

Информация по инвестиционному управлению пенсионными активами АО «ЕНПФ»

По состоянию на 1 августа 2026 года пенсионные активы¹ (далее – ПА) ЕНПФ, находящиеся в доверительном управлении Национального Банка Республики Казахстан (далее – НБРК), составили 26 932,83 млрд. теңге².

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

млрд. теңге					
Наименование	Текущая стоимость на 01.01.2026г.	Доля на 01.01.2026г.	Текущая стоимость на 01.08.2026г.	Доля на 01.08.2026г.	Прирост/снижение с начала года
ГЦБ МФ РК	10 922,98	43,51%	11 715,41	43,50%	7,25%
ГЦБ иностранных государств	533,44	2,12%	442,01	1,64%	-17,14%
МФО	310,22	1,24%	261,43	0,97%	-15,73%
Корпоративные облигации эмитентов РК	10,17	0,04%	9,52	0,04%	-6,39%
Облигации квазигосударственных организаций РК	2 372,47	9,45%	2 155,52	8,00%	-9,14%
Облигации БВУ РК	623,47	2,48%	683,31	2,54%	9,60%
PPN (структурные ноты)	8,71	0,03%	8,41	0,03%	-3,47%
Акции и депозитарные расписки эмитентов РК	484,58	1,93%	523,76	1,94%	8,08%
Депозиты НБРК	1 116,71	4,45%	1 005,50	3,73%	-9,96%
Ноты НБРК	-	0,00%	-	0,00%	#ДЕЛ/0!
Денежные средства на инвестиционных счетах	19,39	0,08%	16,64	0,06%	-14,18%
Иностранные корпоративные облигации	-	0,00%	4,69	0,02%	
Прочие активы (дебиторская задолженность)		0,00%	15,56	0,06%	
Индексное управление активами, в том числе:	9 376,95	37,35%	10 091,07	37,47%	7,62%
активы развитых стран	2 653,22	10,57%	2 413,51	8,96%	-9,03%
активы развивающихся стран	1 471,37	5,86%	1 370,97	5,09%	-6,82%
активы, находящиеся во внешнем управлении	5 252,36	20,92%	6 306,59	23,42%	20,07%
по мандату облигаций развивающихся стран:					
Aviva Investors Global Services Limited	283,57	1,13%	341,08	1,27%	20,28%
TCW Asset Management Company LLC	195,41	0,78%	329,09	1,22%	68,41%
PIMCO Asia Pte Ltd	242,63	0,97%	303,59	1,13%	25,13%
по мандату глобальных акций:					
Invesco Asset Management Deutschland GmbH	412,13	1,64%	490,69	1,82%	19,06%
HSBC Global Asset Management (UK) Limited	637,31	2,54%	654,06	2,43%	2,63%
UBS Asset Management (UK) Ltd	501,65	2,00%	518,99	1,93%	3,46%
Blackrock Financial Management	458,72	1,83%	483,48	1,80%	5,40%
BlackRock Investment Management	263,69	1,05%	273,73	1,02%	3,81%
Robeco Institutional Asset Management B.V.	422,11	1,68%	508,75	1,89%	20,53%
Macquarie Asset Management	-	0,00%	288,05	1,07%	100,00%
по мандату корпоративных облигаций инвестиционного уровня:					
Principal Global Investors (Europe) Limited	627,94	2,50%	593,99	2,21%	-5,41%
PGIM Limited	638,26	2,54%	650,54	2,42%	1,92%
PIMCO Asia Pte Ltd	568,94	2,27%	633,51	2,35%	11,35%
по мандату альтернативные инструменты					
National Investment Corporation of the NBK	-	-	237,04	0,88%	100,00%
Итого ПА, находящиеся в управлении НБРК	25 103,96*	100,00%	26 932,83	100,00%	7,29%

* - с учетом обязательств к оплате по совершенным сделкам на сумму 675,12 млрд. теңге

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 01.08.2026г. средневзвешенная доходность к погашению (YTM) долговых финансовых инструментов, находящихся в инвестиционном портфеле ПА ЕНПФ, составила 12,10% годовых, в том числе по номинированным в тенге – 14,02% годовых, в иностранной валюте – 4,91% 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 11 715,41 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 43,50%.

