

Информация по инвестиционному управлению пенсионными активами АО «ЕНПФ»

По состоянию на 1 февраля 2026 года пенсионные активы¹ (далее – ПА) ЕНПФ, находящиеся в доверительном управлении Национального Банка Республики Казахстан (далее – НБРК), составили 25 435,96 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	Текущая стоимость на 01.01.2026г.	Доля на 01.01.2026г.	Текущая стоимость на 01.02.2026г.	Доля на 01.02.2026г.	Прирост/снижение с начала года
ГЦБ МФ РК	10 922,98	43,51%	10 916,21	42,92%	-0,06%
ГЦБ иностранных государств	533,44	2,12%	532,72	2,09%	-0,13%
МФО	310,22	1,24%	312,08	1,23%	0,60%
Корпоративные облигации эмитентов РК	10,17	0,04%	10,47	0,04%	2,88%
Облигации квазигосударственных организаций РК	2 372,47	9,45%	2 379,96	9,36%	0,32%
Облигации БВУ РК	623,47	2,48%	631,59	2,48%	1,30%
PPN (структурные ноты)	8,71	0,03%	8,67	0,03%	-0,46%
Акции и депозитарные расписки эмитентов РК	484,58	1,93%	605,96	2,38%	25,05%
Депозиты НБРК	1 116,71	4,45%	642,76	2,53%	-42,44%
Денежные средства на инвестиционных счетах	19,39	0,08%	16,80	0,07%	-13,33%
Операции РЕПО	-	0,00%	130,71	0,51%	100,00%
Индексное управление активами, в том числе:	9 376,95	37,35%	9 318,13	36,63%	-0,63%
активы развитых стран	2 653,22	10,57%	2 626,80	10,33%	-1,00%
активы развивающихся стран	1 471,37	5,86%	1 459,17	5,74%	-0,83%
активы, находящиеся во внешнем управлении	5 252,36	20,92%	5 232,16	20,57%	-0,38%
по мандату облигаций развивающихся стран:					
Aviva Investors Global Services Limited	283,57	1,13%	281,17	1,11%	-0,85%
TCW Asset Management Company LLC	195,41	0,78%	194,05	0,76%	-0,70%
PIMCO Asia Pte Ltd	242,63	0,97%	241,04	0,95%	-0,65%
по мандату глобальных акций:					
Invesco Asset Management Deutschland GmbH	412,13	1,64%	414,64	1,63%	0,61%
HSBC Global Asset Management (UK) Limited	637,31	2,54%	637,12	2,50%	-0,03%
UBS Asset Management (UK) Ltd	501,65	2,00%	500,69	1,97%	-0,19%
Blackrock Financial Management	458,72	1,83%	460,22	1,81%	0,33%
BlackRock Investment Management	263,69	1,05%	263,41	1,04%	-0,10%
Robeco Institutional Asset Management B.V.	422,11	1,68%	424,86	1,67%	0,65%
по мандату корпоративных облигаций инвестиционного уровня:					
Principal Global Investors (Europe) Limited	627,94	2,50%	621,18	2,44%	-1,08%
PGIM Limited	638,26	2,54%	631,07	2,48%	-1,13%
PIMCO Asia Pte Ltd	568,94	2,27%	562,70	2,21%	-1,10%
Итого ПА, находящиеся в управлении НБРК	25 103,96*	100,00%	25 435,96**	100,00%	1,32%

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

** - с учетом обязательств к оплате по совершенным сделкам на сумму 70,10 млрд. тенге

По состоянию на 01.02.2026г. средневзвешенная доходность к погашению (УТМ) долговых финансовых инструментов, находящихся в инвестиционном портфеле ПА ЕНПФ,

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

составила 11,89% годовых, в том числе по номинированным в тенге – 14,17% годовых, в иностранной валюте – 4,47% 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 10 916,21 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 42,92%.

В рассматриваемом периоде были приобретены ГЦБ Министерства финансов РК на сумму 60,00 млрд. тенге по номинальной стоимости с доходностью 15,60% годовых, а также осуществлено погашение ГЦБ Министерства финансов РК в объеме 100,00 млрд. тенге. В отчетном месяце продаж ГЦБ Министерства финансов РК не было.

На отчетную дату средневзвешенная доходность к погашению по ГЦБ Министерства финансов РК составила 14,20% годовых.

Государственные ценные бумаги иностранных государств в субпортфеле ликвидности

Текущая стоимость ГЦБ иностранных государств в субпортфеле ликвидности за отчетный месяц уменьшилась на 0,72 млрд. тенге и составила 532,72 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 2,09%.

