

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

По состоянию на 1 ноября 2022 года пенсионные активы (далее – ПА) ЕНПФ, находящиеся в доверительном управлении АО «Сентрас Секьюритиз» (далее – Сентрас Секьюритиз), составили 975,96 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

Наименование	<i>млн. тенге</i>				
	Текущая стоимость на 01.01.2022г.	Доля на 01.01.2022г.	Текущая стоимость на 01.11.2022г.	Доля на 01.11.2022г.	Прирост/снижение с начала года
ГЦБ МФ РК	560,90	69,29%	532,84	54,60%	-5,00%
Облигации квазигосударственных организаций РК	0,00	0,00%	81,35	8,34%	0,00%
Акции и депозитарные расписки эмитентов РК	119,26	14,73%	78,69	8,06%	-34,02%
Долевые инструменты иностранных эмитентов (Паи ETF)	0,00	0,00%	17,13	1,76%	0,00%
Репо	127,09	15,70%	150,20	15,39%	18,18%
Денежные средства на инвестиционных счетах	2,20	0,27%	115,75	11,86%	5164,41%
Итого ПА, находящиеся в управлении УИП	809,46	100,00%	975,96	100,00%	20,57%
Обязательства к оплате по совершенным сделкам	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00%
Итого пенсионные активы	809,46		975,96		20,57%

По состоянию на 01.11.2022г. средневзвешенная доходность к погашению (YTM) долговых финансовых инструментов и РЕПО, номинированных в тенге, составила 11,77% годовых.

Денежные средства и операции обратное РЕПО

Текущая стоимость операций обратного РЕПО за отчетный месяц составила 150,20 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 15,39%. На конец отчетного периода остатки денежных средств на инвестиционных счетах составили 115,75 млн. тенге. Суммарная доля денежных средств и требований по операциям обратного РЕПО на конец отчетного месяца составила 27,25%.

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 532,84 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 54,60%.

На отчетную дату средневзвешенная доходность к погашению по ГЦБ Министерства финансов РК, номинированным в тенге, составила 11,26% годовых.

Облигации квазигосударственных организаций Республики Казахстан

На отчетную дату средневзвешенная доходность к погашению по облигациям квазигосударственных организаций Республики Казахстан, номинированным в тенге, составила 8,38% годовых. Текущая стоимость облигаций квазигосударственных организаций Республики Казахстан, номинированным в тенге, на конец отчетного месяца составила 81,35 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 8,34%.

В отчетном периоде Облигации квазигосударственных организаций РК не приобретались.

Акции и депозитарные расписки эмитентов Республики Казахстан

Текущая стоимость акций и депозитарных расписок эмитентов Республики Казахстан на конец отчетного месяца составила 78,69 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 8,06%.

Долевые инструменты иностранных эмитентов (Паи ETF)

Текущая стоимость долевых инструментов иностранных эмитентов (Паи ETF) на конец отчетного месяца составила 17,13 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 1,76%. В отчетном периоде в состав портфеля ПА ЕНПФ в доверительном управлении Центрас Секьюритиз ETF не приобретались.

Валютная структура

Инвестиционный портфель финансовых инструментов в разрезе валют, в которых номинированы финансовые инструменты, приобретенные за счет пенсионных активов ЕНПФ в доверительном управлении Центрас 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 Центрас Секьюритиз, в разрезе валют

<i>млн. тенге</i>					
Валюта	Текущая стоимость на 01.01.2022г.	Доля на 01.01.2022г.	Текущая стоимость на 01.11.2022г.	Доля на 01.11.2022г.	Прирост/снижение с начала года
Национальная валюта	809,46	100%	787,80	80,72%	-2,68%
Доллары США	0,00	0,00	188,16	19,28%	0,00%
Российские рубли	0,00	0,00	0,00	0,00%	-
Другие валюты	0,00	0,00	0,00	0,00%	-
Итого:	809,46	100%	975,96	100%	20,57%

Результаты инвестиционной деятельности

В результате инвестиционной деятельности и изменения рыночной стоимости финансовых инструментов, размер начисленного инвестиционного дохода с начала 2022 года составил 29,42 млн. тенге. Доходность пенсионных активов с начала 2022 года составила 2,48%.

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

<i>млн. тенге</i>	
Наименование	Инвестиционный доход за 10 мес. 2022г.
Доходы в виде вознаграждения по ценным бумагам, в том числе по размещенным вкладам и операциям «обратное РЕПО»	72,70
Доходы (убытки) от рыночной переоценки ценных бумаг, от переоценки иностранной валюты и прочие доходы (убытки)	-43,28
Итого:	29,42

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 условной единицы
1	01.10.2022	1 012,5886898
2	02.10.2022	1 012,5886898
3	03.10.2022	1 007,7120137
4	04.10.2022	1 007,7120137
5	05.10.2022	1 007,7120137
6	06.10.2022	1 007,7120137
7	07.10.2022	1 007,7120137
8	08.10.2022	1 007,7120137
9	09.10.2022	1 007,7120137
10	10.10.2022	1 011,8629239
11	11.10.2022	1 011,8629239
12	12.10.2022	1 011,8629239
13	13.10.2022	1 011,8629239
14	14.10.2022	1 011,8629239
15	15.10.2022	1 011,8629239
16	16.10.2022	1 011,8629239
17	17.10.2022	1 014,1499093
18	18.10.2022	1 014,1499093
19	19.10.2022	1 014,1499093
20	20.10.2022	1 014,1499093
21	21.10.2022	1 014,1499093
22	22.10.2022	1 014,1499093
23	23.10.2022	1 014,1499093
24	24.10.2022	1 014,1499093
25	25.10.2022	1 014,1499093
26	26.10.2022	1 018,4850074
27	27.10.2022	1 018,4850074
28	28.10.2022	1 018,4850074
29	29.10.2022	1 018,4850074
30	30.10.2022	1 018,4850074
31	31.10.2022	1 016,7461923

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 ноября 2022 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)	2,67%	да
2	Иностранная валюта других стран, согласно Постановлению	9,19%	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	54,60%	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	<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);</p> <p>Межамериканский банк развития (the Inter-American Development Bank);</p> <p>Африканский банк развития (the African Development Bank);</p> <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> <p>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	Негосударственные ЦБ, выпущенные иностранными организациями: *акции иностранных эмитентов, имеющих рейтинговую оценку не ниже «BB» по международной шкале агентства Standard & Poor's (Стандарт энд Пуэр) 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 «BB» по международной шкале агентства Standard & Poor's (Стандарт энд Пуэр) или рейтинговую оценку аналогичного уровня агентств Moody's Investors Service (Мудис Инвесторс Сервис) или Fitch (Фич).	0,00%	да
12	Негосударственные ЦБ, выпущенные организациями РК в соответствии с законодательством РК и других государств, согласно Постановлению	16,40%	да
13	Паи Exchange Traded Funds (Эксчейндж Трэйдэд Фандс), Exchange, Traded Commodities (Эксчейндж Трэйдэд Коммодитис), Exchange Traded Notes (Эксчейндж Трэйдэд Ноутс), согласно Постановлению	1,76%	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	Сумма сделки в тенге
-	-	-	-
Итого			-

Таблица 7. Сведения по продаже финансовых инструментов в отчетном месяце

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