

Информация по инвестиционному управлению пенсионными активами АО «ЕНПФ»

По состоянию на 1 августа 2025 года пенсионные активы¹ (далее – ПА) ЕНПФ, находящиеся в доверительном управлении Национального Банка Республики Казахстан (далее – НБРК), составили 24 283,88 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	млрд. тенге				
	Текущая стоимость на 01.01.2025г.	Доля на 01.01.2025г.	Текущая стоимость на 01.08.2025г.	Доля на 01.08.2025г.	Прирост/снижение с начала года
ГЦБ МФ РК	9 317,68	41,57%	10 410,84	42,87%	11,73%
ГЦБ иностранных государств	16,12	0,07%	559,13	2,30%	3 369,29%
МФО	283,73	1,27%	283,08	1,17%	-0,23%
Корпоративные облигации эмитентов РК	12,20	0,05%	11,93	0,05%	-2,21%
Облигации квазигосударственных организаций РК	1 982,17	8,84%	2 141,50	8,82%	8,04%
Облигации БВУ РК	960,30	4,28%	681,79	2,81%	-29,00%
PPN (структурные ноты)	8,64	0,04%	9,11	0,04%	5,43%
Акции и депозитарные расписки эмитентов РК	378,64	1,69%	451,63	1,86%	19,28%
Депозиты НБРК	696,91	3,11%	472,07	1,94%	-32,26%
Денежные средства на инвестиционных счетах	2,63	0,01%	12,02	0,05%	357,53%
Операции РЕПО	16,01	0,07%	-	0,00%	-100,00%
Прочие активы (дебиторская задолженность, просроченная задолженность, провизии)	0,02	0,00%	5,31	0,02%	-
Индексное управление активами, в том числе:	8 739,96	38,99%	9 499,96	39,12%	8,70%
активы развитых стран	2 571,58	11,47%	2 762,37	11,38%	7,42%
активы развивающихся стран	1 367,36	6,10%	1 497,49	6,17%	9,52%
активы, находящиеся во внешнем управлении	4 801,02	21,42%	5 240,11	21,58%	9,15%
по мандату облигаций развивающихся стран:					
Aviva Investors Global Services Limited	268,05	1,20%	286,56	1,18%	6,91%
TCW Asset Management Company LLC	131,38	0,59%	196,47	0,81%	49,54%
PIMCO Asia Pte Ltd	231,00	1,03%	245,08	1,01%	6,10%
по мандату глобальных акций:					
Invesco Asset Management Deutschland GmbH	355,97	1,59%	394,42	1,62%	10,80%
HSBC Global Asset Management (UK) Limited	574,47	2,56%	627,30	2,58%	9,20%
UBS Asset Management (UK) Ltd	454,12	2,03%	490,25	2,02%	7,95%
Blackrock Financial Management	402,40	1,80%	443,95	1,83%	10,32%
BlackRock Investment Management	233,72	1,04%	256,72	1,06%	9,84%
Robeco Institutional Asset Management B.V.	361,95	1,61%	408,82	1,68%	12,95%
по мандату корпоративных облигаций инвестиционного уровня:					
Principal Global Investors (Europe) Limited	613,03	2,73%	646,78	2,66%	5,51%
PGIM Limited	622,99	2,78%	657,55	2,71%	5,55%
PIMCO Asia Pte Ltd	551,94	2,46%	586,20	2,41%	6,21%
Итого ПА, находящиеся в управлении НБРК	22 415,00	100,00%	24 283,88*	100,00%*	8,34%

* - с учетом обязательств к оплате по совершенным сделкам на сумму 254,48 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 01.08.2025г. средневзвешенная доходность к погашению (YTM) долговых финансовых инструментов, находящихся в инвестиционном портфеле ПА ЕНПФ, составила 11,57% годовых, в том числе по номинированным в тенге – 13,95% годовых, в иностранной валюте – 4,64% 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 10 410,84 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 42,87%.

