

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

По состоянию на 1 июня 2023 года пенсионные активы (далее – ПА) АО «ЕНПФ» (далее – ЕНПФ), находящиеся в доверительном управлении АО «Halyk Global Markets» (далее – Halyk Global Markets), составили **2 532,24** 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

| <i>млн. тенге</i> | | | | | |
|---|-----------------------------------|----------------------|-----------------------------------|----------------------|----------------------------------|
| Наименование | Текущая стоимость на 01.01.2023г. | Доля на 01.01.2023г. | Текущая стоимость на 01.06.2023г. | Доля на 01.06.2023г. | Прирост/снижение с 01.01.2023 г. |
| Облигации банков второго уровня РК | 49,39 | 1,88% | 50,15 | 1,98% | 1,55% |
| Облигации МФО | 115,27 | 4,38% | 270,92 | 10,70% | 135,03% |
| Корпоративные облигации организаций РК | 121,62 | 4,62% | 123,28 | 4,87% | 1,36% |
| Облигации квазигосударственных организаций РК | 330,81 | 12,57% | 513,75 | 20,29% | 55,30% |
| Долевые инструменты иностранных эмитентов (Паи ETF) | 334,78 | 12,72% | 376,28 | 14,86% | 12,40% |
| Ноты НБРК | 0,00 | 0,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% |
| Акции и депозитарные расписки, выпущенные организациями Республики Казахстан | 130,00 | 4,94% | 0,00 | 0,00% | 0,00% |
| Ценные бумаги, имеющие статус государственных, выпущенные центральными правительствами иностранных государств | 178,74 | 6,79% | 176,01 | 6,95% | -1,53% |
| Обратное РЕПО (не более 90 календарных дней) | 1 307,42 | 49,69% | 914,85 | 36,13% | -30,03% |
| Прочие активы (дебиторская задолженность, просроченная задолженность, провизии) | 0,66 | 0,03% | 0,00 | 0,00% | -100,00% |
| Денежные средства на счетах | 62,51 | 2,38% | 107,01 | 4,23% | 71,17% |
| Итого ПА, находящиеся в управлении Halyk Global Markets | 2 631,21 | 100,00% | 2 532,24 | 100,00% | -3,76% |
| Обязательства к оплате по совершенным сделкам | - | - | - | - | - |
| Итого пенсионные активы | 2 631,21 | 100,00% | 2 532,24 | 100,00% | -3,76% |

По состоянию на 01.06.2023 г. средневзвешенная доходность долговых финансовых инструментов, номинированных в тенге, составила 13,54% годовых. Средневзвешенная доходность долговых финансовых инструментов, номинированных в долларах США, составила 5,30%.

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 914,85 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 36,13%. Средневзвешенная доходность операций обратного РЕПО на отчетную дату составила 16,89% годовых.

Облигации банков второго уровня Республики Казахстан

Текущая стоимость облигаций банков второго уровня Республики Казахстан (далее – РК) за отчетный месяц выросла на 3,02 млн. тенге и составила 50,15 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 1,98%.

Средневзвешенная доходность к погашению облигаций банков второго уровня РК на отчетную дату составила 11,61% годовых.

Облигации международных финансовых организаций

Текущая стоимость облигаций международных финансовых организаций за отчетный месяц выросла на 17,38 млн тенге и составила 270,92 млн. тенге. Доля в портфеле облигаций международных финансовых организаций составила 10,70%.

Средневзвешенная доходность к погашению по облигациям международных финансовых организаций, номинированным в тенге, с фиксированной ставкой вознаграждения составила 11,32% 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 2,86 млн. тенге и составила 376,28 млн. тенге. Доля долевых инструментов иностранных эмитентов (ПАИ ETF) в портфеле составила 14,86%.

Корпоративные облигации эмитентов РК

Текущая стоимость корпоративных облигаций эмитентов РК за отчетный месяц выросла на 8,10 млн. тенге и составила 123,28 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 4,87%.

Средневзвешенная доходность к погашению корпоративных облигаций эмитентов РК, номинированных в тенге, на отчетную дату составила 11,43% 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 1,37 млн. тенге и составила 176,01 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 6,95%.

Средневзвешенная доходность к погашению ценных бумаг, имеющих статус государственных, выпущенных центральными правительствами иностранных государств, на отчетную дату составила 5,30% годовых.

Облигации квазигосударственных организаций РК

Текущая стоимость облигаций квазигосударственных организаций РК за отчетный месяц выросла на 11,66 млн. тенге и составила 513,75 млн. тенге. Доля облигаций квазигосударственных организаций РК в портфеле составила 20,29%.

