

**Информация по инвестиционному управлению
пенсионными активами АО «ЕНПФ»
в доверительном управлении АО «Сентрас Секьюритиз»**

По состоянию на 1 августа 2021 года пенсионные активы (далее – ПА) ЕНПФ, находящиеся в доверительном управлении АО «Сентрас Секьюритиз» (далее – Сентрас Секьюритиз), составили 477,35 млн. тенге.

Структура инвестиционного портфеля финансовых инструментов, сформированного за счет пенсионных активов ЕНПФ, находящихся в доверительном управлении Сентрас Секьюритиз, представлена в Таблице 1.

Таблица 1. Структура инвестиционного портфеля ПА ЕНПФ, находящихся в доверительном управлении Сентрас Секьюритиз, в разрезе финансовых инструментов

млн. тенге

Наименование	Текущая стоимость на 01.05.2021 г.	Доля на 01.05.2021 г.	Текущая стоимость на 01.08.2021 г.	Доля на 01.08.2021 г.	Прирост/снижение с 01.05.2021 г.
ГЦБ МФ РК	267,54	79,31%	452,54	94,80%	69,15%
Акции и депозитарные расписки эмитентов РК	0,00	0,00%	24,81	5,20%	
Репо	69,06	20,47%	0,00	0,00%	
Денежные средства на инвестиционных счетах	0,74	0,22%	0,00	0,00%	-100,00%
Итого ПА, находящиеся в управлении УИП	337,35	100%	477,35	100%	41,50%
Обязательства к оплате по совершенным сделкам	0,00	0,00%	0,00	0,00%	
Итого пенсионные активы	337,35		477,35		41,50%

По состоянию на 01.08.2021г. средневзвешенная доходность к погашению (YTM) долговых финансовых инструментов, номинированных в тенге, составила 10,2% годовых.

Государственные ценные бумаги Министерства финансов Республики Казахстан

Текущая стоимость Государственных ценных бумаг Министерства финансов Республики Казахстан, которые занимают основную долю в портфеле, на конец отчетного месяца составила 452,54 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 94,80%.

В отчетном месяце были приобретены ГЦБ Министерства финансов РК, в объеме номинала 25,50 млн. тенге.

На отчетную дату средневзвешенная доходность к погашению по ГЦБ Министерства финансов РК, номинированным в тенге, составила 10,2% годовых.

Акции и депозитарные расписки эмитентов Республики Казахстан

Текущая стоимость акций и депозитарных расписок эмитентов Республики Казахстан на конец отчетного месяца составила 24,81 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 5,20%.

Валютная структура

Инвестиционный портфель финансовых инструментов в разрезе валют, в которых номинированы финансовые инструменты, приобретенные за счет пенсионных активов ЕНПФ в доверительном управлении Сентрас Секьюритиз, представлен в Таблице 2.

В отчетном периоде сделок купли-продажи с иностранной валютой на Казахстанской фондовой бирже не заключалось.

Таблица 2. Структура инвестиционного портфеля ПА ЕНПФ, находящихся в доверительном управлении Сентрас Секьюритиз, в разрезе валют

млн. тенге

Валюта	Текущая стоимость на 01.05.2021 г.	Доля на 01.05.2021 г.	Текущая стоимость на 01.08.2021 г.	Доля на 01.08.2021 г.	Прирост/снижение с 01.05.2021 г.
--------	------------------------------------	-----------------------	------------------------------------	-----------------------	----------------------------------

Национальная валюта	337,35	100%	477,35	100%	41,50%
Доллары США	0,00	0,00	0,00	0,00	-
Российские рубли	0,00	0,00	0,00	0,00	-
Другие валюты	0,00	0,00	0,00	0,00	-
Итого:	337,35	100%	477,35	100%	41,50%

Результаты инвестиционной деятельности

В результате инвестиционной деятельности и изменения рыночной стоимости финансовых инструментов, размер начисленного инвестиционного дохода составил 16,72 млн. тенге. Доходность пенсионных активов составила 3,99%.

Структура начисленного инвестиционного дохода за указанный период представлена в Таблице 3.

