

**Информация по инвестиционному управлению пенсионными активами АО «ЕНПФ»
доверительном управлении АО «ВСС Invest»**

По состоянию на 1 августа 2024 года пенсионные активы (далее – ПА) ЕНПФ, находящиеся в доверительном управлении АО «ВСС Invest» (далее – ВСС Invest), составили 4 869,41 млн. тенге.

Структура инвестиционного портфеля финансовых инструментов, сформированного за счет пенсионных активов ЕНПФ, находящихся в доверительном управлении ВСС Invest, представлена в Таблице 1.

Таблица 1. Структура инвестиционного портфеля ПА ЕНПФ, находящихся в доверительном управлении ВСС Invest, в разрезе финансовых инструментов

млн. тенге

| Наименование | Текущая стоимость на 01.01.2024г. | Доля на 01.01.2024г. | Текущая стоимость на 01.08.2024г. | Доля на 01.08.2024г. | Прирост/снижение за отчетный период |
|------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------|-----------------------------|------------------------------------------|-----------------------------|--------------------------------------------|
| Облигации квазигосударственных организаций РК | 717,71 | 24,69% | 1648,83 | 33,86% | 127,39% |
| ГЦБ МФ РК | 510,05 | 17,54% | 599,67 | 12,32% | 17,57% |
| Облигации БВУ РК | 27,78 | 0,96% | 648,17 | 13,31% | 2233,23% |
| Корпоративные облигации эмитентов-резидентов РК | 80,16 | 2,76% | 441,96 | 9,08% | 451,35% |
| Корпоративные облигации иностранных эмитентов | 0,00 | 0,00% | 327,88 | 6,73% | 100% |
| Облигации МФО | 88,34 | 3,04% | 188,25 | 3,87 % | 113,10% |
| ГЦБ иностранных государств | 145,92 | 5,02% | 152,22 | 3,13% | 4,32% |
| Паи (ETF на индексы) | 480,25 | 16,52% | 308,73 | 6,34% | -35,71% |
| Акции и депозитарные расписки иностранных эмитентов | 17,46 | 0,6% | 0,00 | 0,00% | -100% |
| Акции и депозитарные расписки, выпущенные организациями Республики Казахстан | 0,00 | 0,00% | 75,07 | 1,54% | 100% |

| | | | | | |
|---------------------------------------------------------------------------------|-----------------|----------------|-----------------|----------------|--------------|
| Денежные средства на инвестиционных счетах | 9,09 | 0,31% | 29,32 | 0,6% | 222,55% |
| Обратное РЕПО | 829,53 | 28,53% | 449,31 | 9,23% | -45,84% |
| Прочие активы (дебиторская задолженность, просроченная задолженность, провизии) | 0,85 | 0,03% | 0 | 0% | -100% |
| Итого ПА, находящиеся в управлении УИП | 2 907,14 | 100,00% | 4 869,41 | 100,00% | 67,5% |
| Обязательства к оплате по совершенным сделкам | 0,00 | 0,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% |
| Итого пенсионных активов | 2 907,14 | | 4 869,41 | | 67,5% |

По состоянию на 01.08.2024г. средневзвешенная доходность к погашению (YTM) долговых финансовых инструментов и операций РЕПО, находящихся в инвестиционном портфеле ПА ЕНПФ, составила 11,89% в тенге и 5,38% в долларах США соответственно.

Денежные средства и операции обратное РЕПО

До момента приобретения финансовых инструментов в портфель согласно инвестиционной стратегии и инвестиционной декларации временно свободные денежные средства размещаются в операции обратного РЕПО с учетом требований по диверсификации и лимитам инвестирования. На 1 августа 2024 года требования по операциям обратного РЕПО составили 449,31 млн. тенге с долей в портфеле 9,23%, а доход по операциям РЕПО за период с 01 по 31 июля 2024 года составил 7,2 млн. тенге. На конец отчетного периода остатки денежных средств на инвестиционных счетах составили 29,32 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 0,60%.

Облигации Министерства финансов Республики Казахстан

В отчетном периоде в состав портфеля ПА ЕНПФ в доверительном управлении ВСС Invest облигации Министерства финансов Республики Казахстан не приобретались.

Текущая стоимость облигаций Министерства финансов Республики Казахстан, номинированных в тенге, на конец отчетного месяца составила 599,67 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 12,32%.

На отчетную дату средневзвешенная доходность к погашению по облигациям Министерства финансов Республики Казахстан, номинированным в тенге, составила 13,23% годовых.

Облигации Министерства Финансов США

В отчетном периоде в состав портфеля были приобретены облигации Министерства Финансов США на сумму 78,963 млн тенге.

