42%	5 252,36	20,92%	9,40%
по мандату облигаций развивающихся стран:					
Aviva Investors Global Services Limited	268,05	1,20%	283,57	1,13%	5,79%
TCW Asset Management Company LLC	131,38	0,59%	195,41	0,78%	48,73%
PIMCO Asia Pte Ltd	231,00	1,03%	242,63	0,97%	5,04%
по мандату глобальных акций:					
Invesco Asset Management Deutschland GmbH	355,97	1,59%	412,13	1,64%	15,78%
HSBC Global Asset Management (UK) Limited	574,47	2,56%	637,31	2,54%	10,94%
UBS Asset Management (UK) Ltd	454,12	2,03%	501,65	2,00%	10,47%
Blackrock Financial Management	402,40	1,80%	458,72	1,83%	13,99%
BlackRock Investment Management	233,72	1,04%	263,69	1,05%	12,82%
Robeco Institutional Asset Management B.V.	361,95	1,61%	422,11	1,68%	16,62%
по мандату корпоративных облигаций инвестиционного уровня:					
Principal Global Investors (Europe) Limited	613,03	2,73%	627,94	2,50%	2,43%
PGIM Limited	622,99	2,78%	638,26	2,54%	2,45%
PIMCO Asia Pte Ltd	551,94	2,46%	568,94	2,27%	3,08%
Итого ПА, находящиеся в управлении НБРК	22 415,00	100,00%	25 103,96*	100,00%	12,00%

* - с учетом обязательств к оплате по совершенным сделкам на сумму 675,12 млрд. тенге

¹ сформированные за счет обязательных пенсионных взносов, обязательных профессиональных пенсионных взносов и добровольных пенсионных взносов

² без учета денег на счетах пенсионных взносов и выплат

По состоянию на 01.01.2026г. средневзвешенная доходность к погашению (YTM) долговых финансовых инструментов, находящихся в инвестиционном портфеле ПА ЕНПФ, составила 11,97% годовых, в том числе по номинированным в тенге – 14,31% годовых, в иностранной валюте – 4,26% годовых.

Государственные ценные бумаги Министерства финансов Республики Казахстан

Основную долю в портфеле ПА ЕНПФ занимают ГЦБ Министерства финансов РК, текущая стоимость которых на отчетную дату составила 10 922,98 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 43,51%.

В рассматриваемом периоде были приобретены ГЦБ Министерства финансов РК на сумму 15,00 млрд. тенге по номинальной стоимости с доходностью 15,50% годовых. В отчетном месяце продаж и погашений ГЦБ Министерства финансов РК не было.

На отчетную дату средневзвешенная доходность к погашению по ГЦБ Министерства финансов РК составила 14,24% годовых.

Государственные ценные бумаги иностранных государств в субпортфеле ликвидности

Текущая стоимость ГЦБ иностранных государств в субпортфеле ликвидности за отчетный месяц увеличилась на 1,88 млрд. тенге и составила 533,44 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 2,12%.

В рассматриваемом периоде были приобретены ГЦБ США в объеме 159,66 млрд. тенге по номинальной стоимости со средневзвешенной доходностью 3,59% годовых. В отчетном месяце осуществлено погашение ГЦБ США в объеме 151,29 млрд. тенге, продаж ГЦБ иностранных государств не было.

Средневзвешенная доходность к погашению ГЦБ иностранных государств в субпортфеле ликвидности валютного портфеля ПА ЕНПФ на отчетную дату составила 4,28% годовых.

Облигации международных финансовых организаций

Текущая стоимость облигаций международных финансовых организаций за отчетный месяц уменьшилась на 6,46 млрд. тенге и составила 310,22 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 1,24%.

В отчетном месяце покупок, продаж и погашений ценных бумаг международных финансовых организаций не было.

Средневзвешенная доходность к погашению по облигациям международных финансовых организаций, номинированным в тенге, с фиксированной ставкой вознаграждения составила 15,94% годовых, с индексированной ставкой вознаграждения – на уровне инфляции и премии или ставки TONIA и премии.