Средневзвешенная доходность к погашению облигаций квазигосударственных организаций РК, номинированных в тенге, на отчетную дату составила 15,40% 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

| <i>млн. тенге</i> | | | | | |
|---------------------|-----------------------------------|----------------------|-----------------------------------|----------------------|---------------------------------|
| Валюта | Текущая стоимость на 01.01.2023г. | Доля на 01.01.2023г. | Текущая стоимость на 01.06.2023г. | Доля на 01.06.2023г. | Прирост/снижение с 01.01.2023г. |
| Национальная валюта | 2 095,80 | 79,65% | 1 967,29 | 77,69% | -6,13% |
| Доллары США | 535,40 | 20,35% | 564,95 | 22,31% | 5,52% |
| Итого: | 2 631,21 | 100,00% | 2 532,24 | 100,00% | -3,76% |

Результаты инвестиционной деятельности

В результате инвестиционной деятельности, размер начисленного инвестиционного дохода (по состоянию на 01 июня 2023 года с 15 марта 2021 г.) составил 401,05 млн. тенге и размер начисленного инвестиционного дохода (по состоянию на 01 июня 2023 года с 01 января 2023 года) составил 177,65 млн. тенге. Доходность пенсионных активов составила 20,32% с начала деятельности и 6,52% 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

| <i>млн. тенге</i> | |
|--|--|
| Наименование | Инвестиционный доход с начала 2023 года. |
| Доходы в виде вознаграждения по ценным бумагам, в том числе по размещенным вкладам и операциям «обратное РЕПО» | 131,46 |
| Доходы (убытки) от рыночной переоценки ценных бумаг | 50,23 |
| Доходы (убытки) от переоценки иностранной валюты | -3,09 |
| Прочие доходы (убытки) | -0,95 |
| Итого: | 177,65 |

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 | 01.05.2023 | 1 057,5688102 |
| 2 | 02.05.2023 | 1 056,8998960 |
| 3 | 03.05.2023 | 1 056,8998960 |
| 4 | 04.05.2023 | 1 056,8998960 |
| 5 | 05.05.2023 | 1 056,8998960 |
| 6 | 06.05.2023 | 1 056,8998960 |
| 7 | 07.05.2023 | 1 056,8998960 |
| 8 | 08.05.2023 | 1 056,8998960 |
| 9 | 09.05.2023 | 1 056,8998960 |
| 10 | 10.05.2023 | 1 053,1125966 |
| 11 | 11.05.2023 | 1 053,1125966 |
| 12 | 12.05.2023 | 1 053,1125966 |
| 13 | 13.05.2023 | 1 053,1125966 |
| 14 | 14.05.2023 | 1 053,1125966 |
| 15 | 15.05.2023 | 1 062,3957812 |
| 16 | 16.05.2023 | 1 062,3957812 |
| 17 | 17.05.2023 | 1 062,3957812 |
| 18 | 18.05.2023 | 1 062,3957812 |

| | | |
|----|------------|---------------|
| 19 | 19.05.2023 | 1 062,3957812 |
| 20 | 20.05.2023 | 1 062,3957812 |
| 21 | 21.05.2023 | 1 062,3957812 |
| 22 | 22.05.2023 | 1 078,5538643 |
| 23 | 23.05.2023 | 1 078,5538643 |
| 24 | 24.05.2023 | 1 078,5538643 |
| 25 | 25.05.2023 | 1 078,5538643 |
| 26 | 26.05.2023 | 1 078,5538643 |
| 27 | 27.05.2023 | 1 078,5538643 |
| 28 | 28.05.2023 | 1 078,5538643 |
| 29 | 29.05.2023 | 1 081,1959474 |
| 30 | 30.05.2023 | 1 081,1959474 |
| 31 | 31.05.2023 | 1 082,2851110 |

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 Markets¹. 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 июня 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 | 4,23% | да |
| 2 | Обратное РЕПО | 36,13% | 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 | 8,24% | 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 | 6,89% | да |
| 6 | Вклады в банках второго уровня Республики Казахстан | | да |
| 7 | Вклады в банках-нерезидентах | | да |
| 8 | Долговые ценные бумаги, выпущенные международными финансовыми организациями | 10,70% | да |
| 9 | Ценные бумаги, имеющие статус государственных, выпущенные центральными правительствами иностранных государств | 6,95% | да |
| 10 | Акции и депозитарные расписки иностранных эмитентов | | да |
| 11 | Паи Exchange Traded Funds (ETF) структура активов которых повторяет структуру одного из фондовых индексов акций или ценообразование которых привязано к индексам акций | 14,86% | 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 | | да |

¹ 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

| | | | |
|----|--|--------|----|
| 13 | Паи Exchange Traded Funds (ETF), Exchange Traded Commodities (ETC), Exchange Traded Notes (ETN), ценообразование которых привязано к валютам, драгоценным металлам, товарно-сырьевым рынкам (commodities), или к рынку недвижимости (в том числе REIT в форме ETF или ETN) | | да |
| 14 | Долговые ценные бумаги, иностранных негосударственных эмитентов | | 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 | | да |
| 16 | Долговые ценные бумаги, негосударственных эмитентов РК | 12,01% | да |
| 17 | Производные финансовые инструменты | | да |
| 18 | Виды финансовых инструментов, указанные в строках 10, 11,12,13 и 15 | 14,86% | 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 |
|--------------------------|--------|---|---------------------------|
| Ноты НБ РК (NTK028_2827) | KZT | ГУ "Национальный Банк Республики Казахстан" | 221 999 942,34 |
| Итого | | | 221 999 942,34 |

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 | | | |
| Итого | | | |

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

| Вид инструмента | Валюта | Эмитент ценной бумаги | Стоимость сделки, в тенге |
|--------------------------|--------|---|---------------------------|
| Ноты НБ РК (NTK028_2827) | KZT | ГУ "Национальный Банк Республики Казахстан" | 224 626 500,00 |
| Ноты НБ РК (NTK028_2825) | KZT | ГУ "Национальный Банк Республики Казахстан" | 236 768 500,00 |
| Итого | | | 461 395 000,00 |

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 | | | |