

Информация по инвестиционному управлению пенсионными активами АО «ЕНПФ»

По состоянию на 1 апреля 2022 года пенсионные активы (далее – ПА) ЕНПФ, находящиеся в доверительном управлении АО «Halyk Global Markets» (далее – Halyk Global Markets), составили **2 423,96** 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

Наименование	Текущая стоимость на 01.01.2022 г.	Доля на 01.01.2022 г.	Текущая стоимость на 01.04.2022 г.	Доля на 01.04.2022 г.	Прирост/снижение с 01.01.2022 г.
Обратное РЕПО (не более 90 календарных дней)	892,98	43,33%	1 083,08	44,68%	21,29%
Ноты НБРК	0	0,00%	0	0,00%	
Облигации банков второго уровня РК	155,3	7,54%	157,26	6,49%	1,27%
МФО	120,2	5,83%	123,35	5,09%	2,62%
Долевые инструменты иностранных эмитентов (Паи ETF)	288,4	13,99%	454,22	18,74%	57,50%
Акции и депозитарные расписки иностранных эмитентов	180,38	8,75%	184,78	7,62%	2,44%
Денежные средства на счетах	1,02	0,05%	1,32	0,05%	28,89%
Корпоративные облигации организаций РК	125,67	6,10%	122,37	5,05%	-2,63%
Прочие активы (дебиторская задолженность, просроченная задолженность, провизии)	0,38	0,02%	1,08	0,04%	185,14%
Облигации квазигосударственных организаций РК	296,51	14,39%	296,51	12,23%	0,00%
Итого ПА, находящиеся в управлении Halyk Global Markets	2 060,84		2 423,96		17,62%
Обязательства к оплате по совершенным сделкам	0		0		
Итого пенсионные активы	2 060,84	100,00%	2 423,96	100,00%	17,62%

млн. тенге

По состоянию на 01.04.2022г. средневзвешенная доходность долговых финансовых инструментов и операций обратного РЕПО, находящихся в инвестиционном портфеле ПА ЕНПФ, находящихся в доверительном управлении Halyk Global Markets, номинированных в тенге составила 12,48% годовых.

Операции обратного РЕПО (не более 90 календарных дней).

В инвестиционном портфеле ПА ЕНПФ, находящихся в доверительном управлении Halyk Global Markets, присутствует операции обратного РЕПО, текущая стоимость которых за отчетный месяц выросла на 157,21 млн тенге и составила 1 083,08 млн тенге. Их доля в портфеле составила 44,68%. Средневзвешенная доходность операций обратного РЕПО, в инвестиционном портфеле ПА ЕНПФ, находящихся в доверительном управлении Halyk Global Markets, номинированных в тенге, на отчетную дату составила 13,96% годовых.

Облигации банков второго уровня Республики Казахстан.

В дополнение к этому, в инвестиционном портфеле ПА ЕНПФ, находящихся в доверительном управлении Halyk Global Markets, присутствуют облигации банков второго уровня Республики Казахстан, текущая стоимость которых за отчетный месяц увеличилась на 1,51 млн тенге и составила 157,26 млн тенге. Их доля в портфеле составила 6,49%.

Средневзвешенная доходность к погашению долговых ценных бумаг, банков второго уровня Республики Казахстан в инвестиционном портфеле ПА ЕНПФ, находящихся в доверительном управлении Halyk Global Markets, номинированных в тенге, на отчетную дату составила 9,70% годовых.

Облигации международных финансовых организаций

Текущая стоимость облигаций международных финансовых организаций за отчетный месяц увеличилась на 1,05 млн тенге и составила 123,35 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 5,09%.

Средневзвешенная доходность к погашению по облигациям международных финансовых организаций, номинированным в тенге, с фиксированной ставкой вознаграждения составила 11,70% годовых.

Долевые инструменты иностранных эмитентов (ПАИ ETF)

Также, в инвестиционном портфеле ПА ЕНПФ, находящихся в доверительном управлении Halyk Global Markets, присутствуют долевые инструменты иностранных эмитентов (ПАИ ETF), текущая стоимость которых за отчетный месяц выросла на 4,59 млн тенге и составила 454,22 млн тенге. Их доля в портфеле составила 18,74%.

Корпоративные облигации эмитентов РК

В дополнение к этому, в инвестиционном портфеле ПА ЕНПФ, находящихся в доверительном управлении Halyk Global Markets, присутствуют Корпоративные облигации эмитентов РК, текущая стоимость которых за отчетный месяц увеличилась на 1,10 млн тенге и составила 122,37 млн тенге. Их доля в портфеле составила 5,05%.

Средневзвешенная доходность к погашению корпоративных облигаций эмитентов РК в инвестиционном портфеле ПА ЕНПФ, находящихся в доверительном управлении Halyk Global Markets, номинированных в тенге, на отчетную дату составила 11,01% годовых.

Акции и депозитарные расписки иностранных эмитентов

Также, в инвестиционном портфеле ПА ЕНПФ, находящихся в доверительном управлении Halyk Global Markets, присутствуют акции иностранных эмитентов, текущая стоимость которых за отчетный месяц уменьшилась на 8,22 млн тенге и составила 184,78 млн тенге. Их доля в портфеле составила 7,62%.