Депозиты в Национальном Банке РК

Текущая стоимость депозитов в Национальном Банке РК на отчетную дату составила 1 116,71 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 4,45%.

В отчетном месяце в рамках управления текущей ликвидностью с целью поддержания доходности по пенсионным активам осуществлено инвестирование в депозиты Национального Банка РК. Средний объем сделок составил 495,79 млрд. тенге со средневзвешенной доходностью 17,08% годовых.

Корпоративные облигации эмитентов Республики Казахстан

Текущая стоимость корпоративных облигаций эмитентов РК составила 10,17 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 0,04%.

В отчетном месяце была реализована часть ценных бумаг АО «Dosjan Temir Joly» в объеме 2,08 млрд. тенге. В рассматриваемом периоде покупок и погашений корпоративных облигаций эмитентов РК не было.

Облигации квазигосударственных организаций Республики Казахстан

Текущая стоимость облигаций квазигосударственных организаций РК за отчетный месяц увеличилась на 95,90 млрд. тенге и составила 2 372,47 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 9,45%.

В рассматриваемом периоде были приобретены облигации АО «НИХ «Байтерек» на сумму 49,70 млрд. тенге по номинальной стоимости со средневзвешенной доходностью 17,30% годовых, а также облигации АО «ФНБ «Самрук-Казына» на сумму 90,00 млрд. тенге по номинальной стоимости с доходностью, равной сумме фиксированной маржи в размере 3,5% и инфляции.

В отчетном месяце погашений и продаж ценных бумаг квазигосударственных организаций РК не было.

На отчетную дату средневзвешенная доходность к погашению по облигациям квазигосударственных организаций РК, номинированным в тенге, составила 12,32% годовых, в долларах США – 5,42% годовых.

Облигации банков второго уровня Республики Казахстан

Текущая стоимость облигаций БВУ РК за отчетный месяц увеличилась на 58,97 млрд. тенге и составила 623,47 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 2,48%.

В рассматриваемом периоде были приобретены облигации АО «ЖССБ» Отбасы Банк» на сумму 50,00 млрд. тенге по номинальной стоимости со средневзвешенной доходностью 17,50% годовых, а также облигации АО «Народный Банк Казахстана» на сумму 35,57 млрд. тенге по номинальной стоимости с доходностью, равной сумме фиксированной маржи в размере 4,65% и инфляции.

В рассматриваемом периоде в соответствии со сроком, установленным в проспекте эмиссии, произошло погашение основного долга по облигациям АО «Банк ЦентрКредит» на сумму 26,06 млрд. тенге. В отчетном месяце продаж ценных бумаг БВУ РК не было.

На отчетную дату средневзвешенная доходность к погашению по облигациям БВУ РК составила 17,39% годовых.

PPN (структурные ноты) иностранных эмитентов

Текущая стоимость PPN (структурных нот) иностранных эмитентов в отчетном месяце составила 8,71 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 0,03%.

Продаж, погашений и покупок PPN (структурных нот) иностранных эмитентов не было.

Акции и депозитарные расписки эмитентов Республики Казахстан

Текущая стоимость акций и депозитарных расписок эмитентов РК за отчетный месяц увеличилась на 6,11 млрд. тенге и составила 484,58 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 1,93%.

В рассматриваемом периоде покупок и продаж акций и депозитарных расписок эмитентов РК не было.

Индексное управление активами валютного портфеля

Индексное управление активами предусматривает формирование портфеля инвестиций по отношению к эталонному портфелю, представляющему собой набор ценных бумаг, отражающих стратегические интересы инвестора. Доходность эталонного портфеля служит мерой при оценке эффективности управления портфелем инвестиций. В качестве эталонного портфеля используются индексы, разработанные и отслеживаемые ведущими мировыми финансовыми компаниями либо НБРК.

