

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

По состоянию на 1 октября 2023 года пенсионные активы (далее – ПА) АО «ЕНПФ» (далее – ЕНПФ), находящиеся в доверительном управлении АО «Halyk Global Markets» (далее – Halyk Global Markets), составили **2 609,22** 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

млн. тенге

Наименование	Текущая стоимость на 01.01.2023г.	Доля на 01.01.2023г.	Текущая стоимость на 01.10.2023г.	Доля на 01.10.2023г.	Прирост/ снижение с 01.01.2023 г.
Облигации банков второго уровня РК	49,39	1,88%	50,02	1,92%	1,29%
Облигации МФО	115,27	4,38%	278,86	10,69%	141,93%
Корпоративные облигации организаций РК	121,62	4,62%	122,69	4,70%	0,88%
Облигации квазигосударственных организаций РК	330,81	12,57%	414,34	15,88%	25,25%
Долевые инструменты иностранных эмитентов (Паи ETF)	334,78	12,72%	201,53	7,72%	-39,80%
Ноты НБРК	0,00	0,00%	725,19	27,79%	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%	217,86	8,35%	21,89%
Обратное РЕПО (не более 90 календарных дней)	1 307,42	49,69%	324,39	12,43%	-75,19%
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%	274,34	10,51%	338,87%
Итого ПА, находящиеся в управлении Halyk Global Markets	2 631,21	100,00%	2 609,22	100,00%	-0,84%
Обязательства к оплате по совершенным сделкам	-	-	-	-	-
Итого пенсионные активы	2 631,21	100,00%	2 609,22	100,00%	-0,84%

По состоянию на 01.10.2023 г. средневзвешенная доходность долговых финансовых инструментов, номинированных в тенге, составила 12,04% годовых. Средневзвешенная доходность долговых финансовых инструментов, номинированных в долларах США, составила 13,22%.

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 324,39 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 12,43%. Средневзвешенная доходность операций обратного РЕПО на отчетную дату составила 16,90% 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 50,02 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 1,92%.

Средневзвешенная доходность к погашению облигаций банков второго уровня РК на отчетную дату составила 11,12% годовых.

Облигации международных финансовых организаций

Текущая стоимость облигаций международных финансовых организаций за отчетный месяц снизилась на 7,95 млн тенге и составила 278,86 млн. тенге. Доля в портфеле облигаций международных финансовых организаций составила 10,69%.

Средневзвешенная доходность к погашению по облигациям международных финансовых организаций, номинированным в тенге, с фиксированной ставкой вознаграждения составила 8,16% годовых.

Корпоративные облигации эмитентов РК

Текущая стоимость корпоративных облигаций эмитентов РК за отчетный месяц увеличилась на 1,10 млн. тенге и составила 122,69 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 4,70%.

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 рассматриваемом периоде из портфеля были полностью проданы паи ETF Vanguard S&P 500 ETF и SPDR S&P 500 ETF TRUST на общую сумму 419,07 млн тенге. На высвобожденную ликвидность от продажи данных ETF были приобретены паи ETF iShares 5-10 Year Investment Grade Corporate Bond ETF и iShares 7-10 Year Treasury Bond ETF на общую сумму 203,40 млн тенге. В результате текущая стоимость долевых инструментов иностранных эмитентов (ПАИ ETF) за отчетный месяц снизилась на 210,05 млн. тенге и составила 201,53 млн. тенге. Доля долевых инструментов иностранных эмитентов (ПАИ ETF) в портфеле составила 7,72%.

Ноты Национального Банка Республики Казахстан

Текущая стоимость нот Национального Банка Республики Казахстана составила 725,19 млн тенге. Их доля в портфеле составила 27,79%.

В рассматриваемом периоде были приобретены 28-дневные ноты НБРК в объеме 731 млн тенге по номинальной стоимости с доходностью 16,36%.

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 выросла на 35,09 млн. тенге и составила 217,86 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 8,35%.

Средневзвешенная доходность к погашению ценных бумаг, имеющих статус государственных, выпущенных центральными правительствами иностранных государств, на отчетную дату составила 13,22% годовых.

Облигации квазигосударственных организаций РК

В отчетном периоде погасились облигации АО «Казахстанский фонд устойчивости» на сумму 100 млн тенге. В результате текущая стоимость облигаций квазигосударственных организаций РК за отчетный месяц снизилась на 104,73 млн. тенге и составила 414,34 млн. тенге. Доля облигаций квазигосударственных организаций РК в портфеле составила 15,88%.