В рассматриваемом периоде были приобретены ГЦБ Министерства финансов РК на сумму 76,00 млрд. тенге по номинальной стоимости с доходностью 14,25% годовых. В отчетном месяце было осуществлено погашение ГЦБ Министерства финансов РК на сумму 37,64 млрд. тенге, а также реализованы часть ГЦБ Министерства финансов РК на общую сумму 16,50 млрд. тенге.

На отчетную дату средневзвешенная доходность к погашению по ГЦБ Министерства финансов РК составила 13,95% годовых.

Государственные ценные бумаги иностранных государств в субпортфеле ликвидности

Текущая стоимость ГЦБ иностранных государств в субпортфеле ликвидности за отчетный месяц увеличилась на 332,82 млрд. тенге и составила 442,01 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 1,64%.

В рассматриваемом периоде были приобретены ГЦБ США на сумму 339,36 млрд. тенге по номинальной стоимости с доходностью 3,85% годовых. В отчетном месяце продаж и погашений ГЦБ иностранных государств не осуществлялось.

Облигации международных финансовых организаций

Текущая стоимость облигаций международных финансовых организаций за отчетный месяц увеличилась на 1,13 млрд. тенге и составила 261,43 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 0,97%.

В отчетном месяце покупок, погашений и продаж ценных бумаг международных финансовых организаций не было.

Средневзвешенная доходность к погашению по облигациям международных финансовых организаций, номинированным в тенге, с фиксированной ставкой вознаграждения составила 15,56% 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 1 005,50 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 3,73%.

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 330,77 млрд. тенге со средневзвешенной доходностью 16,41% годовых.

Корпоративные облигации эмитентов Республики Казахстан

Текущая стоимость корпоративных облигаций эмитентов РК составила 9,52 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 0,04%.

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

Корпоративные облигации иностранных государств

В рассматриваемом периоде были приобретены облигации JPMorgan Chase Bank, N.A номинированные в тенге в объеме 4,76 млрд. тенге с доходностью 15,60% годовых.

Облигации квазигосударственных организаций Республики Казахстан

Текущая стоимость облигаций квазигосударственных организаций РК за отчетный месяц увеличилась на 46,70 млрд. тенге и составила 2 155,52 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 8,00%.

В отчетном периоде были приобретены облигации АО «Национальный инвестиционный холдинг «Байтерек» в объеме 30,00 млрд. тенге с доходностью 15,90% годовых, а также облигации АО «Фонд национального благосостояния «Самрук-Қазына» в объеме 102,11 млрд. тенге с плавающей ставкой (TONIA Compounded Index + 1,00%).

В рассматриваемом периоде было осуществлено погашение облигаций АО «Казахтелеком» в объеме 38,22 млрд. тенге, а также погашение облигаций АО «Национальный инвестиционный холдинг «Байтерек» в объеме 50,00 млрд. тенге.

На отчетную дату средневзвешенная доходность к погашению по облигациям квазигосударственных организаций РК, номинированным в тенге, составила 12,74% годовых.

Облигации банков второго уровня Республики Казахстан

Текущая стоимость облигаций БВУ РК за отчетный месяц уменьшилась на 5,02 млрд. тенге и составила 683,31 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 2,54%.

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

На отчетную дату средневзвешенная доходность к погашению по облигациям БВУ РК составила 15,76% годовых.

PPN (структурные ноты) иностранных эмитентов

Текущая стоимость PPN (структурных нот) иностранных эмитентов в отчетном месяце составила 8,41 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 0,03%.

В рассматриваемом периоде 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 уменьшилась на 30,30 млрд. тенге и составила 523,76 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 1,94%.

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 2026 года представлена в Таблице 2.

Таблица 2. Стратегическое распределение валютного портфеля ПА ЕНПФ на 01.08.2026г.

