

**«Сентрас Секьюритиз» АҚ сенімгерлік басқаруындағы
«БЖЗҚ» АҚ зейнетақы активтерінің
инвестициялық басқару бойынша ақпарат**

2023 жылғы 1 желтоқсандағы жағдай бойынша «Сентрас Секьюритиз» АҚ (бұдан әрі – Сентрас Секьюритиз) сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ зейнетақы активтері (бұдан әрі – ЗА) 987,40 млн. теңгені құрап отыр.

Сентрас Секьюритиз сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ зейнетақы активтері есебінен құралған қаржы құралдарының инвестициялық портфельінің құрылымы 1-кестеде берілді.

1-кесте. Қаржы құралдарының бөлігінде Сентрас Секьюритиз сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфельінің құрылымы

Атауы	01.01.2023 жылға ағымдағы құны	01.01.2023 жылға үлесі	01.12.2023 жылға ағымдағы құны	01.12.2023 жылға үлесі	Жыл басынан бергі өсу/төмендеу
ҚР ҚМ МБҚ	696,58	68,78%	340,74	34,51%	-51,08%
ҚР квазимемлекеттік ұйымдарының облигациялары	86,90	8,58%	190,74	19,32%	119,49%
ҚР ЕДБ облигациялары	-	-	165,81	16,79%	-
ҚР эмитенттерінің акциялары мен депозитарлық қолхаттары	82,61	8,16%	85,38	8,65%	3,36%
Шетелдік эмитенттердің үлестік құралдары (ETF пайлары)	26,98	2,66%	9,12	0,92%	234,98%
АҚШ Мемлекеттік облигациялары	-	-	81,26	8,23%	-
Репо	-	-	89,07	9,02%	0,00%
Басқа активтер (дебиторлық берешек, мерзімі өткен берешек, провизиялар)	-	-	1,06	0,11%	-
Инвестициялық шоттардағы ақшалай қаражат	119,76	11,82%	24,23	2,45%	-79,77%
ИПБ басқаруындағы ЗА жиынтығы	1012,84	100,00%	987,40	100,00%	-2,51%
Жасалған мәмілелер бойынша төлемге міндеттемелер	-	-	-	-	-
Зейнетақы активтерінің жиынтығы	1012,84		987,40		-2,51%

01.12.2023 жылғы жағдай бойынша борыштық қаржы құралдарын өтеуге орташа алынған кірістілік (ҮТМ) – жылына 13,25%.

Инвестициялық шоттардағы ақшалай қаражат және кері РЕПО операциялары

Есепті кезең соңындағы инвестициялық шоттардағы ақшалай қаражат қалдығы – 24,23 млн. теңге. Олардың портфельдегі үлесі – 2,45%. Есепті кезең соңындағы РЕПО операциялары бойынша ақшалай қаражат қалдығы – 89,07 млн. теңге. Олардың портфельдегі үлесі – 9,02%. Есепті кезеңдегі кері РЕПО операцияларының орташа өлшенген кірістілігі – жылына 15,70%.

Қазақстан Республикасы Қаржы министрлігінің мемлекеттік бағалы қағаздары

Портфельдің негізгі үлесін алып тұрған Қазақстан Республикасы Қаржы министрлігінің мемлекеттік бағалы қағаздарының ағымдағы құны есепті ай соңында 340,74 млн. теңге болды. Олардың портфельдегі үлесі – 34,51%. Есепті күндегі теңгемен номиналданған ҚР Қаржы министрлігінің МБҚ бойынша өтеуге орташа алынған кірістілік – жылына 13,12%.

Есепті кезеңде Қазақстан Республикасы Қаржы министрлігінің облигациялары сатылды.