На отчетную дату средневзвешенная доходность к погашению по облигациям Министерства Финансов США, номинированных в долларах США, составила 4,73% годовых.

Текущая стоимость облигаций Министерства Финансов США, номинированных в долларах США, на конец отчетного месяца составила 152,22 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 3,13%.

Облигации банков второго уровня Республики Казахстан

В отчетном периоде в состав портфеля были приобретены облигации АО "Жилищный строительный сберегательный банк "Отбасы банк" на сумму 200 млн. тенге.

На отчетную дату средневзвешенная доходность к погашению по облигациям банков второго уровня, номинированным в тенге, составила 13,02% годовых.

Текущая стоимость облигаций банков второго уровня, номинированным в тенге, на конец отчетного месяца составила 648,17 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 13,31%.

Облигации квазигосударственных организаций Республики Казахстан

В отчетном периоде в состав портфеля ПА ЕНПФ в доверительном управлении ВСС Invest облигации квазигосударственных организаций Республики Казахстан не приобретались.

На отчетную дату средневзвешенная доходность к погашению по облигациям квазигосударственных организаций Республики Казахстан составила 9,22% годовых.

Текущая стоимость облигаций квазигосударственных организаций Республики Казахстан, номинированным в тенге, на конец отчетного месяца составила 1648,83 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 33,86%.

Облигации международных финансовых организаций

В отчетном периоде облигации международных финансовых организаций в состав портфеля не приобретались.

На отчетную дату средневзвешенная доходность к погашению по облигациям международных финансовых организаций Республики Казахстан, номинированным в тенге, составила 12,53% годовых.

Текущая стоимость облигаций международных финансовых организаций Республики Казахстан, номинированным в тенге, на конец отчетного месяца составила 188,25 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 3,87%.

Корпоративные облигации эмитентов-резидентов Республики Казахстан

В отчетном периоде в состав портфеля корпоративных облигации эмитентов-резидентов Республики Казахстан не приобретались.

На отчетную дату доходность к погашению по корпоративным облигациям эмитентов-резидентов Республики Казахстан составила 15,97% годовых.

Текущая стоимость корпоративных облигаций эмитентов-резидентов Республики Казахстан на конец отчетного месяца составила 441,96 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 9,08%.

Плановая доля долговых финансовых инструментов казахстанских эмитентов (государственных, квазигосударственных, и корпоративных), а также международных финансовых организаций, номинированных в тенге, в целевой структуре портфеля ПА ЕНПФ в доверительном управлении ВСС Invest – до 80%.

Корпоративные облигации иностранных эмитентов

В отчетном периоде в состав портфеля корпоративные облигации иностранных эмитентов не приобретались.

На отчетную дату средневзвешенная доходность к погашению по корпоративным облигациям иностранных эмитентов, номинированным в тенге, составила 11,39% годовых.

Текущая стоимость корпоративных облигации иностранных эмитентов составила 327,88 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 6,73%.

Акции и депозитарные расписки иностранных эмитентов и ETF

В отчетном периоде в состав портфеля акции и депозитарные расписки иностранных эмитентов и ETF не приобретались.

Текущая стоимость ETF на конец отчетного месяца составила 308,73 млн. тенге, доля в портфеле 6,34%.

Плановая доля ETF, акций и депозитарных расписок иностранных эмитентов в целевой структуре портфеля ПА ЕНПФ в доверительном управлении ВСС Invest – до 49%.

Акции и депозитарные расписки, выпущенные организациями Республики Казахстан

В отчетном периоде в состав портфеля акции и депозитарные расписки, выпущенные организациями Республики Казахстан, не приобретались.

Текущая стоимость акций и депозитарных расписок, выпущенных организациями Республики Казахстан, составила 75,07 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 1,54%.

Валютная структура

Инвестиционный портфель финансовых инструментов в разрезе валют, в которых номинированы финансовые инструменты, приобретенные за счет пенсионных активов ЕНПФ в доверительном управлении ВСС Invest, представлен в Таблице 2. В отчетном периоде сделки купли-продажи с иностранной валютой на Казахстанской фондовой бирже не заключались.