В рассматриваемом периоде были приобретены ГЦБ Министерства финансов РК на общую сумму 211,20 млрд. тенге по номинальной стоимости, в том числе на сумму 198,70 млрд. тенге с фиксированной ставкой вознаграждения и средневзвешенной доходностью 16,95% годовых, а также на сумму 12,50 млрд. тенге с доходностью, равной сумме фиксированной маржи в размере 0,98% и ставки TONIA. В отчетном месяце осуществлено погашение ГЦБ Министерства финансов РК в объеме 11,00 млрд. тенге, продаж ГЦБ Министерства финансов РК не было.

На отчетную дату средневзвешенная доходность к погашению по ГЦБ Министерства финансов РК составила 14,21% годовых.

Государственные ценные бумаги иностранных государств в субпортфеле ликвидности

Текущая стоимость ГЦБ иностранных государств в субпортфеле ликвидности за отчетный месяц увеличилась на 91,69 млрд. тенге и составила 559,13 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 2,30%.

В рассматриваемом периоде были приобретены ГЦБ США в объеме 128,99 млрд. тенге с доходностью 4,35% годовых, а также осуществлено погашение ГЦБ США в объеме 57,85 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 4,86% годовых.

Облигации международных финансовых организаций

Текущая стоимость облигаций международных финансовых организаций за отчетный месяц увеличилась на 1,52 млрд. тенге и составила 283,08 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 1,17%.

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 14,12% 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 472,07 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 1,94%.

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 227,41 млрд. тенге со средневзвешенной доходностью 15,57% годовых.

Корпоративные облигации эмитентов Республики Казахстан

Текущая стоимость корпоративных облигаций эмитентов РК составила 11,93 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 0,05%.

В рассматриваемом периоде покупок, продаж и погашений корпоративных облигаций эмитентов РК не было.

Облигации квазигосударственных организаций Республики Казахстан

Текущая стоимость облигаций квазигосударственных организаций РК за отчетный месяц увеличилась на 22,90 млрд. тенге и составила 2 141,50 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 8,82%.

В рассматриваемом периоде были приобретены облигации АО «НУХ «Байтерек» на сумму 26,0 млрд. тенге по номинальной стоимости с доходностью 17,70% годовых. В соответствии со сроками, установленными в проспектах эмиссии, произошло погашение основного долга по облигациям АО «НУХ «Байтерек» на сумму 8,12 млрд. тенге, а также по облигациям АО «Банк Развития Казахстана» на сумму 5,95 млрд. тенге. В отчетном месяце продаж ценных бумаг квазигосударственных организаций РК не было.

На отчетную дату средневзвешенная доходность к погашению по облигациям квазигосударственных организаций РК, номинированным в тенге, составила 12,15% годовых, в долларах США – 5,48% годовых.

Облигации банков второго уровня Республики Казахстан

Текущая стоимость облигаций БВУ РК за отчетный месяц уменьшилась на 65,19 млрд. тенге и составила 681,79 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 2,81%.

В рассматриваемом периоде в соответствии со сроком, установленным в проспекте эмиссии, произошло погашение основного долга по облигациям АО «Kaspi Bank» на сумму 59,10 млрд. тенге.

В отчетном месяце покупок и продаж ценных бумаг БВУ РК не было.

На отчетную дату средневзвешенная доходность к погашению по облигациям БВУ РК составила 14,18% годовых.

PPN (структурные ноты) иностранных эмитентов

Текущая стоимость PPN (структурных нот) иностранных эмитентов в отчетном месяце составила 9,11 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 0,04%.

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 44,52 млрд. тенге и составила 451,63 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 1,86%.

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 августа 2025 года представлена в Таблице 2.

Таблица 2. Стратегическое распределение валютного портфеля ПА ЕНПФ на 01.08.2025г.

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	30% ($\pm 10\%$)	5 108,12	2 762,37	26,60%	11,38%
Облигации развивающихся стран	25% ($\pm 10\%$)	4 115,53	2 225,59	21,43%	9,16%
Корпоративные облигации	20% ($\pm 10\%$)	3 495,93	1 890,53	18,20%	7,79%
Акции	25% (-17%/+10%)	4 847,56	2 621,47	25,24%	10,80%
Ликвидность	0% (+40%)	1 637,59	885,58	8,53%	3,65%
Итого валютный портфель		19 204,74	10 385,54	100,00%	42,77%

Субпортфель облигаций развитых стран

Текущая стоимость субпортфеля облигаций развитых стран за отчетный месяц увеличилась на 105,92 млрд. тенге и составила 2 762,37 млрд. тенге. Доля субпортфеля облигаций развитых стран в портфеле ПА ЕНПФ составила 11,38%.

