

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

По состоянию на 1 апреля 2024 года пенсионные активы, сформированные за счет обязательных пенсионных взносов работодателя (далее – ПА ОПВР), находящиеся в доверительном управлении НБРК составили 36,70 млрд. тенге. Средневзвешенная доходность к погашению (YTM) долговых финансовых инструментов, находящихся в инвестиционном портфеле ПА ОПВР, составила 12,21% 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 01.04.2024г.	Доля на 01.04.2024г.	Прирост/снижение с начала года
	<i>млрд. тенге</i>				
ГЦБ МФ РК	-	-	27,35	74,50%	100%
Денежные средства на инвестиционных счетах	-	-	0,45	1,23%	100%
Депозиты НБРК	-	-	2,25	6,14%	100%
операции РЕПО	-	-	6,66	18,13%	100%
<b>Итого ПА ОПВР, находящиеся в управлении НБРК</b>	-	-	<b>36,70</b>	<b>100,00%</b>	
<i>Деньги на счетах пенсионных взносов</i>			0,77		
<b>Итого ПА ОПВР</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 13,97 млрд. тенге и составила 27,35 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 74,50%.

В рассматриваемом периоде были приобретены ГЦБ Министерства финансов РК на сумму 13,70 млрд. тенге (14,50 млрд. тенге по номинальной стоимости) со средневзвешенной доходностью 12,09% годовых.

На отчетную дату средневзвешенная доходность к погашению по ГЦБ Министерства финансов РК составила 12,08% годовых.

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

Текущая стоимость депозитов в Национальном Банке РК на отчетную дату составила 2,25 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 6,14%.

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 0,90 млрд. тенге со средневзвешенной доходностью 13,75% годовых.

### **Результаты инвестиционной деятельности**

Размер начисленного инвестиционного дохода по ПА ОПВР с начала 2024 года составил 333,62 млн. тенге. Доходность ПА ОПВР за период с начала 2024 года составила 1,37%.

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

Структурное распределение ПА ОПВР, находящихся в доверительном управлении НБРК, соответствует требованиям Инвестиционной декларации ЕНПФ<sup>1</sup>. Сведения о соблюдении лимитов инвестирования по ПА ОПВР по состоянию на 1 апреля 2024 года представлены в Таблице 4.

**Таблица 4. 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%	да
1.1	Государственные ценные бумаги Республики Казахстан, выпущенные Министерством финансов Республики Казахстан, Национальным Банком Республики Казахстан	74,50%	да
1.2	Депозиты Национального Банка Республики Казахстан	6,14%	да
1.3	Долговые ценные бумаги субъектов квазигосударственного сектора	0%	да
2	Зарубежные финансовые инструменты, в том числе инструменты, обращающиеся на зарубежных финансовых рынках:	0%	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%	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%	да

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

**Таблица 5. Сведения по приобретению финансовых инструментов в отчетном месяце**

Вид инструмента	Валюта	Эмитент ценной бумаги	Номинальная стоимость в тенге
ГЦБ РК	KZT	Правительство РК	14 503 516 000
<b>Итого</b>			<b>14 503 516 000</b>

<sup>1</sup> Инвестиционная декларация ЕНПФ утверждена постановлением Правления Национального Банка Республики Казахстан от 23 октября 2023 года №82