

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

По состоянию на 1 ноября 2023 года пенсионные активы (далее – ПА) АО «ЕНПФ» (далее – ЕНПФ), находящиеся в доверительном управлении АО «Halyk Global Markets» (далее – Halyk Global Markets), составили **2 790,39** 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

<i>млн. тенге</i>					
Наименование	Текущая стоимость на 01.01.2023г.	Доля на 01.01.2023г.	Текущая стоимость на 01.11.2023г.	Доля на 01.11.2023г.	Прирост/ снижение с 01.01.2023 г.
Облигации банков второго уровня РК	49,39	1,88%	50,45	1,81%	2,16%
Корпоративные облигации иностранных эмитентов	0,00	0,00%	84,81	3,04%	0,00%
Облигации МФО	115,27	4,38%	269,03	9,64%	133,40%
Корпоративные облигации организаций РК	121,62	4,62%	123,79	4,44%	1,78%
Облигации квазигосударственных организаций РК	330,81	12,57%	418,34	14,99%	26,46%
Долевые инструменты иностранных эмитентов (Паи ETF)	334,78	12,72%	195,29	7,00%	-41,67%
Ноты НБРК	0,00	0,00%	1 095,52	39,26%	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%	211,82	7,59%	18,51%
Обратное РЕПО (не более 90 календарных дней)	1 307,42	49,69%	206,04	7,38%	-84,24%
Прочие активы (дебиторская задолженность, просроченная задолженность, провизии)	0,66	0,03%	0,00	0,00%	0,00%
Денежные средства на счетах	62,51	2,38%	135,29	4,85%	116,43%
Итого ПА, находящиеся в управлении Halyk Global Markets	2 631,21	100,00%	2 790,39	100,00%	6,05%
Обязательства к оплате по совершенным сделкам	-	-	-	-	-
Итого пенсионные активы	2 631,21	100,00%	2 790,39	100,00%	6,05%

По состоянию на 01.11.2023 г. средневзвешенная доходность долговых финансовых инструментов, номинированных в тенге, составила 12,10% годовых. Средневзвешенная доходность долговых финансовых инструментов, номинированных в долларах США, составила 6,60%.

Операции обратного РЕПО (не более 90 календарных дней)

В инвестиционном портфеле ПА ЕНПФ, находящихся в доверительном управлении Nalyk Global Markets, присутствуют операции обратного РЕПО, текущая стоимость которых за отчетный месяц составила 206,04 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 7,38%. Средневзвешенная доходность операций обратного РЕПО на отчетную дату составила 16,85% годовых.

Корпоративные облигации иностранных эмитентов

В рассматриваемом периоде были приобретены облигации Tengizchevroil Finance Company в объеме 200 тыс. долларов по номиналу. Текущая стоимость облигаций Tengizchevroil Finance Company на конец отчетного месяца составила 84,81 млн тенге. Их доля в портфеле составила 3,04%.

Средневзвешенная доходность к погашению облигаций Tengizchevroil Finance Company на отчетную дату составила 8,94% годовых.

Облигации банков второго уровня Республики Казахстан

Текущая стоимость облигаций банков второго уровня Республики Казахстан (далее – РК) за отчетный месяц увеличилась на 0,43 млн. тенге и составила 50,45 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 1,81%.

Средневзвешенная доходность к погашению облигаций банков второго уровня РК на отчетную дату составила 11,14% годовых.

Облигации международных финансовых организаций

Текущая стоимость облигаций международных финансовых организаций за отчетный месяц снизилась на 9,83 млн тенге и составила 269,03 млн. тенге. Доля в портфеле облигаций международных финансовых организаций составила 9,64%.

Средневзвешенная доходность к погашению по облигациям международных финансовых организаций, номинированным в тенге, с фиксированной ставкой вознаграждения составила 7,87% годовых.

Корпоративные облигации эмитентов РК

Текущая стоимость корпоративных облигаций эмитентов РК за отчетный месяц увеличилась на 1,10 млн. тенге и составила 123,79 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 4,44%.

Средневзвешенная доходность к погашению корпоративных облигаций эмитентов РК, номинированных в тенге, на отчетную дату составила 10,90% 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 6,23 млн. тенге и составила 195,29 млн. тенге. Доля долевых инструментов иностранных эмитентов (ПАИ ETF) в портфеле составила 7,00%.