В рассматриваемом периоде были приобретены ГЦБ США в объеме 298,43 млрд. тенге по номинальной стоимости со средневзвешенной доходностью 3,64% годовых. В отчетном месяце осуществлено погашение ГЦБ США в объеме 293,77 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 3,94% годовых.

Облигации международных финансовых организаций

Текущая стоимость облигаций международных финансовых организаций за отчетный месяц увеличилась на 1,86 млрд. тенге и составила 312,08 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 1,23%.

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 15,83% 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 642,76 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 2,53%.

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 421,32 млрд. тенге со средневзвешенной доходностью 17,18% годовых.

Корпоративные облигации эмитентов Республики Казахстан

Текущая стоимость корпоративных облигаций эмитентов РК составила 10,47 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 0,04%.

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 7,49 млрд. тенге и составила 2 379,96 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 9,36%.

В отчетном месяце покупок, продаж и погашений ценных бумаг квазигосударственных организаций РК не было.

На отчетную дату средневзвешенная доходность к погашению по облигациям квазигосударственных организаций РК, номинированным в тенге, составила 12,16% годовых, в долларах США – 5,41% годовых.

Облигации банков второго уровня Республики Казахстан

Текущая стоимость облигаций БВУ РК за отчетный месяц увеличилась на 8,12 млрд. тенге и составила 631,59 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 2,48%.

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

На отчетную дату средневзвешенная доходность к погашению по облигациям БВУ РК составила 16,21% годовых.

PPN (структурные ноты) иностранных эмитентов

Текущая стоимость PPN (структурных нот) иностранных эмитентов в отчетном месяце составила 8,67 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 0,03%.

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 121,38 млрд. тенге и составила 605,96 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 2,38%.

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 февраля 2026 года представлена в Таблице 2.

Таблица 2. Стратегическое распределение валютного портфеля ПА ЕНПФ на 01.02.2026г.

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	25% (±10%)	5 242,91	2 626,80	25,39%	10,33%
Облигации развивающихся стран	25% (±10%)	4 342,00	2 175,43	21,03%	8,55%
Корпоративные облигации	20% (±10%)	3 622,52	1 814,95	17,55%	7,14%

Акции	30% ($\pm 10\%$)	5 390,90	2 700,95	26,11%	10,62%
Ликвидность	0% (+10%)	2 047,33	1 025,75	9,92%	4,03%
Итого валютный портфель		20 645,64	10 343,88	100,00%	40,67%

Субпортфель облигаций развитых стран

Текущая стоимость субпортфеля облигаций развитых стран за отчетный месяц уменьшилась на 26,42 млрд. тенге и составила 2 626,80 млрд. тенге. Доля субпортфеля облигаций развитых стран в портфеле ПА ЕНПФ составила 10,33%.

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 февраля 2026 года входит 200 выпусков облигаций.

Субпортфель облигаций развивающихся стран

Текущая стоимость субпортфеля облигаций развивающихся стран за отчетный месяц уменьшилась на 17,54 млрд. тенге и составила 2 175,43 млрд. тенге. Доля субпортфеля облигаций развивающихся стран в портфеле ПА ЕНПФ составила 8,55%.

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 февраля 2026 года входит 488 выпусков облигаций, номинированных в долларах США, выпущенных 32 эмитентами.

Субпортфель корпоративных облигаций

Текущая стоимость субпортфеля корпоративных облигаций за отчетный месяц уменьшилась на 20,19 млрд. тенге и составила 1 814,95 млрд. тенге. Доля субпортфеля корпоративных облигаций в портфеле ПА ЕНПФ составила 7,14%.

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 февраля 2026 года входит 8 013 выпусков облигаций, выпущенных 1 379 эмитентами.

Субпортфель акций

Текущая стоимость субпортфеля акций за отчетный месяц увеличилась на 5,33 млрд. тенге и составила 2 700,95 млрд. тенге. Доля субпортфеля акций в портфеле ПА ЕНПФ составила 10,62%.

Эталонным портфелем для субпортфеля акций является индекс Custom MSCI World Index, состоящий из акций компаний развитых стран мира. В состав данного индекса на 1 февраля 2026 года входит 1 278 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.

Валютная структура

Инвестиционный портфель финансовых инструментов в разрезе валют, в которых номинированы финансовые инструменты, приобретенные за счет пенсионных активов ЕНПФ, представлен в Таблице 3.