ҚР квазимемлекеттік ұйымдарының облигациялары

Есепті күндегі Қазақстан Республикасының квазимемлекеттік ұйымдарының облигациялары бойынша өтелуі тиіс орташа өлшенген кірістілік – АҚШ долларымен жылына 6,89% және теңгемен жылына 16,60%. Қазақстан Республикасының квазимемлекеттік ұйымдары облигацияларының ағымдағы құны есепті ай соңында 190,74 млн. теңге болып отыр. Олардың портфельдегі үлесі – 19,32%.

Есепті кезеңде «Қазақстанның тұрақтылық қоры» АҚ купондық облигациялары сатып алынды.

ҚР ЕДБ облигациялары

Есепті күндегі облигациялар бойынша өтелуі тиіс орташа өлшенген кірістілік – жылына 18,46%. Есепті ай соңында облигациялардың ағымдағы құны 165,81 млн. теңге болды. Олардың портфельдегі үлесі – 16,79%.

Есепті кезеңде «Home Credit Bank» АҚ купондық облигациялары және «Еуразиялық банк» АҚ субординатталған купондық облигациялары сатып алынды.

Қазақстан Республикасы эмитенттерінің акциялары мен депозитарлық қолхаттары

Қазақстан Республикасы эмитенттерінің акциялары мен депозитарлық қолхаттарының ағымдағы құны есепті ай соңында 85,38 млн. теңге болды. Олардың портфельдегі үлесі – 8,65%.

Шетелдік эмитенттердің үлестік құралдары (ETF пайлары)

Шетелдік эмитенттердің үлестік құралдарының (ETF пайлары) ағымдағы құны есепті ай соңында 9,12 млн. теңге болды. Олардың портфельдегі үлесі – 0,92%.

АҚШ Қаржы министрлігінің облигациялары

Есепті кезеңде US Treasury қазынашылық міндеттемелері сатып алынды. Есепті ай соңында АҚШ Қаржы министрлігі облигацияларының ағымдағы құны 81,26 млн. теңге болды. Олардың портфельдегі үлесі – 8,23%.

Валюталық құрылым

Сентрас Секьюритиз сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ зейнетақы активтерінің есебінен сатып алынған қаржы құралдары номиналданған валюталар бөлігінде қаржы құралдарының инвестициялық портфелі 2-кестеде берілді.

2-кесте. Валюталар бөлігінде Сентрас Секьюритиз сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфелінің құрылымы

Валюта	01.01.2023 жылғы ағымдағы құны	01.01.2023 жылғы үлесі	01.12.2023 жылғы ағымдағы құны	01.12.2023 жылғы үлесі	Жыл басынан бергі өсу/төмендеу
Ұлттық валюта	806,73	79,65%	749,80	75,94%	-7,06%
АҚШ доллары	206,11	20,35%	237,61	24,06%	15,28%
Жиыны:	1012,84	100%	987,40	100%	-2,51%

млн теңге

Инвестициялық қызмет нәтижесі

Инвестициялық қызметтің және қаржы құралдарының нарықтық құнының өзгеруі нәтижесінде 2023 жыл басынан бері есептелген инвестициялық табыс мөлшері 89,83 млн. теңге болды. 2023 жыл басынан бергі зейнетақы активтерінің кірістілігі 9,11% болып отыр.

Көрсетілген кезеңдегі есептелген инвестициялық табыс құрылымы 3-кестеде берілді.

3-кесте. Сентрас Секьюритиз сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА бойынша алған инвестициялық табыс құрылымы

млн теңге

Атауы	2023 жылғы инвестициялық табыс
Бағалы қағаздар бойынша, оның ішінде орналастырылған салымдар және «кері РЕПО» операциялары бойынша сыйақы түріндегі табыс	87,28
Бағалы қағаздарды нарықтық қайта бағалаудан, шетелдік валютаны қайта бағалаудан түскен табыс (шығын) және басқа табыс (шығын)	1,46
Шетелдік валютаны қайта бағалаудан түскен табыс (шығын)	-2,91
Басқа активтерді қайта бағалаудан түскен табыс (шығын) (БҚҚ)	-
Сыртқы басқарудағы активтер бойынша табыс (шығын)	-
Басқа табыс (шығын)	4,00
Жиыны:	89,83

Шартты бірлік құны туралы ақпарат

Сентрас Секьюритиз сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА шартты зейнетақы бірлігі құнының динамикасы 4-кестеде берілді.