Ноты Национального Банка Республики Казахстан

Текущая стоимость нот Национального Банка Республики Казахстана составила 1095,52 млн тенге. Их доля в портфеле составила 39,26%.

В рассматриваемом периоде были приобретены 28-дневные ноты НБРК в объеме 1,1 млрд тенге по номинальной стоимости со средневзвешенной доходностью 16,06%.

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

В отчетном периоде были приобретены казначейские облигации США в объеме 460,9 тыс. долларов по номинальной стоимости. Текущая стоимость ценных бумаг, имеющих статус государственных, выпущенных центральными правительствами иностранных государств, составила 211,82 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 7,59%.

Средневзвешенная доходность к погашению ценных бумаг, имеющих статус государственных, выпущенных центральными правительствами иностранных государств, на отчетную дату составила 5,66% годовых

Облигации квазигосударственных организаций РК

Текущая стоимость облигаций квазигосударственных организаций РК за отчетный месяц увеличилась на 4,00 млн. тенге и составила 418,34 млн. тенге. Доля облигаций квазигосударственных организаций РК в портфеле составила 14,99%.

Средневзвешенная доходность к погашению облигаций квазигосударственных организаций РК, номинированных в тенге, на отчетную дату составила 15,30% годовых.

Валютная структура

Инвестиционный портфель финансовых инструментов в разрезе валют, в которых номинированы финансовые инструменты, приобретенные за счет пенсионных активов, находящихся в доверительном управлении Halyk 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 01.11.2023г.	Доля на 01.11.2023г.	Прирост/снижение с 01.01.2023г.
Национальная валюта	2 095,80	79,65%	2 166,74	77,65%	3,38%
Доллары США	535,40	20,35%	623,65	22,35%	16,48%
Евро	0	0,00%	0,01	0,001%	0,00%
Итого:	2 631,21	100,00%	2 790,39	100,00%	6,05%

Результаты инвестиционной деятельности

В результате инвестиционной деятельности, размер начисленного инвестиционного дохода (по состоянию на 01 ноября 2023 года с 15 марта 2021 г.) составил 586,63 млн. тенге и размер начисленного инвестиционного дохода (по состоянию на 01 ноября 2023 года с 01 января 2023 года) составил 363,23 млн. тенге. Доходность пенсионных активов составила 28,96% с начала деятельности и 14,17% 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»	251,80
Доходы (убытки) от рыночной переоценки ценных бумаг	96,25
Доходы (убытки) от переоценки иностранной валюты	16,49
Прочие доходы (убытки)	-1,31
Итого:	363,23

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	01.10.2023	1 153,5561865
2	02.10.2023	1 156,6356739
3	03.10.2023	1 156,6356739
4	04.10.2023	1 156,6356739
5	05.10.2023	1 156,6356739
6	06.10.2023	1 156,6356739
7	07.10.2023	1 156,6356739
8	08.10.2023	1 156,6356739
9	09.10.2023	1 157,0775712
10	10.10.2023	1 157,0775712
11	11.10.2023	1 157,0775712
12	12.10.2023	1 157,0775712
13	13.10.2023	1 157,0775712
14	14.10.2023	1 157,0775712
15	15.10.2023	1 157,0775712
16	16.10.2023	1 160,3734892
17	17.10.2023	1 160,3734892
18	18.10.2023	1 160,3734892
19	19.10.2023	1 160,3734892
20	20.10.2023	1 160,3734892
21	21.10.2023	1 160,3734892
22	22.10.2023	1 160,3734892
23	23.10.2023	1 161,5672007
24	24.10.2023	1 161,5672007
25	25.10.2023	1 161,5672007
26	26.10.2023	1 161,5672007
27	27.10.2023	1 161,5672007
28	28.10.2023	1 161,5672007
29	29.10.2023	1 161,5672007
30	30.10.2023	1 160,6898647
31	31.10.2023	1 159,9447097

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 ноября 2023 года представлены в Таблице 5.

