

**Информация по инвестиционному управлению  
пенсионными активами АО «ЕНПФ», находящимися в доверительном  
управлении АО «Halyk Global Markets»**

По состоянию на 1 марта 2023 года пенсионные активы (далее – ПА) АО «ЕНПФ» (далее – ЕНПФ), находящиеся в доверительном управлении АО «Halyk Global Markets» (далее – Halyk Global Markets), составили **2 696,39** млн. тенге.

Структура портфеля финансовых инструментов, сформированного за счет пенсионных активов, находящихся в доверительном управлении Halyk Global Markets представлена в Таблице 1.

**Таблица 1. Структура инвестиционного портфеля ПА ЕНПФ, находящихся в доверительном управлении Halyk Global Markets, в разрезе финансовых инструментов**

*млн. тенге*

Наименование	Текущая стоимость на 01.01.2023г.	Доля на 01.01.2023г.	Текущая стоимость на 01.03.2023г.	Доля на 01.03.2023г.	Прирост/снижение с 01.01.2023г.
Облигации банков второго уровня РК	49,39	1,88%	47,68	1,77%	-3,47%
Облигации МФО	115,27	4,38%	117,37	4,35%	1,82%
Корпоративные облигации организаций РК	121,62	4,62%	117,22	4,35%	-3,62%
Облигации квазигосударственных организаций РК	330,81	12,57%	329,23	12,21%	-0,48%
Долевые инструменты иностранных эмитентов (Паи ETF)	334,78	12,72%	337,60	12,52%	0,84%
Акции и депозитарные расписки, выпущенные организациями Республики Казахстан	130,00	4,94%	-	-	-
Ценные бумаги, имеющие статус государственных, выпущенные центральными правительствами иностранных государств	178,74	6,79%	173,22	6,42%	-3,09%
Обратное РЕПО (не более 90 календарных дней)	1 307,42	49,69%	1 470,47	54,53%	12,47%
Прочие активы (дебиторская задолженность, просроченная задолженность, провизии)	0,66	0,03%	-	-	-
Денежные средства на счетах	62,51	2,38%	103,61	3,84%	65,74%
<b>Итого ПА, находящиеся в управлении Halyk Global Markets</b>	<b>2 631,21</b>	<b>100,00%</b>	<b>2 696,39</b>	<b>100,00%</b>	<b>2,48%</b>
Обязательства к оплате по совершенным сделкам	-	-	-	-	-
<b>Итого пенсионные активы</b>	<b>2 631,21</b>	<b>100,00%</b>	<b>2 696,39</b>	<b>100,00%</b>	<b>2,48%</b>

По состоянию на 01.03.2023 г. средневзвешенная доходность долговых финансовых инструментов, номинированных в тенге, составила 13,72% годовых. Средневзвешенная доходность долговых финансовых инструментов, номинированных в долларах США, составила 4,92%.

**Операции обратного РЕПО (не более 90 календарных дней)**

В инвестиционном портфеле ПА ЕНПФ, находящихся в доверительном управлении Halyk Global Markets, присутствуют операции обратного РЕПО, текущая стоимость которых за отчетный месяц составила 1 470,47 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 54,53%.

Средневзвешенная доходность операций обратного РЕПО на отчетную дату составила 16,09% годовых.

#### **Облигации банков второго уровня Республики Казахстан**

Текущая стоимость облигаций банков второго уровня Республики Казахстан (далее – РК) за отчетный месяц выросла на 0,43 млн. тенге и составила 47,68 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 1,77%.

Средневзвешенная доходность к погашению облигаций банков второго уровня РК на отчетную дату составила 12,43% годовых.

#### **Облигации международных финансовых организаций**

Текущая стоимость облигаций международных финансовых организаций за отчетный месяц выросла на 1,05 млн тенге и составила 117,37 млн. тенге. Доля в портфеле облигаций международных финансовых организаций составила 4,35%.

Средневзвешенная доходность к погашению по облигациям международных финансовых организаций, номинированным в тенге, с фиксированной ставкой вознаграждения составила 15,61% годовых.

#### **Долевые инструменты иностранных эмитентов (ПАИ ETF)**

В инвестиционном портфеле ПА ЕНПФ, находящихся в доверительном управлении Nalyk Global Markets, присутствуют долевые инструменты иностранных эмитентов (ПАИ ETF), текущая стоимость которых за отчетный месяц снизилась на 16,23 млн. тенге и составила 337,60 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 12,52%.

#### **Корпоративные облигации эмитентов РК**

Текущая стоимость корпоративных облигаций эмитентов РК за отчетный месяц выросла на 1,10 млн. тенге и составила 117,22 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 4,35%.

Средневзвешенная доходность к погашению корпоративных облигаций эмитентов РК, номинированных в тенге, на отчетную дату составила 12,26% годовых.

#### **Ценные бумаги, имеющие статус государственных, выпущенные центральными правительствами иностранных государств**

Текущая стоимость ценных бумаг, имеющих статус государственных, выпущенных центральными правительствами иностранных государств, за отчетный месяц снизилась на 5,32 млн. тенге и составила 173,22 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 6,42%.