4-кесте. Сентрас Секьюритиз сенімгерлік басқаруындағы бір шартты бірлік құны

№	Күні	Шартты бірліктің құны
1	01.11.2023	1114,5671300
2	02.11.2023	1114,5671300
3	03.11.2023	1114,5671300
4	04.11.2023	1114,5671300
5	05.11.2023	1114,5671300
6	06.11.2023	1110,2750447
7	07.11.2023	1110,2750447
8	08.11.2023	1110,2750447
9	09.11.2023	1110,2750447
10	10.11.2023	1110,2750447
11	11.11.2023	1110,2750447
12	12.11.2023	1110,2750447
13	13.11.2023	1121,8734286
14	14.11.2023	1121,8734286
15	15.11.2023	1121,8734286
16	16.11.2023	1121,8734286
17	17.11.2023	1121,8734286
18	18.11.2023	1121,8734286
19	19.11.2023	1121,8734286
20	20.11.2023	1122,3578357
21	21.11.2023	1122,3578357
22	22.11.2023	1122,3578357
23	23.11.2023	1122,3578357
24	24.11.2023	1122,3578357
25	25.11.2023	1122,3578357

26	26.11.2023	1122,3578357
27	27.11.2023	1126,9577691
28	28.11.2023	1126,9577691
29	29.11.2023	1126,9577691
30	30.11.2023	1127,1144014

Инвестициялық декларация өлшемдерін сақтау туралы ақпарат

Сентрас Секьюритиз сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА құрылымдық бөлу Инвестициялық декларация талаптарына сәйкес. Валюталық позициялар үлесі рұқсат етілген деңгей шегінде қалады және Инвестициялық декларацияның талаптарын бұзбайды. 2023 жылғы 1 желтоқсандағы жағдай бойынша Сентрас Секьюритиз сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА бойынша инвестициялау шектерін сақтау туралы мәлімет 5-кестеде берілді.

5-кесте. Сентрас Секьюритиз сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА бойынша инвестициялау шектері