Таблица 3. Структура инвестиционного дохода, полученного по ПА ЕНПФ, находящихся в доверительном управлении Сентрас Секьюритиз

Наименование	млн. тенге	
	Инвестиционный доход за 2021 год	
Доходы в виде вознаграждения по ценным бумагам, в том числе по размещенным вкладам и операциям «обратное РЕПО»	12,67	
Доходы (убытки) от рыночной переоценки ценных бумаг	4,05	
Доходы (убытки) от переоценки иностранной валюты	0,00	
Доходы (убытки) от переоценки прочих активов (ПФИ)	0,00	
Доходы (убытки) по активам, находящимся во внешнем управлении	0,00	
Прочие доходы (убытки)	0,00	
Итого:	16,72	

Информация о стоимости условной единицы

Динамика стоимости условной пенсионной единицы ПА ЕНПФ, находящихся в доверительном управлении Сентрас Секьюритиз представлена в Таблице 4.

Таблица 4. Стоимость одной условной единицы, находящихся в доверительном управлении Сентрас Секьюритиз

№	Дата	Стоимость одной условной единицы
1	01.07.2021	932,2119076
2	02.07.2021	932,2119076
3	03.07.2021	932,2119076
4	04.07.2021	932,2119076
5	05.07.2021	932,2119076
6	06.07.2021	932,2119076
7	07.07.2021	937,585792
8	08.07.2021	937,585792
9	09.07.2021	937,585792
10	10.07.2021	937,585792
11	11.07.2021	937,585792
12	12.07.2021	937,0178767
13	13.07.2021	937,0178767
14	14.07.2021	937,0178767
15	15.07.2021	937,0178767
16	16.07.2021	937,0178767
17	17.07.2021	937,0178767

18	18.07.2021	937,0178767
19	19.07.2021	929,1178858
20	20.07.2021	929,1178858
21	21.07.2021	929,1178858
22	22.07.2021	929,1178858
23	23.07.2021	929,1178858
24	24.07.2021	929,1178858
25	25.07.2021	929,1178858
26	26.07.2021	942,5231756
27	27.07.2021	942,5231756
28	28.07.2021	942,5231756
29	29.07.2021	942,5231756
30	30.07.2021	942,5231756
31	31.07.2021	943,3879863

Информация о соблюдении параметров инвестиционной декларации

Структурное распределение ПА ЕНПФ, находящихся в доверительном управлении Сентрас Секьюритиз, соответствует требованиям Инвестиционной декларации. Доли валютных позиций остаются в рамках допустимого уровня и не нарушают требований Инвестиционной декларации. Сведения о соблюдении лимитов инвестирования по ПА ЕНПФ, находящихся в доверительном управлении Сентрас Секьюритиз, по состоянию на 1 августа 2021 года представлены в Таблице 5.

Таблица 5. Лимиты инвестирования по ПА ЕНПФ, находящихся в доверительном управлении Сентрас Секьюритиз

№	Вид финансового инструмента	Фактическое значение (в процентах от общего объема ПА)	Выполнение (да/нет)
1	Денежные средства в национальной валюте – тенге (KZT)	0,00%	да
2	Иностранная валюта других стран, согласно Постановлению	0,00%	да
3	Государственные ценные бумаги РК (в том числе, эмитированные в соответствии с законодательством иностранных государств), выпущенные Министерством финансов РК и Национальным Банком РК, а также ЦБ, выпущенные под гарантию и (или) поручительство Правительства РК	94,80%	да
4	Долговые ЦБ, выпущенные местными исполнительными органами РК	0,00%	да
5	Долговые ЦБ, выпущенные юридическим лицом, сто процентов акций которого принадлежат Национальному Банку РК	0,00%	да
6	Долговые ЦБ, выпущенные акционерными обществами «Банк Развития Казахстана», «Фонд национального благосостояния «Самрук-Казына», «Национальный управляющий холдинг «Байтерек», «Фонд проблемных кредитов» в соответствии с законодательством РК и других государств	0,00%	да
7	Вклады в банках второго уровня РК, согласно Постановлению	0,00%	да
8	Вклады в банках-нерезидентах, согласно Постановлению	0,00%	да
9	Долговые ценные бумаги, выпущенные следующими международными финансовыми организациями, имеющие рейтинговую оценку не ниже «BB+» по международной шкале агентства Standard & Poor's (Стандарт энд Пурс) или рейтинговую оценку аналогичного уровня агентств Moody's Investors Service (Мудис Инвесторс Сервис) или Fitch (Фич): Азиатский банк развития (the Asian Development Bank); Межамериканский банк развития (the Inter-American Development Bank); Африканский банк развития (the African Development Bank); Евразийский банк развития (Eurasian Development Bank);	0,00%	да

