

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

По состоянию на 1 июля 2024 года пенсионные активы (далее – ПА) ЕНПФ, находящиеся в доверительном управлении АО «Сентрас Секьюритиз» (далее – Сентрас Секьюритиз), составили 1 313,86 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 01.01.2024 г. | Доля на 01.01.2024 г. | Текущая стоимость на 01.07.2024 г. | Доля на 01.07.2024 г. | Прирост/снижение с начала года. |
|---|------------------------------------|-----------------------|------------------------------------|-----------------------|---------------------------------|
| ГЦБ МФ РК | 346,86 | 33,89% | 342,42 | 26,06% | -1,28% |
| Облигации квазигосударственных организаций РК | 197,07 | 19,25% | 189,54 | 14,43% | -3,82% |
| Облигации БВУ РК | 168,85 | 16,50% | 90,08 | 6,86% | -46,65% |
| Корпоративные облигации эмитентов РК | - | - | 101,92 | 7,76% | - |
| Акции и депозитарные расписки эмитентов РК | 83,98 | 8,21% | 126,02 | 9,59% | 50,05% |
| Долевые инструменты иностранных эмитентов (Паи ETF) | 9,48 | 0,93% | 9,59 | 0,73% | 1,22% |
| Акции и депозитарные расписки иностранных эмитентов | 21,86 | 2,14% | 43,92 | 3,34% | 100,96% |
| Государственные облигации США | 81,04 | 7,92% | - | - | - |
| Репо | 88,07 | 8,60% | 252,76 | 19,24% | 186,99% |
| Прочие активы (дебиторская задолженность, просроченная задолженность, провизии) | - | - | - | - | - |
| Денежные средства на инвестиционных счетах | 26,33 | 2,57% | 157,60 | 11,99% | 498,46% |
| Итого ПА, находящиеся в управлении УИП | 1 023,54 | 100,00% | 1 313,86 | 100,00% | 28,36% |
| Обязательства к оплате по совершенным сделкам | - | - | - | - | - |
| Итого пенсионные активы | 1 023,54 | - | 1 313,86 | - | 28,36% |

По состоянию на 01.07.2024 г. средневзвешенная доходность к погашению (YTM) долговых финансовых инструментов составила 12,34% годовых.

Денежные средства на инвестиционных счетах и операции обратное РЕПО

На конец отчетного периода остатки денежных средств на инвестиционных счетах составили 157,60 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 11,99%. На конец отчетного периода

остатки денежных средств по операциям РЕПО составили 252,76 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 19,24%. Средневзвешенная доходность операций обратного РЕПО на отчетную дату составила 14,44% 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 342,42 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 26,06%. На отчетную дату средневзвешенная доходность к погашению по ГЦБ Министерства финансов РК, номинированным в тенге, составила 12,75% годовых.

Облигации квазигосударственных организаций Республики Казахстан

На отчетную дату средневзвешенная доходность к погашению по облигациям квазигосударственных организаций Республики Казахстан составила 5,86% годовых в долларах США и 14,14% годовых в тенге. Текущая стоимость облигаций квазигосударственных организаций Республики Казахстан на конец отчетного месяца составила 189,54 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 14,43%.

Облигации БВУ РК

На отчетную дату средневзвешенная доходность к погашению по облигациям составила 9,81% годовых. Текущая стоимость облигаций на конец отчетного месяца составила 90,08 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 6,86%.

Корпоративные облигации эмитентов РК

На отчетную дату средневзвешенная доходность к погашению по облигациям составила 17,42% годовых. Текущая стоимость облигаций на конец отчетного месяца составила 101,92 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 7,76%.

Акции и депозитарные расписки эмитентов Республики Казахстан

Текущая стоимость акций и депозитарных расписок эмитентов Республики Казахстан на конец отчетного месяца составила 126,02 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 9,59%.

Долевые инструменты иностранных эмитентов (Паи ETF)

Текущая стоимость долевых инструментов иностранных эмитентов (Паи ETF) на конец отчетного месяца составила 9,59 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 0,73%.