№	Қаржы құралының түрі	Нақты мәні (ЗА жалпы көлемінен пайызбен)	Орындалуы (иә/жоқ)
1	Ұлттық валютадағы ақшалай қаражат – теңге (KZT)	0,36%	иә
2	Қаулыға сай басқа елдердің шетелдік валютасы	2,20%	иә
3	ҚР Қаржы министрлігі және ҚР Ұлттық Банкі шығарған ҚР мемлекеттік бағалы қағаздары (оның ішінде шетелдік мемлекеттердің заңнамасына сәйкес эмиссияланған), сондай-ақ ҚР Үкіметінің кепілімен және (немесе) кепілдігімен шығарылған БҚ	43,53%	иә
4	ҚР жергілікті атқару органдары шығарған борыштық БҚ	0,00%	иә
5	Акцияларының жүз пайызы ҚР Ұлттық Банкіне тиесілі заңды тұлға шығарған борыштық БҚ	0,00%	иә
6	ҚР және басқа мемлекеттердің заңнамасына сәйкес «Қазақстан Даму банкі», «Самұрық-Қазына» Ұлттық әл-ауқат қоры», «Бәйтерек» Ұлттық басқарушы холдингі», «Проблемалы кредиттер қоры» акционерлік қоғамдары шығарған борыштық БҚ	0,00%	иә
7	Қаулыға сай ҚР екінші деңгейдегі банктеріндегі салымдар	0,00%	иә
8	Қаулыға сай бейрезидент банктердегі салымдар	0,00%	иә
9	Standard & Poor's (Стандард энд Пурс) агенттігінің халықаралық шәкіл бойынша «BB+» деңгейінен төмен емес рейтинг бағасы немесе Moody's Investors Service (Мудис Инвесторс Сервис) немесе Fitch (Фич) агенттіктерінің ұқсас деңгейдегі рейтинг бағасы бар төмендегі халықаралық қаржы ұйымдары шығарған борыштық бағалы қағаздар: Азиялық даму банкі (the Asian Development Bank); Америкалық даму банкі (the Inter-American Development Bank); Африкалық даму банкі (the African Development Bank); Еуразиялық даму банкі (Eurasian Development Bank); Еуропалық қайта құру және даму банкі (the European Bank for Reconstruction and Development); Еуропалық инвестициялық банк (the European Investment Bank); Еуропалық Кеңестің Даму банкі (the Council of Europe Development Bank); Ислам жеке секторды дамыту корпорациясы (the Islamic Corporation for the Development of the Private Sector); Ислам даму банкі (the Islamic Development Bank); Көпқырлы инвестициялар кепілі агенттігі (the Multilateral Investment Guarantee Agency); Скандинав инвестициялық банкі (the Nordic Investment Bank); Халықаралық валюта қоры (the International Monetary Fund); Халықаралық даму қауымдастығы (the International Development Association); Халықаралық инвестициялық дауларды реттеу орталығы (the International Centre for Settlement of Investment Disputes); Халықаралық қайта құру және даму банкі (the International Bank for Reconstruction and Development); Халықаралық қаржы корпорациясы (the International Finance Corporation).	10,70%	иә
10	Қаулыға сай шетелдік мемлекеттердің үкіметтері шығарған мемлекеттік мәртебесі бар БҚ	0,00%	иә

11	<p>Шетелдік ұйымдар шығарған мемлекеттік емес БҚ:</p> <p>*Standard & Poor's (Стандард энд Пурс) агенттігінің халықаралық шәкіл бойынша «BB» деңгейінен төмен емес рейтинг бағасы немесе Moody's Investors Service (Мудис Инвесторс Сервис) немесе Fitch (Фич) агенттіктерінің ұқсас деңгейдегі рейтинг бағасы бар шетелдік эмитенттердің акциялары;</p> <p>*негізгі қор индекстері құрамына кіретін шетелдік эмитенттердің акциялары және осы акциялар базалық активі болып табылатын депозитарлық қолхаттар;</p> <p>* Standard & Poor's (Стандард энд Пурс) агенттігінің халықаралық шәкіл бойынша «BB» деңгейінен төмен емес рейтинг бағасы немесе Moody's Investors Service (Мудис Инвесторс Сервис) немесе Fitch (Фич) агенттіктерінің ұқсас деңгейдегі рейтинг бағасы бар борыштық БҚ</p>	0,00%	иә
12	Қаулыға сай ҚР және басқа мемлекеттердің заңнамасына сәйкес ҚР ұйымдары шығарған мемлекеттік емес БҚ	44,76%	иә
13	Қаулыға сай Exchange Traded Funds (Эксчейндж Трэдэд Фандс), Exchange, Traded Commodities (Эксчейндж Трэдэд Коммодитис), Exchange Traded Notes (Эксчейндж Трэдэд Ноутс) пайлары	9,15%	иә
14	Қаулыға сай қор биржасының ресми тізіміне қосылған ҚР заңнамасына сәйкес құрылған заңды тұлға басқарушы компаниясы болып табылатын интервал пайлық инвестициялық қорлардың пайлары	0,00%	иә
15	Қаулыға сай аффинирленген асыл металдар	0,00%	иә
16	Қаулыға сай хеджирлеу мақсатында жасалған туынды қаржы құралдары	0,00%	иә

Сентрас Секьюритиз сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфеліндегі қаржы құралдарын сатып алу, сату және өтеу бойынша ақпарат