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 01.02.2026г.	Доля на 01.02.2026г.	Прирост/снижение с начала года
Национальная валюта	14 820,73	59,04%	15 092,08	59,33%	1,83%
Доллары США	10 282,31	40,96%	10 342,93	40,66%	0,59%
Другие валюты	0,93	0,00%	0,95	0,00%	2,20%
Итого:	25 103,96	100,00%	25 435,96	100,00%	1,32%

Результаты инвестиционной деятельности

В результате инвестиционной деятельности, а также вследствие волатильности курсов иностранных валют и изменения рыночной стоимости финансовых инструментов, размер начисленного инвестиционного дохода за январь 2026 года составил 223,18 млрд. тенге. Доходность пенсионных активов ЕНПФ, распределенная на счета вкладчиков (получателей) за январь 2026 года составила 0,87%.

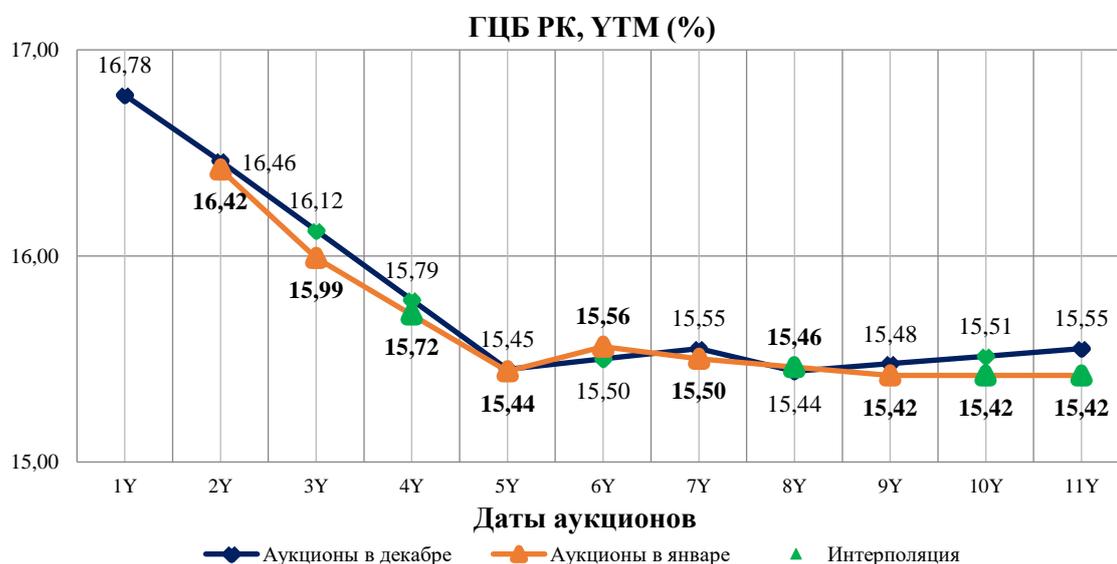
Важно отметить, что доходность пенсионных активов за отдельные краткосрочные периоды времени не является показателем эффективности их управления, поскольку доходы в виде вознаграждения по финансовым инструментам и другим операциям, начисленные за короткий промежуток времени, не всегда покрывают колебания 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 февраля 2025 года по январь 2026 года составил порядка 2,28 трлн. тенге, доходность за данный период составила 9,74%.

В январе 2026 года на финансовых рынках наблюдалась умеренная волатильность на фоне сохранения базовой ставки ФРС на текущем уровне. Инфляция за январь составила 2,4% годовых (2,7% в декабре), а ее месячный прирост составил 0,2% (0,3% в декабре). Рост числа новых созданных рабочих мест в несельскохозяйственном секторе в январе составил 130 тысяч рабочих мест (в декабре 48 тысяч), в то время как уровень безработицы снизился с 4,4% в декабре до 4,3% в январе. В 2026 году рынок ожидает 2 снижения базовой ставки ФРС.

В результате доходность эталонных 10-летних казначейских облигаций США в январе выросла на 7 б.п. и составила 4,24%. Спреды по облигациям развивающихся стран и корпоративным облигациям сузились на 10 б.п. и 5 б.п. соответственно. Вместе с тем индекс акций MSCI World вырос на 2,3%.

На аукционах по размещению ГЦБ РК в январе доходности сохранялись примерно на уровне декабря по всей кривой доходности на фоне решения НБРК о сохранении базовой ставки на уровне 18%. Инфляция замедлилась до 12,2% годовых (12,3% в декабре), при этом в месячном выражении рост составил 1,0% за январь (0,9% в декабре). На аукционах по



размещению ГЦБ РК наблюдался высокий спрос, который в 2,3 раза превысил предложение. При этом основной спрос был сосредоточен в среднесрочных размещениях. Объем заимствования МФРК в январе увеличился по сравнению с декабрем и составил 448 млрд. тенге.

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 01.02.2026г.