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 августа 2025 года входит 203 выпуска облигаций.

Субпортфель облигаций развивающихся стран

Текущая стоимость субпортфеля облигаций развивающихся стран за отчетный месяц увеличилась на 114,97 млрд. тенге и составила 2 225,59 млрд. тенге. Доля субпортфеля облигаций развивающихся стран в портфеле ПА ЕНПФ составила 9,16%.

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 «ВВ». В состав данного индекса на 1 августа 2025 года входит 434 выпуска облигаций, номинированных в долларах США, выпущенных 29 развивающимися странами.

Субпортфель корпоративных облигаций

Текущая стоимость субпортфеля корпоративных облигаций за отчетный месяц увеличилась на 106,96 млрд. тенге и составила 1 890,53 млрд. тенге. Доля субпортфеля корпоративных облигаций в портфеле ПА ЕНПФ составила 7,79%.

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 «ВВВ-». В состав данного индекса на 1 августа 2025 года входит 7 793 выпуска облигаций, выпущенных 1 354 эмитентами.

Субпортфель акций

Текущая стоимость субпортфеля акций за отчетный месяц увеличилась на 202,05 млрд. тенге и составила 2 621,47 млрд. тенге. Доля субпортфеля акций в портфеле ПА ЕНПФ составила 10,80%.

Эталонным портфелем для субпортфеля акций является индекс Custom MSCI World Index, состоящий из акций компаний развитых стран мира. В состав данного индекса на 1 августа 2025 года входит 1 281 акция 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 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.

В отчетном периоде в целях поддержания валютной доли пенсионных активов в долгосрочном периоде на уровне не менее 40% для диверсификации инвестиционного портфеля было приобретено 34,50 млн. долларов США на Казахстанской фондовой бирже.

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

Валюта	млрд. тенге				
	Текущая стоимость на 01.01.2025г.	Доля на 01.01.2025г.	Текущая стоимость на 01.08.2025г.	Доля на 01.08.2025г.	Прирост/снижение с начала года
Национальная валюта	13 400,82	59,79%	13 898,34	57,23%	3,71%
Доллары США	9 013,29	40,21%	10 384,82	42,76%	15,22%
Другие валюты	0,88	0,00%	0,72	0,003%	-18,13%
Итого:	22 415,00	100,00%	24 283,88	100,00%	8,34%

Результаты инвестиционной деятельности

В результате инвестиционной деятельности, а также вследствие волатильности курсов иностранных валют и изменения рыночной стоимости финансовых инструментов, размер начисленного инвестиционного дохода с начала 2025 года составил 1,12 трлн. тенге. Доходность пенсионных активов ЕНПФ, распределенная на счета вкладчиков (получателей) с начала 2025 года, составила 4,68%.

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 период не менее одного года.