6-кесте. Есепті айдағы қаржы құралдарын сатып алу бойынша мәлімет

Құрал түрі	Валюта	Бағалы қағаз эмитенті	Теңгемен номиналды құны
қазынашылық міндеттемелер	USD	US Treasury	83 160 872,91
купондық облигациялар	KZT	«Home Credit Bank» АҚ	40 000 473,92
субордталған купондық облигациялар	KZT	«Еуразиялық банк» АҚ	81 294 880,00
купондық облигациялар	KZT	«Қазақстанның тұрақтылық қоры» АҚ	105 322 533,33
купондық облигациялар	KZT	«Home Credit Bank» АҚ	30 927 850,00
Жиыны			340 706 610,16

7-кесте. Есепті айдағы қаржы құралдарын сату бойынша мәлімет

Құрал түрі	Валюта	Бағалы қағаз эмитенті	Теңгемен мәміле сомасы
купондық МЕУКАМ	KZT	Қазақстан Республикасының Қаржы министрлігі	56 795 219,25
купондық МЕУКАМ	KZT	Қазақстан Республикасының Қаржы министрлігі	137 669 070,85
Жиыны		-	194 464 290,10

Құрал түрі	Валюта	Бағалы қағаз эмитенті	Теңгемен мәміле сомасы
Жиыны		-	-

8-кесте. Есепті айдағы бағалы қағаздар бойынша негізгі борышты өтеу бойынша мәлімет

Құрал түрі	Валюта	Бағалы қағаз эмитенті	Теңгемен мәміле сомасы
Есепті айда бағалы қағаздар бойынша өтеу болған жоқ			
Жиыны			-

9-кесте. Есепті айдағы шетелдік банктердегі салымдарға орналастыру бойынша мәлімет

Құрал түрі	Валюта	Банк атауы	Теңгемен мәміле сомасы
Есепті айда шетелдік банктердегі салымдарға орналастыру болған жоқ			
Жиыны			-

10-кесте. Есепті айдағы салымдар бойынша негізгі борышты өтеу бойынша мәлімет

Құрал түрі	Валюта	Банк атауы	Теңгемен мәміле сомасы
Есепті айда салымдар бойынша негізгі борышты өтеу болған жоқ			
Жиыны			-

**пенсионными активами АО «ЕНПФ»
в доверительном управлении АО «Сентрас Секьюритиз»**

По состоянию на 1 декабря 2023 года пенсионные активы (далее – ПА) ЕНПФ, находящиеся в доверительном управлении АО «Сентрас Секьюритиз» (далее – Сентрас Секьюритиз), составили 987,40 млн. тенге.

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

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

млн. тенге

Наименование	Текущая стоимость на 01.01.2023 г.	Доля на 01.01.2023 г.	Текущая стоимость на 01.12.2023 г.	Доля на 01.12.2023 г.	Прирост/снижение с начала года.
ГЦБ МФ РК	696,58	68,78%	340,74	34,51%	-51,08%
Облигации квазигосударственных организаций РК	86,90	8,58%	190,74	19,32%	119,49%
Облигации БВУ РК	-	-	165,81	16,79%	-
Акции и депозитарные расписки эмитентов РК	82,61	8,16%	85,38	8,65%	3,36%
Долевые инструменты иностранных эмитентов (Паи ETF)	26,98	2,66%	90,38	9,15%	234,98%
Репо	-	-	89,07	9,02%	0,00%
Прочие активы (дебиторская задолженность, просроченная задолженность, провизии)	-	-	1,06	0,11%	-
Денежные средства на инвестиционных счетах	119,76	11,82%	24,23	2,45%	-79,77%
Итого ПА, находящиеся в управлении УИП	1012,84	100,00%	987,40	100,00%	-2,51%
Обязательства к оплате по совершенным сделкам	-	-	-	-	-
Итого пенсионные активы	1012,84		987,40		-2,51%

По состоянию на 01.12.2023 г. средневзвешенная доходность к погашению (YTM) долговых финансовых инструментов составила 14,16% годовых.

