

## 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	<i>млн. тенге</i>				
	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%
<b>Итого ПА, находящиеся в управлении Halyk Global Markets</b>	<b>2 060,84</b>	<b>100,00%</b>	<b>2 653,51</b>	<b>100,00%</b>	<b>28,76%</b>
Обязательства к оплате по совершенным сделкам	0	-	0	-	-
<b>Итого пенсионные активы</b>	<b>2 060,84</b>	<b>100,00%</b>	<b>2 653,51</b>	<b>100,00%</b>	<b>28,76%</b>

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%
<b>Итого:</b>	<b>2 060,84</b>	<b>100,00%</b>	<b>2 653,51</b>	<b>100,00%</b>	<b>28,76%</b>

### 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
<b>Итого:</b>	<b>109,18</b>

### 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 Markets<sup>1</sup>. 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)
	<b>Денежные средства, включая остатки на банковских счетах</b>	<b>2,90%</b>	да
	<b>Обратное РЕПО</b>	<b>48,84%</b>	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)
---	-----------------------------	----------------------	---------------------

<sup>1</sup> 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			
<b>Итого</b>			

**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			
<b>Итого</b>			

**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			
<b>Итого</b>			

**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			
<b>Итого</b>			

**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			
<b>Итого</b>			