Средневзвешенная доходность к погашению ценных бумаг, имеющих статус государственных, выпущенных центральными правительствами иностранных государств, на отчетную дату составила 4,92% годовых.

#### **Облигации квазигосударственных организаций РК**

Текущая стоимость облигаций квазигосударственных организаций РК за отчетный месяц снизилась на 4,36 млн. тенге и составила 329,23 млн. тенге. Доля облигаций квазигосударственных организаций РК в портфеле составила 12,21%.

Средневзвешенная доходность к погашению облигаций квазигосударственных организаций РК, номинированных в тенге, на отчетную дату составила 13,75% годовых.

#### **Валютная структура**

Инвестиционный портфель финансовых инструментов в разрезе валют, в которых номинированы финансовые инструменты, приобретенные за счет пенсионных активов, находящихся в доверительном управлении Nalyk Global Markets представлен в Таблице 2.

В отчетном периоде сделки купли-продажи иностранной валюты на Казахстанской фондовой бирже не осуществлялись.

**Таблица 2. Структура инвестиционного портфеля ПА ЕНПФ, находящихся в доверительном управлении Halyk Global Markets, в разрезе валют**

*млн. тенге*

Валюта	Текущая стоимость на 01.01.2023г.	Доля на 01.01.2023г.	Текущая стоимость на 01.03.2023г.	Доля на 01.03.2023г.	Прирост/снижение с 01.01.2023г.
Национальная валюта	2 095,80	79,65%	2 164,48	80,27%	3,28%
Доллары США	535,40	20,35%	531,91	19,73%	-0,65%
<b>Итого:</b>	<b>2 631,21</b>	<b>100,00%</b>	<b>2 696,39</b>	<b>100,00%</b>	<b>2,48%</b>

### Результаты инвестиционной деятельности

В результате инвестиционной деятельности, размер начисленного инвестиционного дохода (по состоянию на 01 марта 2023 года с момента передачи активов) составил 286,52 млн. тенге и размер начисленного инвестиционного дохода (по состоянию на 01 марта 2023 года с 01 января 2023 года) составил 63,12 млн. тенге. Доходность пенсионных активов составила 15,46% с начала деятельности и 2,22% с начала 2023 года.

Структура начисленного инвестиционного дохода представлена в Таблице 3.

**Таблица 3. Структура инвестиционного дохода, полученного по ПА ЕНПФ, находящихся в доверительном управлении Halyk Global Markets**

*млн. тенге*

Наименование	Инвестиционный доход с начала 2023 года.
Доходы в виде вознаграждения по ценным бумагам, в том числе по размещенным вкладам и операциям «обратное РЕПО»	48,83
Доходы (убытки) от рыночной переоценки ценных бумаг	19,74
Доходы (убытки) от переоценки иностранной валюты	-7,32
Прочие доходы (убытки)	1,87
<b>Итого:</b>	<b>63,12</b>

### Информация о стоимости условной единицы

Динамика стоимости условной пенсионной единицы ПА ЕНПФ, находящихся в доверительном управлении Halyk Global Markets представлена в Таблице 4.

**Таблица 4. Стоимость одной условной единицы ПА ЕНПФ, находящихся в доверительном управлении Halyk Global Markets**

№	Дата	Стоимость одной условной единицы
1	01.02.2023	1 038,3223257
2	02.02.2023	1 038,3223257
3	03.02.2023	1 038,3223257
4	04.02.2023	1 038,3223257
5	05.02.2023	1 038,3223257
6	06.02.2023	1 041,1155937
7	07.02.2023	1 041,1155937
8	08.02.2023	1 041,1155937
9	09.02.2023	1 041,1155937
10	10.02.2023	1 041,1155937
11	11.02.2023	1 041,1155937
12	12.02.2023	1 041,1155937
13	13.02.2023	1 039,4981054
14	14.02.2023	1 039,4981054
15	15.02.2023	1 039,4981054
16	16.02.2023	1 039,4981054
17	17.02.2023	1 039,4981054
18	18.02.2023	1 039,4981054
19	19.02.2023	1 039,4981054

20	20.02.2023	1 039,2299404
21	21.02.2023	1 039,2299404
22	22.02.2023	1 039,2299404
23	23.02.2023	1 039,2299404
24	24.02.2023	1 039,2299404
25	25.02.2023	1 039,2299404
26	26.02.2023	1 039,2299404
27	27.02.2023	1 038,6334778
28	28.02.2023	1 038,5348541

### Информация о соблюдении параметров инвестиционной декларации

Структурное распределение ПА ЕНПФ, находящихся в доверительном управлении, соответствует требованиям Инвестиционной декларации на портфель финансовых инструментов, сформированный за счет пенсионных активов, находящихся в доверительном управлении Halyk Global Markets<sup>1</sup>. Доли валютных позиций остаются в рамках допустимого уровня и не нарушают требований Инвестиционной декларации на портфель финансовых инструментов, сформированный за счет пенсионных активов, находящихся в доверительном управлении Halyk Global Markets. Сведения о соблюдении лимитов инвестирования по состоянию на 01 марта 2023 года представлены в Таблице 5.