Денежные средства на инвестиционных счетах и операции обратное РЕПО

На конец отчетного периода остатки денежных средств на инвестиционных счетах составили 24,23 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 2,45%. На конец отчетного периода остатки денежных средств по операциям РЕПО составили 89,07 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 9,02%. Средневзвешенная доходность операций обратного РЕПО на отчетную дату составила 15,70% годовых.

Текущая стоимость государственных ценных бумаг Министерства финансов Республики Казахстан, которые занимают основную долю в портфеле, на конец отчетного месяца составила 340,74 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 34,51%. На отчетную дату средневзвешенная доходность к погашению по ГЦБ Министерства финансов РК, номинированным в тенге, составила 13,12% годовых.

В отчетном периоде были совершены продажи облигаций Министерства финансов Республики Казахстан.

Облигации квазигосударственных организаций Республики Казахстан

На отчетную дату средневзвешенная доходность к погашению по облигациям квазигосударственных организаций Республики Казахстан составила 6,89% годовых в долларах США и 16,60% годовых в тенге. Текущая стоимость облигаций квазигосударственных организаций Республики Казахстан на конец отчетного месяца составила 190,74 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 19,32%.

В отчетном периоде была совершена покупка купонных облигаций АО «Казахстанский фонд устойчивости».

Облигации БВУ РК

На отчетную дату средневзвешенная доходность к погашению по облигациям составила 18,46% годовых. Текущая стоимость облигаций на конец отчетного месяца составила 165,81 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 16,79%.

В отчетном периоде были совершены покупки купонных облигаций АО «Home Credit Bank» и субординированных купонных облигаций АО «Евразийский банк».

Акции и депозитарные расписки эмитентов Республики Казахстан

Текущая стоимость акций и депозитарных расписок эмитентов Республики Казахстан на конец отчетного месяца составила 85,38 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 8,65%.

Долевые инструменты иностранных эмитентов (Паи ETF)

Текущая стоимость долевых инструментов иностранных эмитентов (Паи ETF) на конец отчетного месяца составила 90,38 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 9,15%.

В отчетном периоде была совершена покупка казначейских обязательств US Treasury.

Валютная структура

Инвестиционный портфель финансовых инструментов в разрезе валют, в которых номинированы финансовые инструменты, приобретенные за счет пенсионных активов ЕНПФ в доверительном управлении Сентрас Секьюритиз, представлен в Таблице 2.

Таблица 2. Структура инвестиционного портфеля ПА ЕНПФ, находящихся в доверительном управлении Сентрас Секьюритиз, в разрезе валют

Валюта	Текущая стоимость на 01.01.2023 г.	Доля на 01.01.2023 г.	Текущая стоимость на 01.12.2023 г.	Доля на 01.12.2023 г.	Прирост/снижение с начала года
Национальная валюта	806,73	79,65%	749,80	75,94%	-7,06%
Доллары США	206,11	20,35%	237,61	24,06%	15,28%
Итого:	1012,84	100%	987,40	100%	-2,51%

млн. тенге

Результаты инвестиционной деятельности

В результате инвестиционной деятельности и изменения рыночной стоимости финансовых инструментов, размер начисленного инвестиционного дохода с начала 2023 года составил 89,83 млн. тенге. Доходность пенсионных активов с начала 2023 года составила 9,11%.

Структура начисленного инвестиционного дохода за указанный период представлена в Таблице 3.