Средневзвешенная доходность к погашению облигаций квазигосударственных организаций РК, номинированных в тенге, на отчетную дату составила 15,09% 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

Валюта	Текущая стоимость на 01.01.2023г.	Доля на 01.01.2023г.	Текущая стоимость на 01.10.2023г.	Доля на 01.10.2023г.	Прирост/снижение с 01.01.2023г.
Национальная валюта	2 095,80	79,65%	1 975,79	75,72%	-5,73%
Доллары США	535,40	20,35%	633,43	24,28%	18,31%
Евро	0	0,00%	0,01	0,001%	0,00%
Итого:	2 631,21	100,00%	2 609,22	100,00%	-0,84%

млн. тенге

Результаты инвестиционной деятельности

В результате инвестиционной деятельности, размер начисленного инвестиционного дохода (по состоянию на 01 октября 2023 года с 15 марта 2021 г.) составил 570,81 млн. тенге и размер начисленного инвестиционного дохода (по состоянию на 01 октября 2023 года с 01 января 2023 года) составил 347,41 млн. тенге. Доходность пенсионных активов составила 28,25% с начала деятельности и 13,54% 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

Наименование	Инвестиционный доход с начала 2023 года.
Доходы в виде вознаграждения по ценным бумагам, в том числе по размещенным вкладам и операциям «обратное РЕПО»	224,50
Доходы (убытки) от рыночной переоценки ценных бумаг	103,25
Доходы (убытки) от переоценки иностранной валюты	20,87
Прочие доходы (убытки)	-1,21
Итого:	347,41

млн. тенге

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	01.09.2023	1 134,3484941
2	02.09.2023	1 134,3484941

№	Дата	Стоимость одной условной единицы
3	03.09.2023	1 134,3484941
4	04.09.2023	1 138,5006819
5	05.09.2023	1 138,5006819
6	06.09.2023	1 138,5006819
7	07.09.2023	1 138,5006819
8	08.09.2023	1 138,5006819
9	09.09.2023	1 138,5006819
10	10.09.2023	1 138,5006819
11	11.09.2023	1 142,7488579
12	12.09.2023	1 142,7488579
13	13.09.2023	1 142,7488579
14	14.09.2023	1 142,7488579
15	15.09.2023	1 142,7488579
16	16.09.2023	1 142,7488579
17	17.09.2023	1 142,7488579
18	18.09.2023	1 148,1468586
19	19.09.2023	1 148,1468586
20	20.09.2023	1 148,1468586
21	21.09.2023	1 148,1468586
22	22.09.2023	1 148,1468586
23	23.09.2023	1 148,1468586
24	24.09.2023	1 148,1468586
25	25.09.2023	1 152,5041314
26	26.09.2023	1 152,5041314
27	27.09.2023	1 152,5041314
28	28.09.2023	1 152,5041314
29	29.09.2023	1 152,5041314
30	30.09.2023	1 153,5561865

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 октября 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 ПА)	Выполнение (да/нет)
1	Денежные средства, включая остатки на банковских счетах	10,51%	да
2	Обратное репо	12,43%	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

№	Вид финансового инструмента	Фактическое значение (в процентах от ПА)	Выполнение (да/нет)
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	27,79%	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	3,79%	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	7,21%	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>	10,69%	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>	8,35%	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>	7,72%	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	<p>Негосударственные ценные бумаги, выпущенные иностранными организациями:</p> <p>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;</p> <p>2) акции иностранных эмитентов, входящие в состав основных фондовых индексов, и депозитарные расписки, базовым активом которых являются данные акции;</p>		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)		да
15	<p>Негосударственные ценные бумаги, выпущенные организациями Республики Казахстан в соответствии с законодательством Республики Казахстан и других государств:</p> <p>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;</p> <p>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;</p> <p>3) акции юридических лиц, входящие в состав основных фондовых индексов;</p>		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>	11,50%	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)	8,20%	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	7,72%	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_2837)	KZT	ГУ "Национальный Банк Республики Казахстан"	500 171 386,00
Ноты НБ РК (NTK028_2836)	KZT	ГУ "Национальный Банк Республики Казахстан"	222 408 225,00
Паи Exchange Traded Funds (ETF)	USD	iShares 5-10 Year Investment Grade Corporate Bond ETF	101 724 123,62
Паи Exchange Traded Funds (ETF)	USD	iShares 7-10 Year Treasury Bond ETF	101 674 175,25
ГЦБ иностранных государств	USD	Правительство США в лице Казначейства	28 932 454,38
Итого			954 910 364,25

Таблица 7. Сведения по продаже финансовых инструментов в отчетном месяце

Вид инструмента	Валюта	Эмитент ценной бумаги	Стоимость сделки, в тенге
Паи Exchange Traded Funds (ETF)	USD	Vanguard S&P 500 ETF	209 540 639,81

Паи Exchange Traded Funds (ETF)	USD	SPDR S&P 500 ETF TRUST	209 533 064,11
Итого			419 073 703,92

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

Вид инструмента	Валюта	Эмитент ценной бумаги	Стоимость сделки, в тенге
Облигации квазигосударственных организаций РК	KZT	АО «Казахстанский фонд устойчивости»	100 000 000,00
Ноты НБ РК	KZT	ГУ "Национальный Банк Республики Казахстан"	215 000 000,00
Итого			315 000 000,00

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			