

Информация по инвестиционному управлению пенсионными активами АО «ЕНПФ»

По состоянию на 1 декабря 2022 года пенсионные активы (далее – ПА) АО «ЕНПФ» (далее – ЕНПФ), находящиеся в доверительном управлении АО «Halyk Global Markets» (далее – Halyk Global Markets), составили 2 653,51 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 | млн. тенге | | | | |
|---|-----------------------------------|----------------------|-----------------------------------|----------------------|----------------------------------|
| | Текущая стоимость на 01.01.2022г. | Доля на 01.01.2022г. | Текущая стоимость на 01.12.2022г. | Доля на 01.12.2022г. | Прирост/снижение с 01.01.2022 г. |
| Облигации банков второго уровня РК | 155,30 | 7,54% | 153,35 | 5,78% | -1,25% |
| Облигации МФО | 120,20 | 5,83% | 114,22 | 4,30% | -4,97% |
| Корпоративные облигации организаций РК | 125,67 | 6,10% | 120,52 | 4,54% | -4,09% |
| Облигации квазигосударственных организаций РК | 296,51 | 14,39% | 355,01 | 13,38% | 19,73% |
| Долевые инструменты иностранных эмитентов (Паи ETF) | 288,40 | 13,99% | 357,03 | 13,45% | 23,80% |
| Ноты НБРК | - | - | - | - | - |
| Акции и депозитарные расписки иностранных эмитентов | 180,38 | 8,75% | - | - | - |
| Ценные бумаги, имеющие статус государственных, выпущенные центральными правительствами иностранных государств | - | - | 180,35 | 6,80% | - |
| Обратное Репо (не более 90 календарных дней) | 892,98 | 43,33% | 1 296,03 | 48,84% | 45,14% |
| Прочие активы (дебиторская задолженность, просроченная задолженность, провизии) | 0,38 | 0,02% | - | - | - |
| Денежные средства на счетах | 1,02 | 0,05% | 77,00 | 2,90% | 7417,51% |
| Итого ПА, находящиеся в управлении Halyk Global Markets | 2 060,84 | 100,00% | 2 653,51 | 100,00% | 28,76% |
| Обязательства к оплате по совершенным сделкам | 0 | - | 0 | - | - |
| Итого пенсионные активы | 2 060,84 | 100,00% | 2 653,51 | 100,00% | 28,76% |

По состоянию на 01.12.2022 г. средневзвешенная доходность долговых финансовых инструментов, номинированных в тенге, составила 25,82% годовых. Средневзвешенная доходность долговых финансовых инструментов, номинированных в долларах США, составила 4,69%.

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 1296,03 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 48,84%. Средневзвешенная доходность операций обратного Репо на отчетную дату составила 15,40% годовых.

Облигации банков второго уровня Республики Казахстан

Текущая стоимость облигаций банков второго уровня Республики Казахстан (далее – РК) за отчетный месяц увеличилась на 4,15 млн. тенге и составила 153,35 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 5,78%.

Средневзвешенная доходность к погашению облигаций банков второго уровня РК на отчетную дату составила 45,20% годовых.

Облигации международных финансовых организаций

Текущая стоимость облигаций международных финансовых организаций за отчетный месяц выросла на 3,41 млн тенге и составила 114,22 млн. тенге. Доля в портфеле облигаций международных финансовых организаций составила 4,30%.

Средневзвешенная доходность к погашению по облигациям международных финансовых организаций, номинированным в тенге, с фиксированной ставкой вознаграждения составила 15,01% годовых.

Долевые инструменты иностранных эмитентов (ПАИ ETF)

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 11,57 млн. тенге и составила 357,03 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 13,45%.

Корпоративные облигации эмитентов РК

Текущая стоимость корпоративных облигаций эмитентов РК за отчетный месяц увеличилась на 3,70 млн. тенге и составила 120,52 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 4,54%.

Средневзвешенная доходность к погашению корпоративных облигаций эмитентов РК, номинированных в тенге, на отчетную дату составила 12,19% годовых.

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 увеличилась на 0,67 млн. тенге и составила 180,35 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 6,80%.

Средневзвешенная доходность к погашению ценных бумаг, имеющих статус государственных, выпущенных центральными правительствами иностранных государств, на отчетную дату составила 4,69% годовых.

Акции и депозитарные расписки иностранных эмитентов

По состоянию на 01.12.2022г. в инвестиционном портфеле ПА ЕНПФ, находящихся в доверительном управлении Halyk Global Markets, отсутствовали акции и депозитарные расписки иностранных эмитентов.

Облигации квазигосударственных организаций РК

Текущая стоимость облигаций квазигосударственных организаций РК за отчетный месяц выросла на 9,39 млн. тенге и составила 355,01 млн. тенге. Доля облигаций квазигосударственных организаций РК в портфеле составила 13,38%.