Согласно стратегическому распределению валютного портфеля индексное управление активами применяется в отношении субпортфеля облигаций развитых стран, субпортфеля облигаций развивающихся стран, субпортфеля корпоративных облигаций и субпортфеля акций.

Индексное управление активами осуществляется как НБРК самостоятельно, так и с привлечением зарубежных управляющих компаний. НБРК осуществляет индексное управление субпортфелем развитых стран и частью субпортфеля облигаций развивающихся стран.

Аллокация валютного портфеля ПА ЕНПФ, находящихся в доверительном управлении НБРК, на 1 января 2026 года представлена в Таблице 2.

Таблица 2. Стратегическое распределение валютного портфеля ПА ЕНПФ на 01.01.2026г.

Субпортфель	Целевое значение (допустимое отклонение)	Стоимость, в млн. долларах США	Стоимость, в млрд. тенге	Доля от валютного портфеля, %	Доля от ПА ЕНПФ, %
Облигации развитых стран	25% ($\pm 10\%$)	5 248,39	2 653,22	25,80%	10,57%
Облигации развивающихся стран	25% ($\pm 10\%$)	4 337,97	2 192,97	21,33%	8,74%
Корпоративные облигации	20% ($\pm 10\%$)	3 630,13	1 835,14	17,85%	7,31%
Акции	30% ($\pm 10\%$)	5 332,25	2 695,61	26,21%	10,74%
Ликвидность	0% (+10%)	1 792,75	906,29	8,81%	3,61%
Итого валютный портфель		20 341,50	10 283,24	100,00%	40,96%

Субпортфель облигаций развитых стран

Текущая стоимость субпортфеля облигаций развитых стран за отчетный месяц уменьшилась на 32,75 млрд. тенге и составила 2 653,22 млрд. тенге. Доля субпортфеля облигаций развитых стран в портфеле ПА ЕНПФ составила 10,57%.

Эталонным портфелем для субпортфеля облигаций развитых стран является индекс Custom Index (G502), состоящий из государственных ценных бумаг США со сроком погашения до 10 лет, номинированных в долларах США. В состав данного индекса на 1 января 2026 года входят 202 выпуска облигаций.

Субпортфель облигаций развивающихся стран

Текущая стоимость субпортфеля облигаций развивающихся стран за отчетный месяц уменьшилась на 27,36 млрд. тенге и составила 2 192,97 млрд. тенге. Доля субпортфеля облигаций развивающихся стран в портфеле ПА ЕНПФ составила 8,74%.

Эталонным портфелем для субпортфеля облигаций развивающихся стран является индекс Custom Index (Q979), состоящий из облигаций, номинированных в долларах США, эмитентами которых являются развивающиеся страны с рейтинговой оценкой не ниже «BB-». В состав данного индекса на 1 января 2026 года входит 469 выпусков облигаций, номинированных в долларах США, выпущенных 31 развивающейся страной.

Субпортфель корпоративных облигаций

Текущая стоимость субпортфеля корпоративных облигаций за отчетный месяц уменьшилась на 12,24 млрд. тенге и составила 1 835,14 млрд. тенге. Доля субпортфеля корпоративных облигаций в портфеле ПА ЕНПФ составила 7,31%.

Эталонным портфелем для субпортфеля корпоративных облигаций является индекс Custom Index (Q980), состоящий из корпоративных ценных бумаг, номинированных в долларах США, эмитентами которых являются резиденты развитых и развивающихся стран с высокой капитализацией и рейтинговой оценкой не ниже «BBB-». В состав данного индекса на 1 января 2026 года входит 7 979 выпуска облигаций, выпущенных 1 374 эмитентами.

Субпортфель акций

Текущая стоимость субпортфеля акций за отчетный месяц уменьшилась на 20,47 млрд. тенге и составила 2 695,61 млрд. тенге. Доля субпортфеля акций в портфеле ПА ЕНПФ составила 10,74%.

