

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

По состоянию на 1 апреля 2024 года пенсионные активы (далее – ПА) АО «ЕНПФ» (далее – ЕНПФ), находящиеся в доверительном управлении АО «Halyk Global Markets» (далее – Halyk Global Markets), составили **3 757,52** 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 01.01.2024г.	Доля на 01.01.2024г.	Текущая стоимость на 01.04.2024г.	Доля на 01.04.2024г.	Прирост/ снижение с 01.01.2024 г.
Облигации банков второго уровня РК	215,08	6,70%	207,85	5,53%	-3,36%
Корпоративные облигации иностранных эмитентов	206,71	6,44%	336,05	8,94%	62,58%
Облигации МФО	260,63	8,12%	257,43	6,85%	-1,23%
Корпоративные облигации организаций РК	121,30	3,78%	117,54	3,13%	-3,09%
Облигации квазигосударственных организаций РК	416,81	12,98%	422,69	11,25%	1,41%
Долевые инструменты иностранных эмитентов (Паи ETF)	271,61	8,46%	264,65	7,04%	-2,56%
Акции и депозитарные расписки, выпущенные организациями Республики Казахстан	99,76	3,11%	162,35	4,32%	62,74%
Ценные бумаги, имеющие статус государственных, выпущенные центральными правительствами иностранных государств	252,09	7,85%	0,00	0,00%	-100,00%
Обратное РЕПО (не более 90 календарных дней)	1 231,21	38,35%	1 497,72	39,86%	21,65%
Прочие активы (дебиторская задолженность, просроченная задолженность, провизии)	0,00	0,00%	236,71	6,30%	100,00%
Денежные средства на счетах	135,06	4,21%	254,51	6,77%	88,44%
Итого ПА, находящиеся в управлении Halyk Global Markets	3 210,25	100,00%	3 757,52	100,00%	17,05%
Обязательства к оплате по совершенным сделкам	-	-	-	-	-
Итого пенсионные активы	3 210,25	100,00%	3 757,52	100,00%	17,05%

По состоянию на 01.04.2024 г. средневзвешенная доходность долговых финансовых инструментов, номинированных в тенге, составила 14,57% годовых. Средневзвешенная доходность долговых финансовых инструментов, номинированных в долларах США, составила 5,94%.

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 1 497,72 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 39,86%. Средневзвешенная доходность операций обратного РЕПО на отчетную дату составила 13,73% годовых.

Корпоративные облигации иностранных эмитентов

В отчетном периоде в состав портфеля были приобретены корпоративные облигации Continental Resources Inc в объеме 300 тыс. долларов США по номиналу. Текущая стоимость облигаций Continental Resources Inc на конец отчетного месяца составила 134,65 млн тенге. Их доля в портфеле составила 3,58%.

Текущая стоимость корпоративных облигаций иностранных эмитентов за отчетный месяц увеличилась на 134,97 млн тенге и составила 336,05 млн тенге. Их доля в портфеле составила 8,94%.

Средневзвешенная доходность к погашению корпоративных облигаций иностранных эмитентов на отчетную дату составила 5,94% годовых.

Облигации банков второго уровня Республики Казахстан

В отчетном периоде в состав портфеля облигации банков второго уровня Республики Казахстан (далее – БВУ РК) не приобретались.

Текущая стоимость облигаций БВУ РК за отчетный месяц уменьшилась на 7,15 млн тенге и на конец отчетного месяца составила 207,85 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 5,53%.

Средневзвешенная доходность к погашению облигаций БВУ РК на отчетную дату составила 14,23% годовых.

Облигации международных финансовых организаций

В отчетном периоде в состав портфеля облигации международных финансовых (далее – МФО) организаций не приобретались.

Текущая стоимость облигаций МФО за отчетный месяц снизилась на 5,97 млн тенге и составила 257,43 млн. тенге. Доля в портфеле облигаций МФО составила 6,85%.

Средневзвешенная доходность к погашению по облигациям МФО, номинированным в тенге, с фиксированной ставкой вознаграждения составила 14,3% годовых.

Корпоративные облигации эмитентов Республики Казахстан

В отчетном периоде в состав портфеля корпоративные облигации эмитентов Республики Казахстан не приобретались.

Текущая стоимость корпоративных облигаций эмитентов Республики Казахстан за отчетный месяц увеличилась на 1,75 млн. тенге и составила 117,54 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 3,13%.

Средневзвешенная доходность к погашению корпоративных облигаций эмитентов Республики Казахстан, номинированных в тенге, на отчетную дату составила 13,09% годовых.

Акции и депозитарные расписки эмитентов Республики Казахстан

В отчетном периоде в состав портфеля акции и депозитарные расписки эмитентов Республики Казахстан не приобретались.

Текущая стоимость акций и депозитарных расписок эмитентов Республики Казахстан за отчетный период снизилась на 8,48 млн. тенге и на дату отчета составила 162,35 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 4,32%.

Долевые инструменты иностранных эмитентов (Паи ETF)

В отчетном периоде в состав портфеля долевые инструменты эмитентов (Паи ETF) не приобретались.

Текущая стоимость долевых инструментов иностранных эмитентов (Паи ETF) за отчетный месяц уменьшилась на 0,90 млн. тенге и составила 264,65 млн тенге. Их доля в портфеле составила 7,04%.

Ценные бумаги, имеющие статус государственных, выпущенные центральными правительствами иностранных государств

В отчетном периоде в состав портфеля ценные бумаги, имеющие статус государственных, выпущенные центральными правительствами иностранных государств не приобретались и были погашены казначейские облигации США в объеме 561,9 тыс. долларов по номинальной стоимости.