Облигации квазигосударственных организаций РК

В дополнение к этому, в инвестиционном портфеле ПА ЕНПФ, находящихся в доверительном управлении Halyk Global Markets, присутствуют облигации квазигосударственных организаций РК, текущая стоимость которых за отчетный месяц увеличилась на 2,38 млн тенге и составила 296,51 млн тенге. Их доля в портфеле составила 12,23%.

Средневзвешенная доходность к погашению облигаций квазигосударственных организаций РК в инвестиционном портфеле ПА ЕНПФ, находящихся в доверительном управлении Halyk Global Markets, номинированных в тенге, на отчетную дату составила 9,72% 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

млн. тенге

Валюта	Текущая стоимость на 01.01.2022г.	Доля на 01.01.2022г.	Текущая стоимость на 01.04.2022г.	Доля на 01.04.2022г.	Прирост/снижение с 01.01.2022 г.
Национальная валюта	1 591,16	77,21%	1 783,79	73,59%	12,11%
Доллары США	469,68	22,79%	640,17	26,41%	36,30%
Итого:	2 060,84	100,00%	2 423,96	100,00%	17,62%

Результаты инвестиционной деятельности

В результате инвестиционной деятельности, размер начисленного инвестиционного дохода (по состоянию на 01 апреля 2022 года с момента передачи активов) составил 206,77 млн тенге и размер начисленного инвестиционного дохода (по состоянию на 01 апреля 2022 года с 01 января 2022 года) составил 93,98 млн тенге. Доходность пенсионных активов составила 12,79% с начала деятельности и 4,04% с начала 2022 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

млн. тенге

Наименование	Инвестиционный доход с начала 2022 года.
Доходы в виде вознаграждения по ценным бумагам, в том числе по размещенным вкладам и операциям «обратное РЕПО»	47,15
Доходы (убытки) от рыночной переоценки ценных бумаг	46,73
Доходы (убытки) от переоценки иностранной валюты	1,50
Прочие доходы (убытки)	-1,40
Итого:	93,98

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	01.03.2022	1 008,8010325

2	02.03.2022	1 008,8010325
3	03.03.2022	1 008,8010325
4	04.03.2022	1 008,8010325
5	05.03.2022	1 008,8010325
6	06.03.2022	1 008,8010325
7	07.03.2022	1 008,8010325
8	08.03.2022	1 008,8010325
9	09.03.2022	1 000,2979092
10	10.03.2022	1 000,2979092
11	11.03.2022	1 000,2979092
12	12.03.2022	1 000,2979092
13	13.03.2022	1 000,2979092
14	14.03.2022	1 003,7380346
15	15.03.2022	1 003,7380346
16	16.03.2022	1 003,7380346
17	17.03.2022	1 003,7380346
18	18.03.2022	1 003,7380346
19	19.03.2022	1 003,7380346
20	20.03.2022	1 003,7380346
21	21.03.2022	1 003,7380346
22	22.03.2022	1 003,7380346
23	23.03.2022	1 003,7380346
24	24.03.2022	1 013,1179087
25	25.03.2022	1 013,1179087
26	26.03.2022	1 013,1179087
27	27.03.2022	1 013,1179087
28	28.03.2022	1 013,8980680
29	29.03.2022	1 013,8980680
30	30.03.2022	1 013,8980680
31	31.03.2022	1 014,5264910

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 апреля 2022 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)
	Денежные средства, включая остатки на банковских счетах	0,10%	да
	Обратное РЕПО	44,68%	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

1	Государственные ценные бумаги Республики Казахстан, выпущенные Министерством финансов РК и НБ РК, долговые ценные бумаги, выпущенные местными исполнительными органами РК, долговые ценные бумаги, выпущенные юридическим лицом, сто процентов акций которого принадлежат НБ РК	0,00%	да
2	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	0,00%	да
3	Государственные, агентские и ценные бумаги международных финансовых организаций, имеющие рейтинговую оценку ценной бумаги и/или эмитента не ниже «BB+» по международной шкале агентства «Standard & Poor's» или рейтинговой оценкой аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств	0,00%	да
4	Вклады в банках второго уровня Республики Казахстан	0,00%	да
5	Вклады в банках-нерезидентах	0,00%	да
6	Долговые ценные бумаги, выпущенные международными финансовыми организациями	5,09%	да
7	Ценные бумаги, имеющие статус государственных, выпущенные центральными правительствами иностранных государств	0,00%	да
8	Акции и депозитарные расписки иностранных эмитентов, паи Exchange Traded Funds (ETF), Exchange Traded Commodities (ETC), Exchange Traded Notes (ETN)	26,36%	да
9	Долговые ценные бумаги, иностранных негосударственных эмитентов	0,00%	да
10	Акции и депозитарные расписки эмитентов РК, паи интервальных паевых инвестиционных фондов, управляющая компания которых является юридическим лицом, созданным в соответствии с законодательством Республики Казахстан	0,00%	да
11	Долговые ценные бумаги, негосударственных эмитентов РК	23,77%	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