Эталонным портфелем для субпортфеля акций является индекс Custom MSCI World Index, состоящий из акций компаний развитых стран мира. В состав данного индекса на 1

января 2026 года входит 1 279 акций компаний с высокой и средней капитализацией, относящихся к 23 развитым странам. Основную долю индекса в размере 74% занимают акции компаний США. В индекс также входят акции компаний из таких стран, как Япония, Великобритания, Франция, Канада и другие.

Валютная структура

Инвестиционный портфель финансовых инструментов в разрезе валют, в которых номинированы финансовые инструменты, приобретенные за счет пенсионных активов ЕНПФ, представлен в Таблице 3.

Таблица 3. Структура инвестиционного портфеля ПА ЕНПФ, находящихся в доверительном управлении НБРК, в разрезе валют

Валюта	Текущая стоимость на 01.01.2025г.	Доля на 01.01.2025г.	Текущая стоимость на 01.01.2026г.	Доля на 01.01.2026г.	Прирост/ снижение с начала года
Национальная валюта	13 400,82	59,79%	14 820,73	59,04%	10,60%
Доллары США	9 013,29	40,21%	10 282,31	40,96%	14,08%
Другие валюты	0,88	0,00%	0,93	0,00%	5,01%
Итого:	22 415,00	100,00%	25 103,96	100,00%	12,00%

Результаты инвестиционной деятельности

В результате инвестиционной деятельности, а также вследствие волатильности курсов иностранных валют и изменения рыночной стоимости финансовых инструментов, размер начисленного инвестиционного дохода за 2025 год составил 1,77 трлн. тенге. Доходность пенсионных активов ЕНПФ, распределенная на счета вкладчиков (получателей) за 2025 год составила 7,43% при инфляции в размере 12,30%.

Основными причинами, негативно повлиявшими на доходность в 2025 году, являются:

- 1) отрицательная курсовая переоценка вследствие укрепления тенге к доллару США с 525,11 до 505,53 тенге;
- 2) снижение рыночной стоимости ГЦБ Министерства финансов РК в связи с увеличением их доходностей на фоне роста инфляции и инфляционных ожиданий.

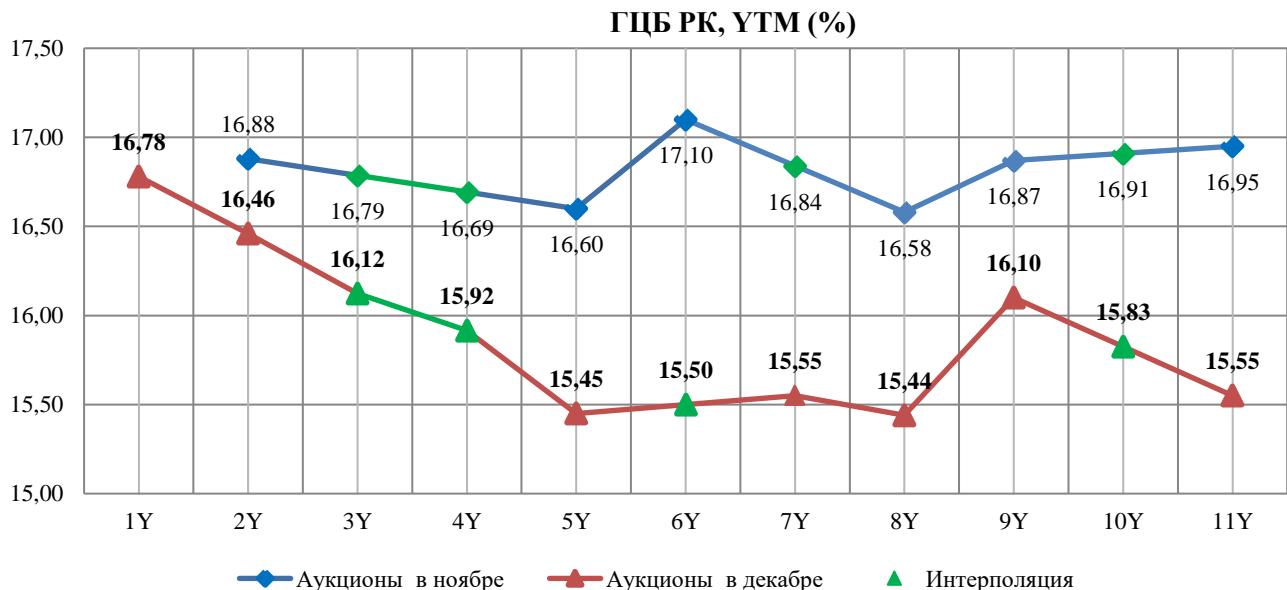
Важно отметить, что доходность пенсионных активов за отдельные краткосрочные периоды времени не является показателем эффективности их управления, поскольку доходы в виде вознаграждения по финансовым инструментам и другим операциям, начисленные за короткий промежуток времени, не всегда покрывают колебания стоимости ценных бумаг и курсов валют за данный период. Поэтому объективный анализ размера инвестиционного дохода целесообразно делать за более длительный период времени.