Таблица 3. Структура инвестиционного дохода, полученного по ПА ЕНПФ, находящихся в доверительном управлении Сентрас Секьюритиз

Наименование	Инвестиционный доход за 2023 год
Доходы в виде вознаграждения по ценным бумагам, в том числе по размещенным вкладам и операциям «обратное РЕПО»	87,28
Доходы (убытки) от рыночной переоценки ценных бумаг, от переоценки иностранной валюты и прочие доходы (убытки)	1,46
Доходы (убытки) от переоценки иностранной валюты	-2,91
Доходы (убытки) от переоценки прочих активов (ПФИ)	-
Доходы (убытки) по активам, находящимся во внешнем управлении	-
Прочие доходы (убытки)	4,00
Итого:	89,83

млн. тенге

Информация о стоимости условной единицы

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

Таблица 4. Стоимость одной условной единицы, находящихся в доверительном управлении Сентрас Секьюритиз

№	Дата	Стоимость условной единицы
1	01.11.2023	1114,5671300
2	02.11.2023	1114,5671300
3	03.11.2023	1114,5671300
4	04.11.2023	1114,5671300
5	05.11.2023	1114,5671300
6	06.11.2023	1110,2750447
7	07.11.2023	1110,2750447
8	08.11.2023	1110,2750447
9	09.11.2023	1110,2750447
10	10.11.2023	1110,2750447
11	11.11.2023	1110,2750447
12	12.11.2023	1110,2750447
13	13.11.2023	1121,8734286
14	14.11.2023	1121,8734286
15	15.11.2023	1121,8734286
16	16.11.2023	1121,8734286
17	17.11.2023	1121,8734286

18	18.11.2023	1121,8734286
19	19.11.2023	1121,8734286
20	20.11.2023	1122,3578357
21	21.11.2023	1122,3578357
22	22.11.2023	1122,3578357
23	23.11.2023	1122,3578357
24	24.11.2023	1122,3578357
25	25.11.2023	1122,3578357
26	26.11.2023	1122,3578357
27	27.11.2023	1126,9577691
28	28.11.2023	1126,9577691
29	29.11.2023	1126,9577691
30	30.11.2023	1127,1144014

Информация о соблюдении параметров инвестиционной декларации

Структурное распределение ПА ЕНПФ, находящихся в доверительном управлении Центрас Секьюритиз, 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 Центрас Секьюритиз, по состоянию на 1 декабря 2023 года представлены в Таблице 5.

Таблица 5. Лимиты инвестирования по ПА ЕНПФ, находящихся в доверительном управлении Центрас Секьюритиз

№	Вид финансового инструмента	Фактическое значение (в процентах от общего объема ПА)	Выполнение (да/нет)
1	Денежные средства в национальной валюте – тенге (KZT)	0,36%	да
2	Иностранная валюта других стран, согласно Постановлению	2,20%	да
3	Государственные ценные бумаги РК (в том числе, эмитированные в соответствии с законодательством иностранных государств), выпущенные Министерством финансов РК и Национальным Банком РК, а также ЦБ, выпущенные под гарантию и (или) поручительство Правительства РК	43,53%	да
4	Долговые ЦБ, выпущенные местными исполнительными органами РК	0,00%	да
5	Долговые ЦБ, выпущенные юридическим лицом, сто процентов акций которого принадлежат Национальному Банку РК	0,00%	да
6	Долговые ЦБ, выпущенные акционерными обществами «Банк Развития Казахстана», «Фонд национального благосостояния «Самрук-Казына», «Национальный управляющий холдинг «Байтерек», «Фонд проблемных кредитов» в соответствии с законодательством РК и других государств	0,00%	да
7	Вклады в банках второго уровня РК, согласно Постановлению	0,00%	да
8	Вклады в банках-нерезидентах, согласно Постановлению	0,00%	да
9	Долговые ценные бумаги, выпущенные следующими международными финансовыми организациями, имеющие рейтинговую оценку не ниже «BB+» по международной шкале агентства Standard & Poor's (Стандарт энд	0,00%	да

