

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

По состоянию на 1 декабря 2024 года пенсионные активы, сформированные за счет обязательных пенсионных взносов работодателя (далее – ПА ОПВР), находящиеся в доверительном управлении НБРК, составили 218,29 млрд. тенге¹.

Средневзвешенная доходность к погашению (YTM) долговых финансовых инструментов, находящихся в инвестиционном портфеле ПА ОПВР, составила 12,52% 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 01.12.2024г. | Доля на 01.12.2024г. | Прирост/снижение с начала года |
|---|-----------------------------------|-----------------------------------|----------------------|--------------------------------|
| ГЦБ МФ РК | - | 170,67 | 78,18% | 100% |
| Депозиты НБРК | - | 9,21 | 4,22% | 100% |
| Денежные средства на инвестиционных счетах | - | 0,48 | 0,22% | 100% |
| Операции РЕПО | - | 37,94 | 17,38% | 100% |
| Итого ПА ОПВР, находящиеся в управлении НБРК | - | 218,29 | 100,00% | 100% |
| Деньги на счетах пенсионных взносов | - | 0,52 | | |
| Итого ПА ОПВР | - | 218,81 | | |

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 17,27 млрд. тенге и составила 170,67 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 78,18%.

В рассматриваемом периоде были приобретены ГЦБ Министерства финансов РК в объеме 20 млрд. тенге по номинальной стоимости со средневзвешенной доходностью 13,12% годовых. В отчетном периоде продаж и погашений ГЦБ Министерства финансов РК не было.

На отчетную дату средневзвешенная доходность к погашению по ГЦБ Министерства финансов РК составила 12,30% годовых.

Депозиты в Национальном Банке РК

Текущая стоимость депозитов в Национальном Банке РК на отчетную дату составила 9,21 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 4,22%.

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 9,68 млрд. тенге со средневзвешенной доходностью 13,25% годовых.

Результаты инвестиционной деятельности

Размер начисленного инвестиционного дохода по ПА ОПВР с начала управления составил 14,46 млрд. тенге.

По состоянию на 1 декабря 2024 года доходность ПА ОПВР за период с начала управления составила 12,00%.

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 декабря 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 | 0,22% | да |
| | Операции РЕПО | 17,38% | да |
| 1 | Казахстанские финансовые инструменты: | 82,40% | да |
| 1.1 | Государственные ценные бумаги Республики Казахстан, выпущенные Министерством финансов Республики Казахстан, Национальным Банком Республики Казахстан | 78,18% | да |
| 1.2 | Депозиты Национального Банка Республики Казахстан | 4,22% | 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 ЕНПФ

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 | 20 000 000 000 |
| Итого | | | 20 000 000 000 |

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