В декабре 2025 года на финансовых рынках наблюдалась умеренная волатильность на фоне снижения базовой ставки ФРС, а также возобновление работы правительства США, что позволило восстановить регулярную публикацию ключевых макроэкономических данных. Инфляция за декабрь составила 2,7% годовых (2,7% в ноябре), а ее месячный прирост составил 0,3%. Рост числа новых созданных рабочих мест в несельскохозяйственном секторе в декабре составил 70 тысяч рабочих мест (в ноябре 50 тысяч), в то время как уровень безработицы вырос с 4,4% в ноябре до 4,5% в декабре. В 2026 году рынок ожидает 2 снижения базовой ставки.

В результате доходность эталонных 10-летних казначейских облигаций США в декабре выросла на 16 б.п. и составила 4,17%. Спреды по облигациям развивающихся стран сузились на 13 б.п., а спреды по корпоративным облигациям сузились на 3 б.п. Вместе с тем индекс акций MSCI World показал рост на 0,7%.

На аукционах по размещению ГЦБ РК в декабре наблюдалось снижение доходностей вдоль всей кривой на фоне значительного роста спроса и решения НБРК о сохранении базовой ставки на уровне 18%. Инфляция замедлилась до 12,3% годовых (12,4% в ноябре), при этом в месячном выражении рост составил 0,9% за декабрь (0,8% в ноябре). На аукционах по размещению ГЦБ РК наблюдался высокий спрос, который в 5 раз превысил предложение, при

этом основной спрос был сосредоточен в долгосрочных размещениях. Объем заимствования МФРК в декабре уменьшился по сравнению с ноябрем и составил 281 млрд тенге.



Структура начисленного инвестиционного дохода с начала 2025 года представлена в Таблице 4.

Таблица 4. Структура инвестиционного дохода, полученного по ПА ЕНПФ, находящимся в доверительном управлении НБРК по состоянию на 01.01.2026г.

Наименование	Инвестиционный доход за 2025 год млрд. тенге
Доходы в виде вознаграждения по ценным бумагам, в том числе по размещенным вкладам и операциям «обратное РЕПО»	1 981,23
Доходы (убытки) от рыночной переоценки ценных бумаг	-499,98
Доходы (убытки) от переоценки иностранной валюты, за исключением активов во внешнем управлении	-165,55
Доходы (убытки) по активам, находящимся во внешнем управлении, в том числе с учетом курсовой переоценки	451,35
Прочие доходы (убытки)	6,14
Итого:	1 773,19

Информация о соблюдении параметров инвестиционной декларации

Структурное распределение ПА ЕНПФ, находящихся в доверительном управлении, соответствует требованиям Инвестиционной декларации ЕНПФ³. Доли валютных позиций остаются в рамках допустимого уровня и не нарушают требований Инвестиционной декларации ЕНПФ. Сведения о соблюдении лимитов инвестирования по ПА ЕНПФ по состоянию на 1 января 2026 года представлены в Таблице 5.