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	15% (-5%/+10%)	5 096,20	2 413,508	22,03%	8,96%
Облигации развивающихся стран	25% (±10%)	4 950,99	2 344,737	21,40%	8,71%
Корпоративные облигации	20% (±10%)	3 965,54	1 878,040	17,14%	6,97%
Акции	30% (±10%)	6 794,38	3 217,752	29,37%	11,95%
Ликвидность	0% (+10%)	1 826,61	865,06	7,90%	3,21%
Альтернативные инструменты	10% (-10%/+5%)	500,51	237,04	2,16%	0,88%
Итого валютный портфель		23 134,23	10 956,14	100,00%	40,68%

Субпортфель облигаций развитых стран

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 2026 года входит 202 выпусков облигаций.

Динамика индекса Custom Index (G502) за последние 12 месяцев



Субпортфель облигаций развивающихся стран

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 2026 года входит 493 выпуска облигаций, номинированных в долларах США, выпущенных 32 развивающимися странами.

Динамика индекса Custom Index (Q979) за последние 12 месяцев



Субпортфель корпоративных облигаций

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 «BBB-». В состав данного индекса на 1 августа 2026 года входит 8 275 выпуска облигаций, выпущенных 1 411 эмитентами.

Динамика индекса Custom Index (Q980) за последние 12 месяцев



Субпортфель акций

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 2026 года входит 1 231 акций 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 компаний из таких стран, как Япония, Великобритания, Франция, Канада и другие.

Динамика индекса Custom MSCI World Index за последние 12 месяцев



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 ПА ЕНПФ на уровне 40% для диверсификации инвестиционного портфеля было приобретено 374,55 млн. долларов США на Казахстанской фондовой бирже.

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

млрд. тенге

Валюта	Текущая стоимость на 01.01.2026г.	Доля на 01.01.2026г.	Текущая стоимость на 01.08.2026г.	Доля на 01.08.2026г.	Прирост/снижение с начала года
Национальная валюта	14 820,73	59,04%	15 976,69	59,32%	7,80%
Доллары США	10 282,31	40,96%	10 955,26	40,68%	6,54%
Российские рубли	0,24	0,00%	0,22	0,00%	-6,86%
Другая валюта	0,69	0,00%	0,66	0,00%	-4,66%
Итого	25 103,96	100,00%	26 932,83	100,00%	7,29%

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 2026 года составил 1,15 трлн. тенге. Доходность пенсионных активов ЕНПФ, распределенная на счета вкладчиков (получателей) с начала 2026 года, составила 4,39%.

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 более длительный период времени.

Размер начисленного инвестиционного дохода за последние 12 месяцев с августа 2025 года по июль 2026 года составил порядка 1,81 трлн. тенге, доходность за данный период составила 7,13%.