**Таблица 5. Лимиты инвестирования по ПА ЕНПФ, находящихся в доверительном управлении Halyk Global Markets**

№	Вид финансового инструмента	Фактическое значение (в процентах от общего объема ПА)	Выполнение (да/нет)
1	Денежные средства, включая остатки на банковских счетах	3,84%	да
2	Обратное РЕПО	54,53%	да
3	Государственные ценные бумаги Республики Казахстан, выпущенные Министерством финансов РК и НБ РК, долговые ценные бумаги, выпущенные местными исполнительными органами РК	0,00%	да
4	Долговые ценные бумаги, выпущенные юридическим лицом, сто процентов акций которого принадлежат НБ РК	7,45%	да
5	Долговые ценные бумаги, выпущенные акционерными обществами «Банк Развития Казахстана», «Фонд национального благосостояния «Самрук-Казына», «Национальный управляющий холдинг «Байтерек», «Фонд проблемных кредитов» в соответствии с законодательством Республики Казахстан и других государств	0,00%	да
6	Вклады в банках второго уровня Республики Казахстан	0,00%	да
7	Вклады в банках-нерезидентах	0,00%	да
8	Долговые ценные бумаги, выпущенные международными финансовыми организациями	4,35%	да
9	Ценные бумаги, имеющие статус государственных, выпущенные центральными правительствами иностранных государств	6,42%	да
10	Акции и депозитарные расписки иностранных эмитентов	0,00%	да
11	Паи Exchange Traded Funds (ETF) структура активов которых повторяет структуру одного из фондовых индексов акций или ценообразование которых привязано к индексам акций	12,52%	да
12	Паи Exchange Traded Funds (ETF) структура активов которых повторяет структуру одного из индексов облигаций или ценообразование которых привязано к индексам облигаций и инструментов денежного рынка	0,00%	да
13	Паи Exchange Traded Funds (ETF), Exchange Traded Commodities (ETC), Exchange Traded Notes (ETN), ценообразование которых привязано к валютам, драгоценным металлам, товарно-сырьевым рынкам	0,00%	да

<sup>1</sup> Инвестиционная декларация на портфель финансовых инструментов, сформированный за счет пенсионных активов, находящихся в доверительном управлении Halyk Global Markets утверждена решением Совета директоров АО «Halyk Global Markets» Протокол об итогах заочного голосования Совета директоров от 18 февраля 2021 года №4

	(commodities), или к рынку недвижимости (в том числе REIT в форме ETF или ETN)		
14	Долговые ценные бумаги, иностранных негосударственных эмитентов	0,00%	да
15	Акции и депозитарные расписки эмитентов РК, паи интервальных паевых инвестиционных фондов, управляющая компания которых является юридическим лицом, созданным в соответствии с законодательством Республики Казахстан	0,00%	да
16	Долговые ценные бумаги, негосударственных эмитентов РК	10,87%	да
17	Производные финансовые инструменты	0,00%	да
18	Виды финансовых инструментов, указанные в строках 10, 11,12,13 и 15	12,52%	да

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

**Информация по покупкам, продажам и погашениям финансовых инструментов, находящихся в портфеле финансовых инструментов, сформированном за счет пенсионных активов, находящихся в доверительном управлении Halyk Global Markets**

**Таблица 6. Сведения по приобретению финансовых инструментов в отчетном месяце**

Вид инструмента	Валюта	Эмитент ценной бумаги	Стоимость сделки, в тенге
В отчетном месяце покупки финансовых инструментов не осуществлялись			
<b>Итого</b>			

**Таблица 7. Сведения по продаже финансовых инструментов в отчетном месяце**

Вид инструмента	Валюта	Эмитент ценной бумаги	Стоимость сделки, в тенге
В отчетном месяце продажи финансовых инструментов не осуществлялись			
<b>Итого</b>			

**Таблица 8. Сведения по погашениям основного долга по ценным бумагам в отчетном месяце**

Вид инструмента	Валюта	Эмитент ценной бумаги	Сумма сделки в тенге
В отчетном месяце не осуществлялись погашения основного долга			
<b>Итого</b>			

**Таблица 9. Сведения по размещениям во вклады иностранных банков в отчетном месяце**

Вид инструмента	Валюта	Наименование банка	Сумма сделки в тенге
В отчетном месяце не осуществлялись размещения во вклады иностранных банков			
<b>Итого</b>			

**Таблица 10. Сведения по погашениям основного долга по вкладам в отчетном месяце**

Вид инструмента	Валюта	Наименование банка	Сумма погашения в тенге
В отчетном месяце не осуществлялись погашения основного долга по вкладам			
<b>Итого</b>			