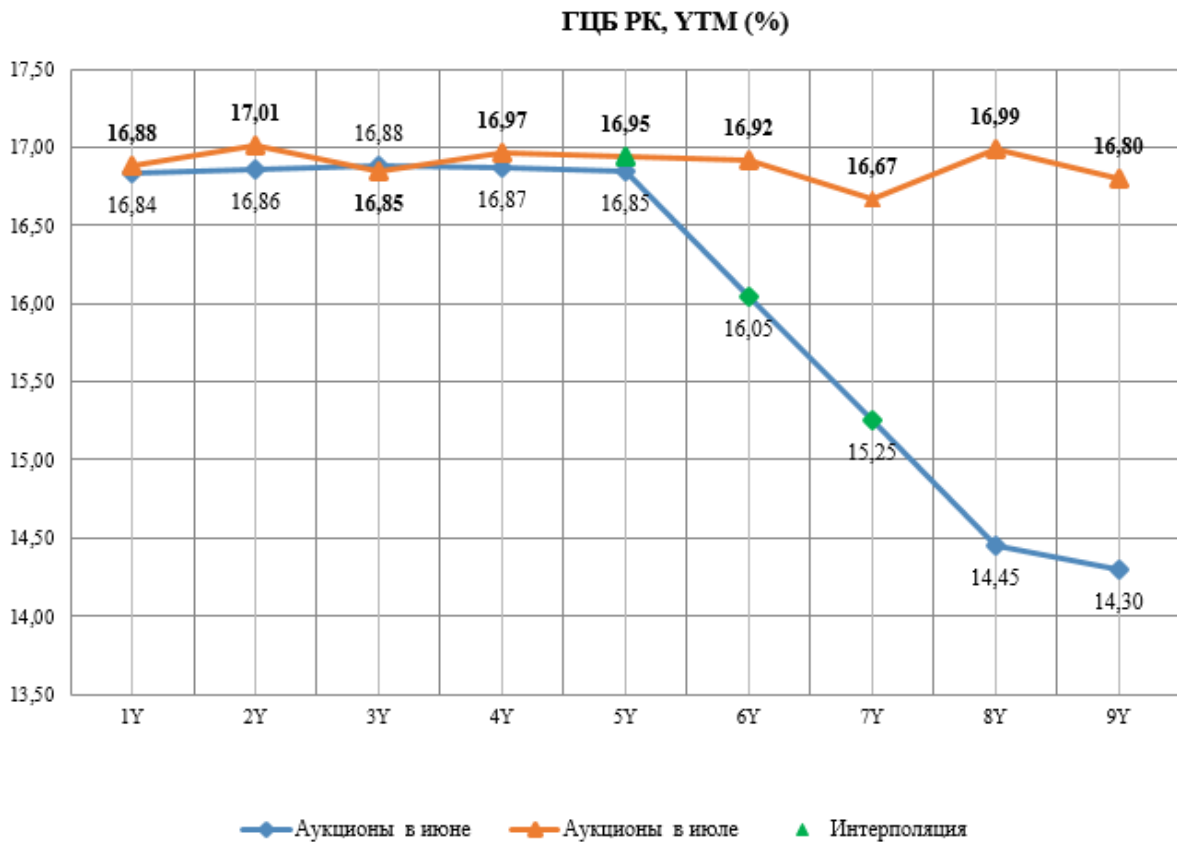
Размер начисленного инвестиционного дохода за последние 12 месяцев с августа 2024 года по июль 2025 года составил порядка 3,11 трлн. тенге, доходность за данный период составила 14,74% при инфляции в размере 11,80%.

В июле 2025 года на финансовых рынках наблюдалась низкая волатильность на фоне решения ФРС о сохранении базовой ставки и снижения ожиданий роста экономики. В то же время инфляция в США сохранилась на прежнем уровне, а рынок труда демонстрировал признаки замедления. Инфляция в США в июле сохранилась на том же уровне, что и в июне – 2,7% годовых, а ее месячный прирост составил 0,2% (0,3% в июне). Рост числа новых созданных рабочих мест в несельскохозяйственном секторе в июле составил 73 тысячи рабочих мест, в то время как уровень безработицы вырос с 4,1% до 4,2%. До конца 2025 года рынок ожидает 2 снижения базовой ставки.

В результате доходность эталонных 10-летних казначейских облигаций США в июле выросла на 15 б.п. и составила 4,37%. Спреды по облигациям развивающихся стран сузились на 22 б.п., а спреды по корпоративным облигациям – на 8 б.п. Вместе с тем индекс акций MSCI World показал незначительный рост.

На аукционах по размещению ГЦБ РК в июле наблюдался рост доходностей по всей кривой. Инфляция сохранилась на прежнем уровне в 11,8% годовых (11,8% в июне), при этом замедлилась в месячном выражении до 0,7% за июль (0,8% в июне). На аукционах по размещению ГЦБ РК наблюдался высокий спрос, который в 1,5 раза превысил предложение, при этом основной спрос был сосредоточен в краткосрочных размещениях. Вместе с тем

объем заимствования МФРК в июле незначительно вырос по сравнению с июнем и составил 682 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 01.08.2025г.