Таблица 2. Структура инвестиционного портфеля ПА ЕНПФ, находящихся в доверительном управлении ВСС Invest, в разрезе валют

| <i>млн. тенге</i> | | | | | |
|---------------------|------------------------------------------|-----------------------------|------------------------------------------|-----------------------------|--------------------------------------------|
| Валюта | Текущая стоимость на 01.01.2024г. | Доля на 01.01.2024г. | Текущая стоимость на 01.08.2024г. | Доля на 01.08.2024г. | Прирост/снижение за отчетный период |
| Национальная валюта | 2077,33 | 71,46% | 4 144,63 | 85,12% | 99,52% |
| Доллары США | 829,81 | 28,54% | 724,78 | 14,88% | -12,66% |
| Итого | 2 907,14 | 100,00% | 4 869,41 | 100,00% | 67,5% |

Результаты инвестиционной деятельности

В результате инвестиционной деятельности, размер начисленного инвестиционного дохода составил 377,10 млн. тенге. Доходность пенсионных активов составила 8,25%. Большая часть начисленного инвестиционного дохода пришлась на вознаграждения по ценным бумагам, в том числе по операциям обратное РЕПО. Структура начисленного инвестиционного дохода за указанный период представлена в Таблице 3.

Таблица 3. Структура инвестиционного дохода, полученного по ПА ЕНПФ, находящимся в доверительном управлении ВСС Invest

| <i>млн. тенге</i> | |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------|
| Наименование | Инвестиционный доход на 01.08.2024 год |
| Доходы в виде вознаграждения по ценным бумагам, в том числе по размещенным вкладам и операциям «обратное РЕПО» | 281,90 |
| Доходы (убытки) от рыночной переоценки ценных бумаг | 86,11 |
| Доходы (убытки) от переоценки иностранной валюты | 15,94 |
| Прочие доходы (убытки) | -6,85 |

| | |
|---------------|---------------|
| Итого: | 377,10 |
|---------------|---------------|

Информация о стоимости условной единицы

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

Таблица 4. Стоимость одной условной единицы ПА ЕНПФ, находящихся в доверительном управлении ВСС Invest

| № | Дата | Стоимость одной условной единицы, тенге |
|----|------------|--------------------------------------------|
| 1 | 01.07.2024 | 1 218,5870999 |
| 2 | 02.07.2024 | 1 218,5870999 |
| 3 | 03.07.2024 | 1 218,5870999 |
| 4 | 04.07.2024 | 1 218,5870999 |
| 5 | 05.07.2024 | 1 218,5870999 |
| 6 | 06.07.2024 | 1 218,5870999 |
| 7 | 07.07.2024 | 1 218,5870999 |
| 8 | 08.07.2024 | 1 218,5870999 |
| 9 | 09.07.2024 | 1 223,2703935 |
| 10 | 10.07.2024 | 1 223,2703935 |
| 11 | 11.07.2024 | 1 223,2703935 |
| 12 | 12.07.2024 | 1 223,2703935 |
| 13 | 13.07.2024 | 1 223,2703935 |
| 14 | 14.07.2024 | 1 223,2703935 |
| 15 | 15.07.2024 | 1 224,4586952 |
| 16 | 16.07.2024 | 1 224,4586952 |
| 17 | 17.07.2024 | 1 224,4586952 |
| 18 | 18.07.2024 | 1 224,4586952 |
| 19 | 19.07.2024 | 1 224,4586952 |
| 20 | 20.07.2024 | 1 224,4586952 |
| 21 | 21.07.2024 | 1 224,4586952 |
| 22 | 22.07.2024 | 1 222,8837765 |
| 23 | 23.07.2024 | 1 222,8837765 |
| 24 | 24.07.2024 | 1 222,8837765 |
| 25 | 25.07.2024 | 1 222,8837765 |
| 26 | 26.07.2024 | 1 222,8837765 |
| 27 | 27.07.2024 | 1 222,8837765 |
| 28 | 28.07.2024 | 1 222,8837765 |
| 29 | 29.07.2024 | 1 225,0901634 |
| 30 | 30.07.2024 | 1 225,0901634 |
| | 31.07.2024 | 1 225,6107188 |

Информация о соблюдении параметров инвестиционной декларации

Структурное распределение ПА ЕНПФ, находящихся в доверительном управлении ВСС Invest, 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 ВСС Invest, по состоянию на 1 августа 2024 года представлены в Таблице 5.