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»	179,5
Доходы (убытки) от рыночной переоценки ценных бумаг	105,48
Доходы (убытки) от переоценки иностранной валюты, за исключением активов во внешнем управлении	-41,74
Доходы (убытки) по активам, находящимся во внешнем управлении, в том числе с учетом курсовой переоценки	-20,2
Прочие доходы (убытки)	0,14
Итого:	223,18

Информация о стоимости условной единицы

Динамика стоимости условной единицы ПА ЕНПФ, находящихся в доверительном управлении НБРК, за январь 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	01.01.2026	1 457,6431797
2	02.01.2026	1 457,6431797
3	03.01.2026	1 457,6431797
4	04.01.2026	1 457,6431797
5	05.01.2026	1 466,3680232
6	06.01.2026	1 466,3680232
7	07.01.2026	1 466,3680232
8	08.01.2026	1 466,3680232
9	09.01.2026	1 466,3680232
10	10.01.2026	1 466,3680232
11	11.01.2026	1 466,3680232
12	12.01.2026	1 470,2069671
13	13.01.2026	1 470,2069671
14	14.01.2026	1 470,2069671
15	15.01.2026	1 470,2069671
16	16.01.2026	1 470,2069671
17	17.01.2026	1 470,2069671
18	18.01.2026	1 470,2069671
19	19.01.2026	1 474,2593550
20	20.01.2026	1 474,2593550
21	21.01.2026	1 474,2593550
22	22.01.2026	1 474,2593550
23	23.01.2026	1 474,2593550
24	24.01.2026	1 474,2593550
25	25.01.2026	1 474,2593550
26	26.01.2026	1 469,8525709
27	27.01.2026	1 469,8525709
28	28.01.2026	1 469,8525709
29	29.01.2026	1 469,8525709
30	30.01.2026	1 469,8525709
31	31.01.2026	1 470,3089068

Информация о соблюдении параметров инвестиционной декларации

Структурное распределение ПА ЕНПФ, находящихся в доверительном управлении, соответствует требованиям Инвестиционной декларации ЕНПФЗ. 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 февраля 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	30,01	0,12%	не более 5%	да
1	Казахстанские финансовые инструменты:	15 164,02	59,62%		да
1.1	Государственные ценные бумаги Республики Казахстан, выпущенные Министерством финансов Республики Казахстан, Национальным Банком Республики Казахстан	10 916,21	42,92%	не менее 20% не более 70%	да
1.1.1	Государственные ценные бумаги Республики Казахстан, выпущенные местными исполнительными органами Республики Казахстан	0,00	0,00%	не более 5%	да
1.2	Депозиты Национального Банка Республики Казахстан	642,76	2,53%	не более 5%	да
1.3	Ценные бумаги субъектов квазигосударственного сектора	2 881,66	11,33%	не более 25%	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:	655,86	2,58%	не более 30%	да
1)	долговые ценные бумаги, за исключением субординированных долговых ценных бумаг	622,47	2,45%	не более 30%	да
2)	долевые ценные бумаги	33,38	0,13%	не более 5%	да
3)	депозиты	0,00	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 «В-» по международной шкале агентства «Standard & Poor's» или рейтинговой оценкой аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств	0,00	0,00%	не более 20%	да
1.5.1	Негосударственные долговые ценные бумаги, выпущенные под гарантию и/или поручительство Правительства Республики Казахстан	0,00	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 «Премиум» 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	67,53	0,27%	не более 5%	да

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

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	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	0,00%	не более 5%	да
2	Зарубежные финансовые инструменты, в том числе инструменты, обращающиеся на зарубежных финансовых рынках:	10 028,09	39,42%	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	5 462,93	21,48%	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 международной шкале агентства «Standard & Poor's» или рейтинговой оценкой аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств	1 872,31	7,36%	не более 20%	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	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	2 684,19	10,55%	не более 20%	да
2.7	Депозиты (вклады) с контраптерами, имеющих рейтинговую оценку не ниже «A-» по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинговую оценку аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств	0,00	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	8,67	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	86,42	0,34%	не более 2%	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	25,39%	-	-		да
Облигации развивающихся стран	21,03%	32,92%	-		да
Корпоративные облигации	17,55%	100%	-		да
Акции	26,11%	100%	Пассивное управление, в том числе:	51,88%	да
			<i>ESG</i>	9,57%	да
			<i>quality</i>	9,44%	да
			<i>min.vol</i>	4,11%	да
			<i>classic</i>	28,77%	да
			Активное управление	48,12%	да
Ликвидность	9,92%	-	-		да
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	60 000 000 000
ГЦБ иностранных государств	USD	Правительство США	298 425 800 000
Итого			358 425 800 000

Таблица 9. 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	100 000 000 000
ГЦБ иностранных государств	USD	Правительство США	293 770 410 000
Итого			393 770 410 000