	<p>Пурс) или рейтинговую оценку аналогичного уровня агентств Moody's Investors Service (Мудис Инвесторс Сервис) или Fitch (Фич);</p> <p>Азиатский банк развития (the Asian Development Bank);</p> <p>Межамериканский банк развития (the Inter-American Development Bank);</p> <p>Африканский банк развития (the African Development Bank);</p> <p>Европейский банк реконструкции и развития (the European Bank for Reconstruction and Development);</p> <p>Европейский инвестиционный банк (the European Investment Bank);</p> <p>Банк Развития Европейского Совета (the Council of Europe Development Bank);</p> <p>Исламская корпорация по развитию частного сектора (the Islamic Corporation for the Development of the Private Sector);</p> <p>Исламский банк развития (the Islamic Development Bank);</p> <p>Многостороннее агентство гарантии инвестиций (the Multilateral Investment Guarantee Agency);</p> <p>Скандинавский инвестиционный банк (the Nordic Investment Bank);</p> <p>Международный валютный фонд (the International Monetary Fund);</p> <p>Международная ассоциация развития (the International Development Association);</p> <p>Международный центр по урегулированию инвестиционных споров (the International Centre for Settlement of Investment Disputes);</p> <p>Международный банк реконструкции и развития (the International Bank for Reconstruction and Development);</p> <p>Международная финансовая корпорация (the International Finance Corporation);</p> <p>а также ценные бумаги, выпущенные международной финансовой организацией, доля Республики Казахстан в уставном капитале которой составляет не менее 25%</p>		
10	ЦБ, имеющие статус государственных, выпущенные правительствами иностранных государств, согласно Постановлению	0,00%	да
11	<p>Негосударственные ЦБ, выпущенные иностранными организациями:</p> <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);</p> <p>*акции иностранных эмитентов, входящие в состав основных фондовых индексов, и депозитарные расписки, базовым активом которых являются данные акции;</p> <p>*долговые ЦБ, 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>	0,00%	да
12	Негосударственные ЦБ, выпущенные организациями РК в соответствии с законодательством РК и других государств, согласно Постановлению	44,76%	да
13	Паи Exchange Traded Funds (Эксчейндж Трэйдэд Фандс), Exchange, Traded Commodities (Эксчейндж Трэйдэд Коммодитис), Exchange Traded Notes (Эксчейндж Трэйдэд Ноутс), согласно Постановлению	9,15%	да
14	Паи интервальных паевых инвестиционных фондов, управляющая компания которых является юридическим лицом, созданным в соответствии с законодательством РК, включенные в официальный список фондовой биржи, согласно Постановлению	0,00%	да

15	Аффинированные драгоценные металлы, согласно Постановлению	0,00%	да
16	Производные финансовые инструменты, заключенные в целях хеджирования, согласно Постановлению	0,00%	да

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

Таблица 6. Сведения по приобретению финансовых инструментов в отчетном месяце

Вид инструмента	Валюта	Эмитент ценной бумаги	Стоимость сделки в тенге
казначейские обязательства	USD	US Treasury	83 160 872,91
купонные облигации	KZT	АО «Home Credit Bank»	40 000 473,92
субординированные купонные облигации	KZT	АО «Евразийский банк»	81 294 880,00
купонные облигации	KZT	АО «Казахстанский фонд устойчивости»	105 322 533,33
купонные облигации	KZT	АО «Home Credit Bank»	30 927 850,00
Итого			340 706 610,16

Таблица 7. Сведения по продаже финансовых инструментов в отчетном месяце

Вид инструмента	Валюта	Эмитент ценной бумаги	Сумма сделки в тенге
купонные МЕУКАМ	KZT	Министерство финансов Республики Казахстан	56 795 219,25
купонные МЕУКАМ	KZT	Министерство финансов Республики Казахстан	137 669 070,85
Итого			194 464 290,10

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	Стоимость сделки в тенге
В отчетном месяце не осуществлялись погашения по ценным бумагам			
Итого			-

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			-