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

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

№	Вид финансового инструмента	Фактическое значение (в процентах от ПА)	Выполнение (да/нет)
1	Денежные средства, включая остатки на банковских счетах	0,13%	да
2	Обратное репо	7,38%	да
3	Государственные ценные бумаги Республики Казахстан (в том числе, эмитированные в соответствии с законодательством иностранных государств), выпущенные Министерством финансов Республики Казахстан и Национальным Банком Республики Казахстан, а также ценные бумаги, выпущенные под гарантию и (или) поручительство Правительства Республики Казахстан	39,26%	да
4	Долговые ценные бумаги, выпущенные местными исполнительными органами Республики Казахстан		да
5	Долговые ценные бумаги, выпущенные юридическим лицом, сто процентов акций которого принадлежат Национальному Банку Республики Казахстан	3,57%	да
6	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	6,82%	да
7	Вклады в банках второго уровня Республики Казахстан, при соответствии одному из следующих условий: – банки имеют долгосрочный кредитный рейтинг 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), или рейтинговую оценку не ниже "kzA-" по национальной шкале Standard & Poor's (Стандарт энд Пурс); – банки являются дочерними банками-резидентами, родительский банк-нерезидент которых имеет долгосрочный кредитный рейтинг по международной шкале агентства Standard & Poor's (Стандарт энд Пурс) не ниже "A-" или рейтинговую оценку аналогичного уровня агентств Moody's Investors Service (Мудис Инвесторс Сервис) или Fitch (Фич).		да
8	Вклады в банках-нерезидентах, имеющих долгосрочный рейтинг не ниже "A-" 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)		да

№	Вид финансового инструмента	Фактическое значение (в процентах от ПА)	Выполнение (да/нет)
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> <ul style="list-style-type: none"> – 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); <p>а также ценные бумаги, выпущенные международной финансовой организацией, доля Республики Казахстан в уставном капитале которой составляет не менее 25 %</p>	9,64%	да
10	<p>Ценные бумаги, имеющие статус государственных, выпущенные центральными правительствами иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг 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>	7,59%	да
11	<p>Паи Exchange Traded Funds (Эксчейндж Трэйдэд Фандс), Exchange Traded Commodities (Эксчейндж Трэйдэд Коммодитис), Exchange Traded Notes (Эксчейндж Трэйдэд Ноутс), имеющие рейтинговую оценку не ниже "3 звезды" рейтингового агентства Morningstar (Морнингстар), за исключением Паев Exchange Traded Funds (Эксчейндж Трэйдэд Фандс), структура активов которых повторяет структуру одного из основных фондовых индексов, или ценообразование по паям которых привязано к основным фондовым индексам</p>	7,00%	да
12	<p>Паи Exchange Traded Funds (ETF) структура активов которых повторяет структуру одного из основных фондовых индексов, или ценообразование по паям которых привязано к основным фондовым индексам</p>		да

№	Вид финансового инструмента	Фактическое значение (в процентах от ПА)	Выполнение (да/нет)
13	Паи интервальных паевых инвестиционных фондов, управляющая компания которых является юридическим лицом, созданным в соответствии с законодательством Республики Казахстан, включенные в официальный список фондовой биржи, соответствующие требованиям сектора "ценные бумаги инвестиционных фондов" площадки "Смешанная" официального списка фондовой биржи		да
14	Негосударственные ценные бумаги, выпущенные иностранными организациями: 1) 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), и депозитарные расписки, базовым активом которых являются данные акции; 2) акции иностранных эмитентов, входящие в состав основных фондовых индексов, и депозитарные расписки, базовым активом которых являются данные акции;		да
	долговые ценные бумаги, 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)	3,04%	да
15	Негосударственные ценные бумаги, выпущенные организациями Республики Казахстан в соответствии с законодательством Республики Казахстан и других государств: 1) акции эмитентов квазигосударственного сектора Республики Казахстан, размещенные (размещаемые) в рамках публичного предложения (продажи) среди широкого круга инвесторов на фондовой бирже, и (или) депозитарные расписки, базовым активом которых являются данные акции; 2) акции юридических лиц, включенные в официальный список фондовой биржи, соответствующие требованиям категории "премиум" сектора "акции" площадки "Основная" официального списка фондовой биржи и депозитарные расписки, базовым активом которых являются данные акции; 3) акции юридических лиц, входящие в состав основных фондовых индексов;		да