Акции и депозитарные расписки иностранных эмитентов

Текущая стоимость акций и депозитарных расписок иностранных эмитентов на конец отчетного месяца составила 43,92 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 3,34%.

В отчетном периоде была совершена сделка по покупке GDR Samsung Electronics на сумму 23,33 млн тг.

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.

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

млн. тенге

| Валюта | Текущая стоимость на 01.01.2024 г. | Доля на 01.01.2024 г. | Текущая стоимость на 01.07.2024 г. | Доля на 01.07.2024 г. | Прирост/снижение с начала года |
|---------------------|------------------------------------|-----------------------|------------------------------------|-----------------------|--------------------------------|
| Национальная валюта | 759,45 | 74,20% | 946,56 | 72,04% | 24,64% |
| Доллары США | 242,24 | 23,67% | 346,26 | 26,35% | 42,94% |
| Канадские доллары | 21,86 | 2,14% | 21,03 | 1,60% | -3,77% |
| Итого: | 1 023,54 | 100% | 1 313,86 | 100% | 28,36% |

Результаты инвестиционной деятельности

В результате инвестиционной деятельности и изменения рыночной стоимости финансовых инструментов, размер начисленного инвестиционного дохода с начала 2024 года составил 101,30 млн. тенге. Доходность пенсионных активов с начала 2024 года составила 8,28%.

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

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

млн. тенге

| Наименование | Инвестиционный доход за 2024 год |
|--|----------------------------------|
| Доходы в виде вознаграждения по ценным бумагам, в том числе по размещенным вкладам и операциям «обратное РЕПО» | 70,50 |
| Доходы (убытки) от рыночной переоценки ценных бумаг | 21,16 |
| Доходы (убытки) от переоценки иностранной валюты | 10,18 |
| Доходы (убытки) от переоценки прочих активов (ПФИ) | 0,00 |
| Доходы (убытки) по активам, находящимся во внешнем управлении | 0,00 |
| Прочие доходы (убытки) | -0,54 |
| Итого: | 101,30 |

Информация о стоимости условной единицы

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

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

| № | Дата | Стоимость условной единицы |
|---|------------|----------------------------|
| 1 | 01.06.2024 | 1 213,3677870 |
| 2 | 02.06.2024 | 1 213,3677870 |
| 3 | 03.06.2024 | 1 222,8439094 |
| 4 | 04.06.2024 | 1 222,8439094 |
| 5 | 05.06.2024 | 1 222,8439094 |
| 6 | 06.06.2024 | 1 222,8439094 |

| | | |
|----|------------|---------------|
| 7 | 07.06.2024 | 1 222,8439094 |
| 8 | 08.06.2024 | 1 222,8439094 |
| 9 | 09.06.2024 | 1 222,8439094 |
| 10 | 10.06.2024 | 1 218,9392987 |
| 11 | 11.06.2024 | 1 218,9392987 |
| 12 | 12.06.2024 | 1 218,9392987 |
| 13 | 13.06.2024 | 1 218,9392987 |
| 14 | 14.06.2024 | 1 218,9392987 |
| 15 | 15.06.2024 | 1 218,9392987 |
| 16 | 16.06.2024 | 1 218,9392987 |
| 17 | 17.06.2024 | 1 226,2104352 |
| 18 | 18.06.2024 | 1 226,2104352 |
| 19 | 19.06.2024 | 1 226,2104352 |
| 20 | 20.06.2024 | 1 226,2104352 |
| 21 | 21.06.2024 | 1 226,2104352 |
| 22 | 22.06.2024 | 1 226,2104352 |
| 23 | 23.06.2024 | 1 226,2104352 |
| 24 | 24.06.2024 | 1 233,5455806 |
| 25 | 25.06.2024 | 1 233,5455806 |
| 26 | 26.06.2024 | 1 233,5455806 |
| 27 | 27.06.2024 | 1 233,5455806 |
| 28 | 28.06.2024 | 1 233,5455806 |
| 29 | 29.06.2024 | 1 233,5455806 |
| 30 | 30.06.2024 | 1 237,9376926 |

Информация о соблюдении параметров инвестиционной декларации

Структурное распределение ПА ЕНПФ, находящихся в доверительном управлении Центрас 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 Центрас Секьюритиз, по состоянию на 1 июля 2024 года представлены в Таблице 5.