Таблица 5. Лимиты инвестирования по ПА ЕНПФ

№	Вид финансового инструмента	Фактическое значение, в млрд. тенге	Фактическое значение (в процентах от общего объема ПА)	Выполнение (да/нет)
	Денежные средства KZT	0,10	0,00%	да
	Денежные средства в иностранной валюте	32,74	0,13%	да

³ Инвестиционная декларация ЕНПФ утверждена постановлением Правления Национального Банка Республики Казахстан от 23 октября 2023 года №82

1	Казахстанские финансовые инструменты:	15 507,84	61,77%	да
1.1	Государственные ценные бумаги Республики Казахстан, выпущенные Министерством финансов Республики Казахстан, Национальным Банком Республики Казахстан	10 922,98	43,51%	да
1.1.1	Государственные ценные бумаги Республики Казахстан, выпущенные местными исполнительными органами Республики Казахстан	0,00	0,00%	да
1.2	Депозиты Национального Банка Республики Казахстан	1 116,71	4,45%	да
1.3	Ценные бумаги субъектов квазигосударственного сектора	2 751,78	10,96%	да
1.4	Финансовые инструменты банков второго уровня Республики Казахстан, имеющие рейтинговую оценку ценной бумаги и/или эмитента не ниже «В» по международной шкале агентства «Standard & Poor's» или рейтинговой оценкой аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, в том числе:	647,99	2,58%	да
1)	долговые ценные бумаги, за исключением субординированных долговых ценных бумаг	614,42	2,45%	да
2)	долевые ценные бумаги	33,57	0,13%	да
3)	депозиты	0,00	0,00%	да
1.5	Негосударственные долговые ценные бумаги, за исключением долговых ценных бумаг субъектов квазигосударственного сектора и банков второго уровня Республики Казахстан, имеющими рейтинговую оценку ценной бумаги и/или эмитента не ниже «В» по международной шкале агентства «Standard & Poor's» или рейтинговой оценкой аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств	0,00	0,00%	да
1.5.1	Негосударственные долговые ценные бумаги, выпущенные под гарантую и/или поручительство Правительства Республики Казахстан	0,00	0,00%	да
1.6	Негосударственные долевые ценные бумаги, за исключением долевых ценных бумаг субъектов квазигосударственного сектора и банков второго уровня Республики Казахстан, входящие в категорию «Премиум» официального списка фондовой биржи Республики Казахстан или аналогичной ей на момент инвестирования, либо имеющие листинг на мировых фондовых биржах, рыночная капитализация которых превышает три триллиона долларов США	68,38	0,27%	да
1.7	Инструменты исламского финансирования, включенные в официальный список фондовой биржи Республики Казахстан и (или) на фондовой бирже, функционирующей на территории Международного финансового центра «Астана»	0,00	0,00%	да
1.8	Ценные бумаги под залог недвижимости (MBS) и активов (ABS) с рейтинговой оценкой ценной бумаги и/или эмитента не ниже «BB» по международной шкале агентства «Standard & Poor's» или рейтинговой оценкой аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств	0,00	0,00%	да
2	Зарубежные финансовые инструменты, в том числе инструменты, обращающиеся на зарубежных финансовых рынках:	10 102,07	40,24%	да
2.1	Государственные, агентские и ценные бумаги международных финансовых организаций имеющие рейтинговую оценку ценной бумаги и/или эмитента не ниже «BB» по международной шкале агентства «Standard & Poor's» или рейтинговой оценкой аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств	5 514,04	21,96%	да
2.2.	Муниципальные ценные бумаги в рамках инвестирования в государственные и агентские ценные бумаги	0,00	0,00%	да
2.3	Корпоративные долговые ценные бумаги имеющие рейтинговую оценку ценной бумаги и/или эмитента не ниже «BB» по международной шкале агентства «Standard & Poor's» или рейтинговой оценкой аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств	1 898,47	7,56%	да
2.4	Ценные бумаги под залог недвижимости (MBS) и активов (ABS) с рейтинговой оценкой 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	0,00%	да
2.5	Конвертируемые ценные бумаги в рамках инвестирования в корпоративные ценные бумаги имеющие рейтинговую оценку ценной бумаги и/или эмитента не ниже «BB» по	0,00	0,00%	да

