

Информация по инвестиционному управлению пенсионными активами АО «ЕНПФ»

По состоянию на 1 октября 2021 года пенсионные активы (далее – ПА) ЕНПФ, находящиеся в доверительном управлении АО «Halyk Global Markets» (далее – Halyk Global Markets), составили 1 526, 54 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

млн. тенге

Наименование	Текущая стоимость на 01.04.2021 г.	Доля на 01.04.2021 г.	Текущая стоимость на 01.10.2021 г.	Доля на 01.10.2021 г.	Прирост/ снижение с 01.04.2021 г.
Обратное Репо (не более 90 календарных дней)	500,46	99,50%	142,03	9,30%	-71,62%
Ноты НБРК	0	0,00%	318,39	20,86%	-
Облигации банков второго уровня РК	0	0,00%	154,06	10,09%	-
МФО	0	0,00%	120,32	7,88%	-
Долевые инструменты иностранных эмитентов (Паи ETF)	0	0,00%	274,67	17,99%	-
Акции и депозитарные расписки иностранных эмитентов	0	0,00%	130,35	8,54%	-
Денежные средства на счетах	2,51	0,50%	15,99	1,05%	537,05%
Корпоративные облигации организаций РК	0	0,00%	122,46	8,02%	-
Облигации квазигосударственных организаций РК	0	0,00%	248,28	16,26%	-
Итого ПА, находящиеся в управлении Halyk Global Markets	502,97	100,00%	1 526,54	100,00%	203,50%
Обязательства к оплате по совершенным сделкам	0	0,00%	0	0,00%	-
Итого пенсионные активы	502,97		1 526,54		203,50%

По состоянию на 01.10.2021г. 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 10,39% 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 128,02 млн тенге и составила 142,03 млн тенге. Их доля в портфеле составила 9,30%. Средневзвешенная доходность операций обратного Репо, в инвестиционном портфеле ПА ЕНПФ, находящихся в доверительном управлении Halyk Global Markets, номинированных в тенге, на отчетную дату составила 9,45% годовых.

Ноты Национального Банка Республики Казахстан

Основную долю в инвестиционном портфеле ПА ЕНПФ, находящихся в доверительном управлении Halyk Global Markets, занимают ноты Национального Банка Республики Казахстан, текущая стоимость которых за отчетный месяц составила 318,39 млн тенге. Их доля в портфеле составила 20,86%.

В рассматриваемом периоде произошло погашение нот Национального банка Республики Казахстан на сумму 480,00 млн тенге.

В отчетном периоде была совершена покупка нот Национального Банка Республики Казахстан в объеме 324,00 млн тенге с доходностью в размере 9,33% годовых. Средневзвешенная доходность к погашению нот Национального Банка Республики

Казахстан в инвестиционном портфеле ПА ЕНПФ, находящихся в доверительном управлении Halyk Global Markets, номинированных в тенге, на отчетную дату составила 9,33% годовых.

Облигации банков второго уровня Республики Казахстан.

В дополнение к этому, в инвестиционном портфеле ПА ЕНПФ, находящихся в доверительном управлении Halyk Global Markets, присутствуют долговые ценные бумаги, облигаций банков второго уровня Республики Казахстан, текущая стоимость которых за отчетный месяц увеличилась на 0,56 млн тенге и составила 154,06 млн тенге. Их доля в портфеле составила 10,09%.

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 11,99% годовых.

Облигации международных финансовых организаций

Текущая стоимость облигаций международных финансовых организаций за отчетный месяц составила 120,32 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 7,88%.

В отчетном периоде была совершена покупка облигаций Евразийского банка развития в объеме 120,00 млн тенге с доходностью в размере 10,50% годовых.

Средневзвешенная доходность к погашению по облигациям международных финансовых организаций, номинированным в тенге, с фиксированной ставкой вознаграждения составила 10,49% 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 уменьшилась на 2,63 млн тенге и составила 274,67 млн тенге. Их доля в портфеле составила 17,99%.

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 122,46 млн тенге. Их доля в портфеле составила 8,02%.