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

| № | Вид финансового инструмента | Фактическое значение (в процентах от общего объема ПА) | Выполнение (да/нет) |
|----------|---|---|----------------------------|
| 1 | Денежные средства в национальной валюте – тенге (KZT) | 0,81% | да |
| 2 | Иностранная валюта других стран, согласно Постановлению | 11,18% | 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 | 37,66 | 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 | 7,35% | да |
| 7 | Вклады в банках второго уровня РК, согласно Постановлению | 0,00% | да |
| 8 | Вклады в банках-нерезидентах, согласно Постановлению | 0,00% | да |
| 9 | <p>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):</p> <p>Азиатский банк развития (the Asian Development Bank); Межамериканский банк развития (the Inter-American Development Bank); Африканский банк развития (the African Development Bank); Европейский банк реконструкции и развития (the European Bank for Reconstruction and Development); Европейский инвестиционный банк (the European Investment Bank); Банк Развития Европейского Совета (the Council of Europe Development Bank); Исламская корпорация по развитию частного сектора (the Islamic Corporation for the Development of the Private Sector); Исламский банк развития (the Islamic Development Bank); Многостороннее агентство гарантии инвестиций (the Multilateral Investment Guarantee Agency); Скандинавский инвестиционный банк (the Nordic Investment Bank); Международный валютный фонд (the International Monetary Fund); Международная ассоциация развития (the International Development Association); Международный центр по урегулированию инвестиционных споров (the International Centre for Settlement of Investment Disputes); Международный банк реконструкции и развития (the International Bank for Reconstruction and Development); Международная финансовая корпорация (the International Finance Corporation); а также ценные бумаги, выпущенные международной финансовой организацией, доля Республики Казахстан в уставном капитале которой составляет не менее 25%</p> | 0,00% | да |
| 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); *акции иностранных эмитентов, входящие в состав основных фондовых индексов, и депозитарные расписки, базовым активом которых являются данные акции; *долговые ЦБ, имеющие рейтинговую оценку не ниже</p> | 3,34% | да |

| | | | |
|----|---|--------|----|
| | «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). | | |
| 12 | Негосударственные ЦБ, выпущенные организациями РК в соответствии с законодательством РК и других государств, согласно Постановлению | 38,92% | да |
| 13 | Паи Exchange Traded Funds (Эксчейндж Трэйдэд Фанде), Exchange, Traded Commodities (Эксчейндж Трэйдэд Коммодитис), Exchange Traded Notes (Эксчейндж Трэйдэд Ноутс), согласно Постановлению | 0,73% | 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 «Сентрас Секьюритиз»

Таблица 6. Сведения по приобретению финансовых инструментов в отчетном месяце

| Вид инструмента | Валюта | Эмитент ценной бумаги | Стоимость сделки в тенге |
|-----------------|--------|-------------------------|--------------------------|
| GDR | USD | SAMSUNG ELECTR-GDR REGS | 23 329 013,71 |
| Итого | | | 23 329 013,71 |

Таблица 7. Сведения по продаже финансовых инструментов в отчетном месяце

| Вид инструмента | Валюта | Эмитент ценной бумаги | Сумма сделки в тенге |
|-----------------|--------|-----------------------|----------------------|
| Итого | | | - |

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

| Вид инструмента | Валюта | Эмитент ценной бумаги | Стоимость сделки в тенге |
|-----------------|--------|-----------------------|--------------------------|
| Итого | | | - |

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 | | | |
| Итого | | | - |

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 | | | |
| Итого | | | - |