млрд. тенге

Наименование	Инвестиционный доход за 2025 год
Доходы в виде вознаграждения по ценным бумагам, в том числе по размещенным вкладам и операциям «обратное РЕПО»	1 104,97
Доходы (убытки) от рыночной переоценки ценных бумаг	-590,25
Доходы (убытки) от переоценки иностранной валюты, за исключением активов во внешнем управлении	159,38
Доходы (убытки) по активам, находящимся во внешнем управлении, в том числе с учетом курсовой переоценки	439,09
Прочие доходы (убытки)	5,01
Итого:	1 118,20

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 августа 2025 года представлены в Таблице 5.

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

Таблица 5. Лимиты инвестирования по ПА ЕНПФ

№	Вид финансового инструмента	Фактическое значение (в процентах от общего объема ПА)	Выполнение (да/нет)
	Денежные средства KZT	0,00%	да
	Денежные средства в иностранной валюте	0,24%	да
1	Казахстанские финансовые инструменты:	58,00%	да
1.1	Государственные ценные бумаги Республики Казахстан, выпущенные Министерством финансов Республики Казахстан, Национальным Банком Республики Казахстан	42,87%	да
1.1.1	Государственные ценные бумаги Республики Казахстан, выпущенные местными исполнительными органами Республики Казахстан	0,00%	да
1.2	Депозиты Национального Банка Республики Казахстан	1,94%	да
1.3	Ценные бумаги субъектов квазигосударственного сектора	10,21%	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:	2,70%	да
1)	долговые ценные бумаги, за исключением субординированных долговых ценных бумаг	2,50%	да
2)	долевые ценные бумаги	0,21%	да
3)	депозиты	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%	да
1.5.1	Негосударственные долговые ценные бумаги, выпущенные под гарантию и/или поручительство Правительства Республики Казахстан	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 «Премии» 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	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%	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%	да
2	Зарубежные финансовые инструменты, в том числе инструменты, обращающиеся на зарубежных финансовых рынках:	41,97%	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	23,14%	да
2.2.	Муниципальные ценные бумаги в рамках инвестирования в государственные и агентские ценные бумаги	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	8,06%	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%	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 международной шкале агентства «Standard & Poor's» или	0,00%	да

	рейтинговой оценкой аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств		
2.6	Акции, депозитарные расписки на акции	10,73%	да
2.7	Депозиты (вклады) с контрапартнерами, имеющих рейтинговую оценку не ниже «А-» по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинговую оценку аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств	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	0,04%	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	0,37%	да

№	Вид финансового инструмента	Фактическое значение (в процентах от общего объема ПА)	Выполнение (да/нет)
1	Производные финансовые инструменты, из них:	0,00%	да
1.1	Производные финансовые инструменты, используемые в целях хеджирования инвестиционного риска	0,00%	да
1.2	Производные финансовые инструменты, используемые в целях инвестирования	0,00%	да
1.3	Золото в слитках и на металлических счетах	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	26,60%	-	-		да
Облигации развивающихся стран	21,43%	32,50%	-		да
Корпоративные облигации	18,20%	100%	-		да
Акции	25,24%	100%	Пассивное управление, в том числе:	52,42%	да
			ESG	9,47%	да
			quality	9,57%	да
			min.vol	4,55%	да
			classic	28,84%	да
			Активное управление	47,58%	да
Ликвидность	8,53%	-	-		да
Итого валютный портфель	100,00%				

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	211 200 000 000
ГЦБ иностранных государств	USD	Правительство США	128 992 500 000
Облигации квазигосударственных организаций	KZT	АО «НУХ «Байтерек»	26 000 000 000
Итого			366 192 500 000

Таблица 8. Сведения по погашениям основного долга по ценным бумагам в отчетном месяце

Вид инструмента	Валюта	Эмитент ценной бумаги	Сумма к погашению в тенге
ГЦБ РК	KZT	Правительство РК	11 000 000 000
ГЦБ иностранных государств	USD	Правительство США	57 845 700 000
Облигации квазигосударственных организаций	KZT	АО «НУХ «Байтерек»	8 116 236 000
Облигации квазигосударственных организаций	KZT	АО «Банк Развития Казахстана»	5 950 000 000
Облигации БВУ	KZT	АО «Kaspi Bank»	59 098 367 900
Итого			142 010 303 900