№	Вид финансового инструмента	Фактическое значение (в процентах от ПА)	Выполнение (да/нет)
	<p>4) долговые ценные бумаги, выпущенные организациями Республики Казахстан в соответствии с законодательством Республики Казахстан и других государств, имеющими рейтинговую оценку не ниже "B+" 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), или рейтинговую оценку не ниже "kzBBB" по национальной шкале Standard & Poor's (Стандарт энд Пурс);</p> <p>5) ценные бумаги, выпущенные в рамках реструктуризации обязательств эмитента в целях обмена на ранее выпущенные ценные бумаги либо иные обязательства данного эмитента</p>	10,85%	да
16	Иностранная валюта стран, имеющих суверенный рейтинг не ниже "BBB" 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)	4,72%	да
17	Негосударственные долговые ценные бумаги, выпущенные субъектами, отнесенными к малому или среднему предпринимательству согласно Предпринимательскому кодексу Республики Казахстан, включенные в сектор "долговые ценные бумаги" площадки "Основная" либо "Альтернативная" официального списка фондовой биржи, и имеющие гарантию акционерного общества "Фонд развития предпринимательства "ДАМУ" и (или) акционерного общества "Банк Развития Казахстана", сумма которой покрывает не менее 50 (пятидесяти) процентов номинальной стоимости данных негосударственных долговых ценных бумаг		да
18	Аффинированные драгоценные металлы, соответствующие международным стандартам качества, принятым Лондонской ассоциацией рынка драгоценных металлов (London bullion market association) и обозначенным в документах данной ассоциации как стандарт "Лондонская качественная поставка" ("London good delivery"), и металлические депозиты, в том числе в банках-нерезидентах Республики Казахстан, обладающих рейтинговой оценкой не ниже "AA" агентства Standard & Poor's (Стандарт энд Пурс) или рейтинговую оценку аналогичного уровня агентств Moody's Investors Service (Мудис Инвесторс Сервис) или Fitch (Фич), на срок не более двенадцати месяцев		да

№	Вид финансового инструмента	Фактическое значение (в процентах от ПА)	Выполнение (да/нет)
19	<p>Следующие производные финансовые инструменты, заключенные в целях хеджирования, базовым активом которых являются финансовые инструменты, разрешенные к приобретению за счет пенсионных активов в соответствии с настоящим приложением:</p> <p>опционы – контракт, дающий покупателю право, но не обязательство, купить или продать указанный актив по определенной цене или до определенной даты;</p> <p>фьючерсы – контракт, связанный с взаимной передачей прав и обязанностей в отношении сделки купли-продажи, которая будет совершена в будущем;</p> <p>форварды – договор, по которому одна сторона в определенные сроки обязуется передать предмет контракта, а другая сторона принять его по указанной стоимости, в указанное время и указанном месте;</p> <p>свопы – соглашение между двумя контрагентами об обмене в будущем платежами в соответствии с определенными в контракте условиями;</p> <p>производные финансовые инструменты, представляющие собой комбинацию вышеперечисленных производных финансовых инструментов;</p> <p>производные финансовые инструменты, представляющие собой комбинацию вышеперечисленных производных финансовых инструментов</p>		да
	Совокупный объем инвестиций пенсионных активов в портфель долевых инструментов, указанных в подпунктах 1) и 2) пункта 14 и в подпунктах 1), 2) и 3) пункта 15, а также в пунктах 11,12 и 13	7,00%	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_2839)	KZT	ГУ "Национальный Банк Республики Казахстан"	593 297 400,00
Ноты НБ РК (NTK028_2838)	KZT	ГУ "Национальный Банк Республики Казахстан"	494 299 500,00
Ценные бумаги, имеющие статус государственных, выпущенные центральными правительствами иностранных государств	USD	Правительство США в лице Казначейства	214 521 749,55
Корпоративные облигации иностранных эмитентов	USD	Tengizchevroil Finance Company	86 644 062,00
Итого			1 388 762 711,55

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_2836)	KZT	ГУ "Национальный Банк Республики Казахстан"	225 000 000,00
Ноты НБ РК (NTK028_2837)	KZT	ГУ "Национальный Банк Республики Казахстан"	506 000 000,00
Ценные бумаги, имеющие статус государственных, выпущенные центральными правительствами иностранных государств	USD	Правительство США в лице Казначейства	219 454 341,12
Итого			950 454 341,12

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			