

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

По состоянию на 1 июня 2024 года пенсионные активы, сформированные за счет обязательных пенсионных взносов работодателя (далее – ПА ОПВР), находящиеся в доверительном управлении НБРК, составили 76,96 млрд. тенге¹.

Средневзвешенная доходность к погашению (УТМ) долговых финансовых инструментов, находящихся в инвестиционном портфеле ПА ОПВР, составила 12,58% 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.	Доля на 01.01.2024г.	Текущая стоимость на 01.06.2024г.	Доля на 01.06.2024г.	Прирост/снижение с начала года
ГЦБ МФ РК	-	-	75,44	98,01%	100%
Депозиты НБРК	-	-	1,10	1,43%	100%
Денежные средства на инвестиционных счетах	-	-	0,43	0,55%	100%
Итого ПА ОПВР, находящиеся в управлении НБРК	-	-	76,96	100,00%	
<i>Деньги на счетах пенсионных взносов</i>			0,54		
Итого ПА ОПВР	-	-	77,50		

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 19,33 млрд. тенге и составила 75,44 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 98,01%.

В рассматриваемом периоде были приобретены ГЦБ Министерства финансов РК на сумму 19,84 млрд. тенге (24,50 млрд. тенге по номинальной стоимости) со средневзвешенной доходностью 12,57% годовых.

На отчетную дату средневзвешенная доходность к погашению по ГЦБ Министерства финансов РК составила 12,58% годовых.

Депозиты в Национальном Банке РК

Текущая стоимость депозитов в Национальном Банке РК на отчетную дату составила 1,10 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 1,43%.

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 3,36 млрд. тенге со средневзвешенной доходностью 13,75% годовых.

Результаты инвестиционной деятельности

Размер начисленного инвестиционного дохода по ПА ОПВР с начала управления составил -99,03 млн. тенге.

По состоянию на 1 июня 2024 доходность ПА ОПВР за период с начала управления составила 1,14%.

¹ без учета денег на счетах пенсионных взносов

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 июня 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)
1	Казахстанские финансовые инструменты:	0,00%	да
1.1	Государственные ценные бумаги Республики Казахстан, выпущенные Министерством финансов Республики Казахстан, Национальным Банком Республики Казахстан	98,01%	да
1.2	Депозиты Национального Банка Республики Казахстан	1,43%	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 «ВВВ-» 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 «ВВВ-» 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	24 500 000 000
Итого			24 500 000 000

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