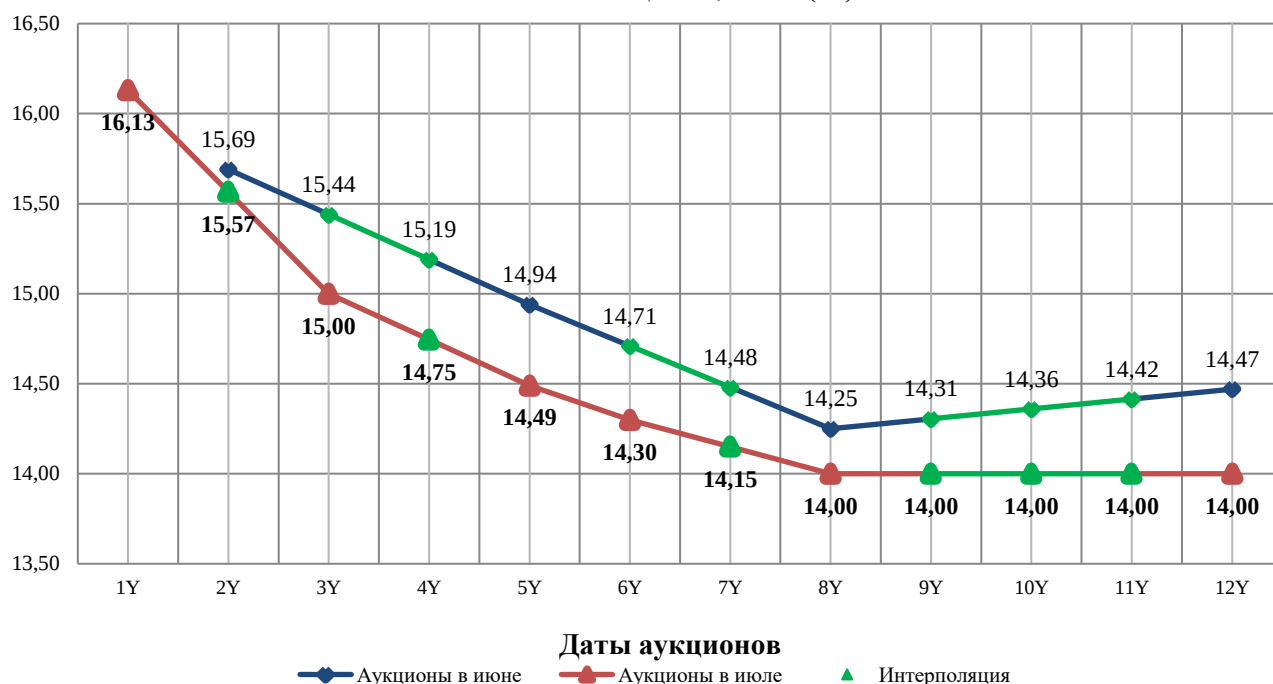
В июле 2026 года на финансовых рынках наблюдалась повышенная волатильность на фоне эскалации конфликта США и Израиля с Ираном и повышения цен на энергоносители.

Инфляция в США в июле составила 3,4% годовых (3,5% в июне), а ее месячный прирост ускорился до 0,1% после (-)0,4% месяцем ранее. Показатель числа новых рабочих мест в несельскохозяйственном секторе в июле снизился на 23 тысячи после роста на 57 тысяч в июне, при этом уровень безработицы снизился с 4,2% до 4,1%. На фоне сохранения ФРС базовой ставки на июльском заседании и усиления геополитических рисков рыночные ожидания сместились в сторону возможного повышения ставки до конца 2026 года.

В результате доходность эталонных 10-летних казначейских облигаций США в июле выросла на 27 б.п. и составила 4,73%. Спреды по облигациям развивающихся стран расширились на 5 б.п., спреды по корпоративным облигациям - на 4 б.п. Вместе с тем индекс акций MSCI World вырос на 0,5%.

На аукционах по размещению ГЦБ РК в июле доходности снизились вдоль всей кривой на фоне сильного спроса и решения о снижении базовой ставки на 25 б.п. до 16,75%. Инфляция замедлилась до 10,2% годовых (10,3% в июне), при этом в месячном выражении рост составил 0,6% за июль (0,8% в июне). На аукционах по размещению ГЦБ РК наблюдался повышенный спрос, который в 2,9 раз превысил предложение, при этом основной спрос был сосредоточен в среднесрочных размещениях. Объем заимствования МФ РК в июле значительно вырос и составил 761 млрд тенге.

ГЦБ РК, УТМ (%)



Структура начисленного инвестиционного дохода с начала 2026 года представлена в Таблице 4.

Таблица 4. Структура инвестиционного дохода, полученного по ПА ЕНПФ, находящимся в доверительном управлении НБРК по состоянию на 01.08.2026г.

млрд. тенге

Наименование	Инвестиционный доход за 2026 год
Доходы в виде вознаграждения по ценным бумагам, в том числе по размещенным вкладам и операциям «обратное РЕПО»	1 319,76
Доходы (убытки) от рыночной переоценки ценных бумаг	81,89
Доходы (убытки) от переоценки иностранной валюты, за исключением активов во внешнем управлении	-294,47
Доходы (убытки) по активам, находящимся во внешнем управлении, в том числе с учетом курсовой переоценки	40,95
Прочие доходы (убытки)	3,73
Итого:	1151,86

Информация о стоимости условной единицы

Динамика стоимости условной единицы ПА ЕНПФ, находящихся в доверительном управлении НБРК, за июль 2026 года представлена в Таблице 5.

