

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

По состоянию на 1 августа 2024 года пенсионные активы, сформированные за счет обязательных пенсионных взносов работодателя (далее – ПА ОПВР), находящиеся в доверительном управлении НБРК, составили 120,03 млрд. тенге¹.

Средневзвешенная доходность к погашению (УТМ) долговых финансовых инструментов, находящихся в инвестиционном портфеле ПА ОПВР, составила 8,20% 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 01.08.2024г.	Доля на 01.08.2024г.	Прирост/снижение с начала года
ГЦБ МФ РК	-	102,92	85,75%	100%
Депозиты НБРК	-	0,50	0,41%	100%
Денежные средства на инвестиционных счетах	-	0,52	0,44%	100%
Операции РЕПО	-	16,09	13,40%	100%
Итого ПА ОПВР, находящиеся в управлении НБРК	-	120,03	100,00%	100%
Деньги на счетах пенсионных взносов	-	0,46		
Итого ПА ОПВР	-	120,49		

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 10,44 млрд. тенге и составила 102,92 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 85,75%.

В рассматриваемом периоде были приобретены ГЦБ Министерства финансов РК на сумму 11,04 млрд. тенге (13,10 млрд. тенге по номинальной стоимости) со средневзвешенной доходностью 13,41% годовых.

На отчетную дату средневзвешенная доходность к погашению по ГЦБ Министерства финансов РК составила 12,92% годовых.

Депозиты в Национальном Банке РК

Текущая стоимость депозитов в Национальном Банке РК на отчетную дату составила 0,50 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 0,41%.

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 3,50 млрд. тенге со средневзвешенной доходностью 13,37% годовых.

Результаты инвестиционной деятельности

Размер начисленного инвестиционного дохода по ПА ОПВР с начала управления составил 1,02 млрд. тенге.

По состоянию на 1 августа 2024 доходность ПА ОПВР за период с начала управления составила 2,53%.

¹ 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 ЕНПФ². Сведения о соблюдении лимитов инвестирования по ПА ОПВР по состоянию на 1 августа 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	0,44%	
	Операции РЕПО	13,40%	
1	Казахстанские финансовые инструменты:	86,16%	да
1.1	Государственные ценные бумаги Республики Казахстан, выпущенные Министерством финансов Республики Казахстан, Национальным Банком Республики Казахстан	85,75%	да
1.2	Депозиты Национального Банка Республики Казахстан	0,41%	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	13 100 000 000
Итого			13 100 000 000

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