Таблица 5. Лимиты инвестирования по ПА ЕНПФ, находящимся в доверительном управлении ВСС Invest

| № | Вид финансового инструмента | Фактическое значение (в процентах от общего объема ПА в управлении) | Выполнение (да/нет) |
|---|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------|---------------------|
| 1 | Денежные средства в национальной валюте – тенге (KZT). | 0,56% | да |
| 2 | Ценные бумаги, являющиеся предметом операции обратного репо, заключенной «автоматическим» способом с участием центрального контрагента. | 9,23% | да |
| 3 | Иностранная валюта стран, имеющих суверенный рейтинг не ниже «ВВВ» 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). | 0,04% | да |
| 4 | 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. | 12,32% | да |
| 5 | Долговые ценные бумаги, выпущенные юридическим лицом, сто процентов акций которого принадлежат Национальному Банку Республики Казахстан. | 10,06% | да |
| 6 | Долговые ценные бумаги, выпущенные местными исполнительными органами Республики Казахстан. | 0,00% | да |
| 7 | 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. | 12,74% | да |
| 8 | Вклады в банках второго уровня Республики Казахстан, при соответствии одному из следующих условий: банки имеют долгосрочный кредитный рейтинг не ниже «ВВ-» 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 «А-» или рейтинговую оценку аналогичного уровня агентств | 0,00% | да |

| | | | |
|----|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------|----|
| | Moody's Investors Service (Мудис Инвесторс Сервис) или Fitch (Фич). | | |
| 9 | Вклады в банках-нерезидентах, имеющих долгосрочный рейтинг не ниже «А-» 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). | 0,00% | да |
| 10 | 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): 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 %. | 3,87% | да |
| 11 | Ценные бумаги, имеющие статус государственных, выпущенные центральными правительствами иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг не ниже «BB+» по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинговую оценку аналогичного уровня агентств Moody's Investors Service (Мудис Инвесторс Сервис) или Fitch (Фич). | 3,13 % | да |
| 12 | Негосударственные ценные бумаги, выпущенные иностранными организациями: | 6,73% | да |

| | | | |
|----|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------|----|
| | <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), и депозитарные расписки, базовым активом которых являются данные акции;</p> <p>акции иностранных эмитентов, входящие в состав основных фондовых индексов, и депозитарные расписки, базовым активом которых являются данные акции;</p> <p>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)</p> | | |
| 13 | <p>Негосударственные ценные бумаги, выпущенные организациями Республики Казахстан в соответствии с законодательством Республики Казахстан и других государств:</p> <p>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;</p> <p>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;</p> <p>акции юридических лиц, входящие в состав основных фондовых индексов;</p> <p>долговые ценные бумаги, имеющие 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>ценные бумаги, выпущенные в рамках реструктуризации обязательств эмитента в целях обмена на ранее выпущенные ценные бумаги либо иные обязательства данного эмитента</p> | 34,99% | да |
| 14 | <p>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</p> | 0,00% | да |

| | | | |
|----|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------|----|
| | номинальной стоимости данных негосударственных долговых ценных бумаг. | | |
| 15 | Паи Exchange Traded Funds (Эксчейндж Трэдэд Фандс), Exchange Traded Commodities (Эксчейндж Трэдэд Коммодитис), Exchange Traded Notes (Эксчейндж Трэдэд Ноутс), имеющие рейтинговую оценку не ниже «3 звезды» рейтингового агентства Morningstar (Морнингстар); Паи Exchange Traded Funds (Эксчейндж Трэдэд Фандс), структура активов которых повторяет структуру одного из основных фондовых индексов, или ценообразование по паям которых привязано к основным фондовым индексам. | 6,34 % | да |
| 16 | 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. | 0,00% | да |
| 17 | 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 «АА» агентства Standard & Poor's или рейтингом аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, на срок не более двенадцати месяцев. | 0,00% | да |
| 18 | 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: опционы; фьючерсы; форварды; свопы; производные финансовые инструменты, представляющие собой комбинацию вышеперечисленных производных финансовых инструментов. | 0,00% | да |
| 19 | Максимальная доля открытой валютной позиции | 14,88% | да |

Информация по покупкам, продажам и погашениям финансовых инструментов, находящихся в инвестиционном портфеле ПА ЕНПФ в доверительном управлении ВСС Invest

Таблица 6. Сведения по приобретению финансовых инструментов в отчетном месяце

| Вид инструмента | Валюта | Эмитент ценной бумаги | Сумма сделки в тенге |
|-----------------|--------|-----------------------|----------------------|
| Облигация | USD | Правительство США | 78 963 172,09 |

| | | | |
|--------------|-----|-----------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------|
| Облигация | KZT | Акционерное общество "Жилищный строительный сберегательный банк "Отбасы банк"" | 200 000 000 |
| Итого | | | 278 963 172,09 |

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 | Сумма 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 |
|-----------------|--------|--------------------|----------------------|
| | | | |
| Итого | | | |

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

| Вид инструмента | Валюта | Наименование банка | Сумма к погашению в тенге |
|-----------------|--------|--------------------|---------------------------|
| | | | |
| Итого | | | |

Примечание. О мерах надзорного реагирования, примененных в отношении BCC Invest, информация размещена на сайте адресу: www.bcc-invest.kz