Таблица 5. Стоимость одной условной единицы ПА ЕНПФ, находящихся в доверительном управлении НБРК

№	Дата	Стоимость одной условной единицы
1	01.07.2026	1 519,0566964
2	02.07.2026	1 519,0566964
3	03.07.2026	1 519,0566964
4	04.07.2026	1 519,0566964
5	05.07.2026	1 519,0566964
6	06.07.2026	1 519,0566964
7	07.07.2026	1 512,7676149
8	08.07.2026	1 512,7676149
9	09.07.2026	1 512,7676149
10	10.07.2026	1 512,7676149
11	11.07.2026	1 512,7676149
12	12.07.2026	1 512,7676149
13	13.07.2026	1 522,7376241
14	14.07.2026	1 522,7376241
15	15.07.2026	1 522,7376241
16	16.07.2026	1 522,7376241
17	17.07.2026	1 522,7376241
18	18.07.2026	1 522,7376241
19	19.07.2026	1 522,7376241
20	20.07.2026	1 515,6409766
21	21.07.2026	1 515,6409766
22	22.07.2026	1 515,6409766
23	23.07.2026	1 515,6409766
24	24.07.2026	1 515,6409766
25	25.07.2026	1 515,6409766
26	26.07.2026	1 515,6409766
27	27.07.2026	1 520,3589957
28	28.07.2026	1 520,3589957
29	29.07.2026	1 520,3589957
30	30.07.2026	1 520,3589957
31	31.07.2026	1 521,6431687

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 2026 года представлены в Таблице 6.

Таблица 6. Лимиты инвестирования по ПА ЕНПФ

№	Вид финансового инструмента	Фактическое значение, в млрд. тенге	Фактическое значение (в процентах от общего объема ПА)	Лимиты (в процентах от общего объема ПА)	Выполнение (да/нет)
	Денежные средства KZT	0,10	0,00%	Не более 3%	да
	Денежные средства в иностранной валюте	21,41	0,08%	Не более 5%	да
1	Казахстанские финансовые инструменты:	16 084,06	59,72 %		
1.1	Государственные ценные бумаги Республики Казахстан, выпущенные Министерством финансов Республики Казахстан, Национальным Банком Республики Казахстан	11 715,41	43,50%	Не менее 20%	да

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

1.1.1	Государственные ценные бумаги Республики Казахстан, выпущенные местными исполнительными органами Республики Казахстан	-	0,00%	Не более 5%	да
1.2	Депозиты Национального Банка Республики Казахстан	1 005,50	3,73%	Не более 10%	да
1.3	Ценные бумаги субъектов квазигосударственного сектора	2 592,65	9,63%	Не более 25%	да
1.4	Финансовые инструменты банков второго уровня Республики Казахстан, имеющие рейтинговую оценку ценной бумаги и/или эмитента не ниже «B+» по международной шкале агентства «Standard & Poor's» или рейтинговой оценкой аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, в том числе:	708,70	2,63%	Не более 30%	да
1)	долговые ценные бумаги, за исключением субординированных долговых ценных бумаг	674,81	2,51%	Не более 30%	да
2)	долевые ценные бумаги	33,90	0,13%	Не более 5%	да
3)	депозиты	-	0,00%	Не более 15%	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 «B+» по международной шкале агентства «Standard & Poor's» или рейтинговой оценкой аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств	-	0,00%	Не более 20%	да
1.5.1	Негосударственные долговые ценные бумаги, выпущенные под гарантию и/или поручительство Правительства Республики Казахстан	-	0,00%	Не более 5%	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	61,80	0,23%	Не более 5%	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%	Не более 10%	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%	Не более 5%	да
2	Зарубежные финансовые инструменты, в том числе инструменты, обращающиеся на зарубежных финансовых рынках:	10 686,15	39,68%	Не более 50%	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	5 301,86	19,69%	Не более 30%	да
2.2.	Муниципальные ценные бумаги в рамках инвестирования в государственные и агентские ценные бумаги	0,00	0,00%	Не более 10%	да
2.3	Корпоративные долговые ценные бумаги имеющие рейтинговую оценку ценной бумаги и/или эмитента не ниже «BB-» по	1 938,45	7,20%	Не более 20%	да