	международной шкале агентства «Standard & Poor's» или рейтинговой оценкой аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств			
2.6	Акции, депозитарные расписки на акции	2 680,85	10,68%	да
2.7	Депозиты (вклады) с контрагентами, имеющих рейтинговую оценку не ниже «A-» по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинговую оценку аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств	0,00	0,00%	да
2.8	Структурные продукты, выпущенные организациями, имеющими рейтинговую оценку не ниже «BBB-» по международной шкале агентства «Standard & Poor's» или рейтинговую оценку аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств	8,71	0,03%	да
2.9	Инструменты исламского финансирования, имеющие рейтинговую оценку не ниже «BB-» по международной шкале агентства «Standard & Poor's» или рейтинговой оценкой аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств	84,88	0,34%	да

№	Вид финансового инструмента	Фактическое значение, в млрд. тенге	Фактическое значение (в процентах от общего объема ПА)	Выполнение (да/нет)
1	Производные финансовые инструменты, из них:	0,00	0,00%	да
1.1	Производные финансовые инструменты, используемые в целях хеджирования инвестиционного риска	0,00	0,00%	да
1.2	Производные финансовые инструменты, используемые в целях инвестирования	0,00	0,00%	да
1.3	Золото в слитках и на металлических счетах	0,00	0,00%	да

Таблица 6. Информация о соблюдении требований Инвестиционной декларации ЕНПФ по управлению валютным портфелем

Субпортфель	Фактическое значение (в процентах от валютного портфеля)	Доля во внешнем управлении от субпортфеля	Мандат	Доля от субпортфеля акций	Выполнение (да/нет)
Облигации развитых стран	25,80%	-	-		да
Облигации развивающихся стран	21,33%	32,91%	-		да
Корпоративные облигации	17,85%	100%	-		да
				Пассивное управление, в том числе:	
				ESG	52,03% да
Акции	26,21%	100%		quality	9,53% да
				min.vol	9,49% да
				classic	4,18% да
				Активное управление	28,83% да
Ликвидность	8,81%	-	-		47,97% да
Итого валютный портфель	100%				

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

Таблица 7. Сведения по приобретению финансовых инструментов в отчетном месяце

Вид инструмента	Валюта	Эмитент ценной бумаги	Номинальная стоимость в тенге
ГЦБ РК	KZT	Правительство РК	15 000 000 000
ГЦБ иностранных государств	USD	Правительство США	159 656 200 000

Облигации квазигосударственных организаций	KZT	АО «НИХ «Байтерек»	49 700 000 000
Облигации квазигосударственных организаций	KZT	АО «ФНБ «Самрук-Казына»	90 000 000 000
Облигации БВУ РК	KZT	АО «ЖССБ «Отбасы Банк»	50 000 000 000
Облигации БВУ РК	KZT	АО «Народный Банк Казахстана»	35 574 880 000
Итого			399 931 080 000

Таблица 8. Сведения по продаже финансовых инструментов в отчетном месяце

Вид инструмента	Валюта	Эмитент ценной бумаги	Сумма сделки в тенге
Корпоративные облигации эмитентов РК	KZT	АО «Dosjan temir joly»	2 082 902 778
Итого			2 082 902 778

Таблица 9. Сведения по погашениям основного долга по ценным бумагам в отчетном месяце

Вид инструмента	Валюта	Эмитент ценной бумаги	Сумма к погашению в тенге
ГЦБ иностранных государств	USD	Правительство США	151 291 840 000
Облигации БВУ РК	KZT	АО «Банк ЦентрКредит»	26 057 526 200
Итого			177 349 366 200