	<p>Европейский банк реконструкции и развития (the European Bank for Reconstruction and Development);</p> <p>Европейский инвестиционный банк (the European Investment Bank);</p> <p>Банк Развития Европейского Совета (the Council of Europe Development Bank);</p> <p>Исламская корпорация по развитию частного сектора (the Islamic Corporation for the Development of the Private Sector);</p> <p>Исламский банк развития (the Islamic Development Bank);</p> <p>Многостороннее агентство гарантии инвестиций (the Multilateral Investment Guarantee Agency);</p> <p>Скандинавский инвестиционный банк (the Nordic Investment Bank);</p> <p>Международный валютный фонд (the International Monetary Fund);</p> <p>Международная ассоциация развития (the International Development Association);</p> <p>Международный центр по урегулированию инвестиционных споров (the International Centre for Settlement of Investment Disputes);</p> <p>Международный банк реконструкции и развития (the International Bank for Reconstruction and Development);</p> <p>Международная финансовая корпорация (the International Finance Corporation).</p>		
10	ЦБ, имеющие статус государственных, выпущенные правительствами иностранных государств, согласно Постановлению	0,00%	да
11	<p>Негосударственные ЦБ, выпущенные иностранными организациями:</p> <p>*акции иностранных эмитентов, имеющих рейтинговую оценку не ниже «BB» по международной шкале агентства Standard & Poor's (Стандарт энд Пурс) или рейтинговую оценку аналогичного уровня агентств Moody's Investors Service (Мудис Инвесторс Сервис) или Fitch (Фич);</p> <p>*акции иностранных эмитентов, входящие в состав основных фондовых индексов, и депозитарные расписки, базовым активом которых являются данные акции;</p> <p>*долговые ЦБ, имеющие рейтинговую оценку не ниже «BB» по международной шкале агентства Standard & Poor's (Стандарт энд Пурс) или рейтинговую оценку аналогичного уровня агентств Moody's Investors Service (Мудис Инвесторс Сервис) или Fitch (Фич).</p>	0,00%	да
12	Негосударственные ЦБ, выпущенные организациями РК в соответствии с законодательством РК и других государств, согласно Постановлению	5,20%	да
13	Паи Exchange Traded Funds (Эксчейндж Трэйдэд Фонде), Exchange, Traded Commodities (Эксчейндж Трэйдэд Коммодитис), Exchange Traded Notes (Эксчейндж Трэйдэд Ноутс), согласно Постановлению	0,00%	да
14	Паи интервальных паевых инвестиционных фондов, управляющая компания которых является юридическим лицом, созданным в соответствии с законодательством РК, включенные в официальный список фондовой биржи, согласно Постановлению	0,00%	да
15	Аффинированные драгоценные металлы, согласно Постановлению	0,00%	да
16	Производные финансовые инструменты, заключенные в целях хеджирования, согласно Постановлению	0,00%	да

Информация по покупкам, продажам и погашениям финансовых инструментов, находящихся в инвестиционном портфеле ПА ЕНПФ в доверительном управлении Центрас Секьюритиз

Таблица 6. Сведения по приобретению финансовых инструментов в отчетном месяце

Вид инструмента	Валюта	Эмитент ценной бумаги	Номинальная стоимость в тенге
ГЦБ РК	KZT	Министерство Финансов РК	25 500 000
Итого			25 500 000