	международной шкале агентства «Standard & Poor's» или рейтинговой оценкой аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств				
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	0,00%	Не более 10%	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 рейтинговой оценкой аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств	0,00	0,00%	Не более 10%	да
2.6	Акции, депозитарные расписки на акции	3 200,39	11,88%	Не более 20%	да
2.7	Депозиты (вклады) с контраптерами, 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%	Не более 20%	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	8,41	0,03%	Не более 5%	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	70,11	0,26%	Не более 2%	да
2.10	Альтернативные инструменты, в том числе акции и (или) доли компаний специального назначения (special purpose vehicle).	237,04	0,88%	Не более 5%	да

№	Вид финансового инструмента	Фактическое значение, в млрд. тенге	Фактическое значение (в процентах от общего объема ПА)	Лимиты (в процентах от общего объема ПА)	Выполнение (да/нет)
1	Производные финансовые инструменты, из них:	0,00	0,00%	не более 10%	да
1.1	Производные финансовые инструменты, используемые в целях хеджирования инвестиционного риска	0,00	0,00%	не более 10%	да
1.2	Производные финансовые инструменты, используемые в целях инвестирования	0,00	0,00%	не более 10%	да
1.3	Золото в слитках и на металлических счетах	0,00	0,00%	не более 10%	да

Таблица 7. 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	22,03%	-	-		да
Облигации развивающихся стран	21,40%	41,53%	-		да
Корпоративные облигации	17,14%	100%	-		да
Акции	29,37%	100%	Пассивное управление, в том числе:	53,91%	да
			ESG	8,37%	да
			quality	8,19%	да
			min.vol	3,29%	да

			<i>classic</i>	34,06%	да
			Активное управление	46,09%	да
Ликвидность	7,90%	-	-	-	
Альтернативные инструменты	2,16%	100%			
Итого валютный портфель	100%				

Информация по покупкам, продажам и погашениям финансовых инструментов, находящихся в инвестиционном портфеле ПА ЕНПФ

Таблица 8. Сведения по приобретению финансовых инструментов в отчетном месяце

Вид инструмента	Валюта	Эмитент ценной бумаги	Номинальная стоимость в тенге
ГЦБ РК	KZT	Правительство РК	76 000 000 000,00
Облигации квазигосударственных организаций РК	KZT	АО "ФНБ "Самрук-Казына"	102 110 000 000,00
Облигации квазигосударственных организаций РК	KZT	АО "НУХ "Байтерек"	30 000 000 000,00
ГЦБ США	USD	Правительство США	339 357 530 000,00
Иностранные корпоративные облигации	KZT	JPMorgan Chase Bank, National Association	4 755 000 000,00
Итого			552 222 530 000,00

Таблица 9. Сведения по погашениям основного долга по ценным бумагам в отчетном месяце

Вид инструмента	Валюта	Эмитент ценной бумаги	Сумма к погашению в тенге
Облигации квазигосударственных организаций РК	KZT	АО «Национальный инвестиционный холдинг «Байтерек»	50 000 000 000,00
Облигации квазигосударственных организаций РК	KZT	АО «Казактелеком»	38 222 223 000,00
ГЦБ РК	KZT	Правительство РК	37 642 437 000,00
Итого			125 864 660 000,00

Таблица 10. Сведения по продаже финансовых инструментов в отчетном месяце

Вид инструмента	Валюта	Эмитент ценной бумаги	Сумма сделки в тенге
ГЦБ РК	KZT	Правительство РК	16 502 088 281,42
Итого			16 502 088 281,42