Средневзвешенная доходность к погашению облигаций квазигосударственных организаций РК, номинированных в тенге, на отчетную дату составила 25,56% 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 01.12.2022г. | Доля на 01.12.2022г. | Прирост/снижение с 01.01.2022 г. |
|---------------------|-----------------------------------|----------------------|-----------------------------------|----------------------|----------------------------------|
| Национальная валюта | 1 591,16 | 77,21% | 2 095,34 | 78,96% | 31,69% |
| Доллары США | 469,68 | 22,79% | 558,18 | 21,04% | 18,84% |
| Итого: | 2 060,84 | 100,00% | 2 653,51 | 100,00% | 28,76% |

Результаты инвестиционной деятельности

В результате инвестиционной деятельности, размер начисленного инвестиционного дохода (по состоянию на 01 декабря 2022 года с момента передачи активов) составил 221,97 млн. тенге и размер начисленного инвестиционного дохода (по состоянию на 01 декабря 2022 года с 01 января 2022 года) составил 109,18 млн. тенге. Доходность пенсионных активов составила 12,91% с начала деятельности и 4,15% 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» | 179,09 |
| Доходы (убытки) от рыночной переоценки ценных бумаг | -79,54 |
| Доходы (убытки) от переоценки иностранной валюты | -1,47 |
| Прочие доходы (убытки) | 11,10 |
| Итого: | 109,18 |

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 | 01.11.2022 | 997,5252141 |
| 2 | 02.11.2022 | 997,5252141 |
| 3 | 03.11.2022 | 997,5252141 |
| 4 | 04.11.2022 | 997,5252141 |
| 5 | 05.11.2022 | 997,5252141 |
| 6 | 06.11.2022 | 997,5252141 |
| 7 | 07.11.2022 | 993,6656110 |
| 8 | 08.11.2022 | 993,6656110 |
| 9 | 09.11.2022 | 993,6656110 |
| 10 | 10.11.2022 | 993,6656110 |
| 11 | 11.11.2022 | 993,6656110 |
| 12 | 12.11.2022 | 993,6656110 |
| 13 | 13.11.2022 | 993,6656110 |
| 14 | 14.11.2022 | 1 000,9204447 |
| 15 | 15.11.2022 | 1 000,9204447 |
| 16 | 16.11.2022 | 1 000,9204447 |
| 17 | 17.11.2022 | 1 000,9204447 |
| 18 | 18.11.2022 | 1 000,9204447 |
| 19 | 19.11.2022 | 1 000,9204447 |
| 20 | 20.11.2022 | 1 000,9204447 |
| 21 | 21.11.2022 | 1 003,7081825 |
| 22 | 22.11.2022 | 1 003,7081825 |
| 23 | 23.11.2022 | 1 003,7081825 |
| 24 | 24.11.2022 | 1 003,7081825 |

| | | |
|----|------------|---------------|
| 25 | 25.11.2022 | 1 003,7081825 |
| 26 | 26.11.2022 | 1 003,7081825 |
| 27 | 27.11.2022 | 1 003,7081825 |
| 28 | 28.11.2022 | 1 014,8807101 |
| 29 | 29.11.2022 | 1 014,8807101 |
| 30 | 30.11.2022 | 1 015,5889819 |

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 декабря 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 | 2,90% | да |
| | Обратное РЕПО | 48,84% | да |
| 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 | 4,30% | 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 | 0,00% | да |
| 7 | Ценные бумаги, имеющие статус государственных, выпущенные центральными правительствами иностранных государств | 6,80% | да |
| 8 | Акции и депозитарные расписки иностранных эмитентов, паи Exchange Traded Funds (ETF), Exchange Traded Commodities (ETC), Exchange Traded Notes (ETN) | 13,45% | 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 | 23,70% | да |

| № | Вид финансового инструмента | Фактическое значение | Выполнение (да/нет) |
|---|-----------------------------|----------------------|---------------------|
|---|-----------------------------|----------------------|---------------------|

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

| | | (в процентах от ПА) | |
|-----|---|---------------------|----|
| 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 |

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 |
|---|--------|-----------------------|---------------------------|
| В отчетном месяце покупки финансовых инструментов не осуществлялись | | | |
| Итого | | | |

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 | Сумма сделки в тенге |
|---|--------|-----------------------|----------------------|
| В отчетном месяце погашений по ценным бумагам не было | | | |
| 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 к погашению в тенге |
|--|--------|--------------------|---------------------------|
| В отчетном месяце не осуществлялись погашения основного долга по вкладам | | | |
| Итого | | | |