На дату отчёта ценные бумаги, имеющие статус государственных, выпущенные центральными правительствами иностранных государств в составе портфеля отсутствуют.

Облигации квазигосударственных организаций Республики Казахстан

В отчетном периоде в состав портфеля квазигосударственные облигации эмитентов Республики Казахстан не приобретались.

Текущая стоимость облигаций квазигосударственных организаций Республики Казахстан за отчетный месяц снизилась на 3,68 млн. тенге и составила 422,69 млн. тенге. Доля облигаций квазигосударственных организаций Республики Казахстан в портфеле составила 11,25%.

Средневзвешенная доходность к погашению облигаций квазигосударственных организаций Республики Казахстан, номинированных в тенге, на отчетную дату составила 15,3% 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.

Таблица 2. Структура инвестиционного портфеля ПА ЕНПФ, находящихся в доверительном управлении Halyk Global Markets, в разрезе валют

Валюта	Текущая стоимость на 01.01.2024г.	Доля на 01.01.2024г.	Текущая стоимость на 01.04.2024г.	Доля на 01.04.2024г.	Прирост/снижение с 01.01.2024г.
Национальная валюта	2 347,13	73,11%	2 649,91	70,52%	12,90%
Доллары США	863,10	26,89%	1 107,59	29,48%	28,33%
Евро	0,02	0,0005%	0,02	0,0004%	-4,07%
Итого:	3 210,25	100,00%	3 757,52	100,00%	17,05%

млн. тенге

Результаты инвестиционной деятельности

В результате инвестиционной деятельности, размер начисленного инвестиционного дохода (по состоянию на 01 апреля 2024 года с 15 марта 2021 г.) составил 691,29 млн тенге и размер начисленного инвестиционного дохода с начала 2024 года составил 63,90 млн. тенге. Доходность пенсионных активов составила 32,74% с начала деятельности и 1,70% с начала 2024 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 2024 года.
Доходы в виде вознаграждения по ценным бумагам, в том числе по размещенным вкладам и операциям «обратное РЕПО»	94,15
Доходы (убытки) от рыночной переоценки ценных бумаг	- 18,14
Доходы (убытки) от переоценки иностранной валюты	- 11,51
Прочие доходы (убытки)	- 0,60
Итого:	63,90

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	01.03.2024	1 190,5195567
2	02.03.2024	1 190,5195567
3	03.03.2024	1 190,5195567
4	04.03.2024	1 192,6925626
5	05.03.2024	1 192,6925626
6	06.03.2024	1 192,6925626
7	07.03.2024	1 192,6925626
8	08.03.2024	1 192,6925626
9	09.03.2024	1 192,6925626
10	10.03.2024	1 192,6925626
11	11.03.2024	1 192,8523717
12	12.03.2024	1 192,8523717
13	13.03.2024	1 192,8523717
14	14.03.2024	1 192,8523717
15	15.03.2024	1 192,8523717
16	16.03.2024	1 192,8523717
17	17.03.2024	1 192,8523717
18	18.03.2024	1 193,2606142
19	19.03.2024	1 193,2606142
20	20.03.2024	1 193,2606142
21	21.03.2024	1 193,2606142
22	22.03.2024	1 193,2606142
23	23.03.2024	1 193,2606142
24	24.03.2024	1 193,2606142
25	25.03.2024	1 193,2606142
26	26.03.2024	1 194,4735101
27	27.03.2024	1 194,4735101
28	28.03.2024	1 194,4735101
29	29.03.2024	1 194,4735101
30	30.03.2024	1 194,4735101
31	31.03.2024	1 193,9529390

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 2024 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	0,09%	да
2	Обратное репо	39,86%	да
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		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	2,81%	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	5,35%	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

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)
8	Вклады в банках-нерезидентах, имеющих долгосрочный рейтинг не ниже "А-" 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
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>	6,85%	да
10	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)	0,00%	да

№	Вид финансового инструмента	Фактическое значение (в процентах от ПА)	Выполнение (да/нет)
11	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	7,04%	да
12	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		да
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	Негосударственные ценные бумаги, выпущенные иностранными организациями: 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; 2) акции иностранных эмитентов, входящие в состав основных фондовых индексов, и депозитарные расписки, базовым активом которых являются данные акции;		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)	8,94%	да

№	Вид финансового инструмента	Фактическое значение (в процентах от ПА)	Выполнение (да/нет)
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>	4,32%	да
15	<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>	11,75%	да
16	<p>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)</p>	12,98%	да

№	Вид финансового инструмента	Фактическое значение (в процентах от ПА)	Выполнение (да/нет)
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
19	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: опционы – контракт, дающий покупателю право, но не обязательство, купить или продать указанный актив по определенной цене или до определенной даты; фьючерсы – контракт, связанный с взаимной передачей прав и обязанностей в отношении сделки купли-продажи, которая будет совершена в будущем; 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; свопы – соглашение между двумя контрагентами об обмене в будущем платежами в соответствии с определенными в контракте условиями; производные финансовые инструменты, представляющие собой комбинацию вышеперечисленных производных финансовых инструментов; производные финансовые инструменты, представляющие собой комбинацию вышеперечисленных производных финансовых инструментов		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	11,36%	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
Корпоративные облигации иностранных эмитентов	USD	Continental Resources Inc	135 074 575,3
Итого			135 074 575,3

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	Стоимость сделки, в тенге
Ценные бумаги, имеющие статус государственных, выпущенные центральными правительствами иностранных государств	USD	Правительство США в лице Казначейства	253 568 613,00
Итого			253 568 613,00

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			