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 10,99% 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 2,19 млн тенге и составила 130,35 млн тенге. Их доля в портфеле составила 8,54%.

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 выросла на 122,74 млн тенге и составила 248,28 млн тенге. Их доля в портфеле составила 16,26%.

В отчетном периоде была совершена покупка облигаций АО КазАгроФинанс» в объеме 120,00 млн тенге с доходностью в размере 11,87% годовых. 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 10,93% 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

<i>млн. тенге</i>					
Валюта	Текущая стоимость на 01.04.2021г.	Доля на 01.04.2021г.	Текущая стоимость на 01.10.2021г.	Доля на 01.10.2021г.	Прирост/снижение с 01.04.2021 г.
Национальная валюта	502,97	100%	1 106,66	72,49%	120,02%
Доллары США	0	0,00%	419,88	27,51%	-
Итого:	502,97	100,00%	1 526,54	100,00%	203,50%

Результаты инвестиционной деятельности

В результате инвестиционной деятельности, размер начисленного инвестиционного дохода (по состоянию на 01 октября 2021 года с начала деятельности) составил 56,61 млн тенге. Доходность пенсионных активов составила 4,94%.

Структура начисленного инвестиционного дохода представлена в Таблице 3.

Таблица 3. Структура инвестиционного дохода, полученного по ПА ЕНПФ, находящихся в доверительном управлении Halyk Global Markets

<i>млн. тенге</i>	
Наименование	Инвестиционный доход за отчетный период
Доходы в виде вознаграждения по ценным бумагам, в том числе по размещенным вкладам и операциям «обратное РЕПО»	42,69
Доходы (убытки) от рыночной переоценки ценных бумаг	15,03
Доходы (убытки) от переоценки иностранной валюты	0,08
Прочие доходы (убытки)	-1,19
Итого:	56,61

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	01.09.2021	942.0439024
2	02.09.2021	942.0439024
3	03.09.2021	942.0439024
4	04.09.2021	942.0439024
5	05.09.2021	942.0439024
6	06.09.2021	943.4272542
7	07.09.2021	943.4272542
8	08.09.2021	943.4272542
9	09.09.2021	943.4272542
10	10.09.2021	943.4272542
11	11.09.2021	943.4272542
12	12.09.2021	943.4272542
13	13.09.2021	940.0269315

14	14.09.2021	940.0269315
15	15.09.2021	940.0269315
16	16.09.2021	940.0269315
17	17.09.2021	940.0269315
18	18.09.2021	940.0269315
19	19.09.2021	940.0269315
20	20.09.2021	941.2150226
21	21.09.2021	941.2150226
22	22.09.2021	941.2150226
23	23.09.2021	941.2150226
24	24.09.2021	941.2150226
25	25.09.2021	941.2150226
26	26.09.2021	941.2150226
27	27.09.2021	943.2971878
28	28.09.2021	943.2971878
29	29.09.2021	943.2971878
30	30.09.2021	943.9517117

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 октября 2021 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	1,10%	да
	Обратное РЕПО	9,30%	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	29,15%	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	7,88%	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	0,00%	да
8	Акции и депозитарные расписки иностранных эмитентов, паи Exchange Traded Funds (ETF), Exchange Traded Commodities (ETC), Exchange Traded Notes (ETN)	26,48%	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,	0,00%	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

	созданным в соответствии с законодательством Республики Казахстан		
11	Долговые ценные бумаги, негосударственных эмитентов РК	26,09%	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

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
Облигации	KZT	Евразийский Банк Развития	120 000 000,00
Ноты НБРК	KZT	Национальный Банк Республики Казахстан	316 634 832,00
Облигации	KZT	АО «КазАгроФинанс»	120 592 093,33
Итого			557 226 925,33

Таблица 7. Сведения по погашениям основного долга по ценным в отчетном месяце

Вид инструмента	Валюта	Эмитент ценной бумаги	Номинальная стоимость в тенге
Ноты НБРК	KZT	Национальный Банк Республики Казахстан	300 000 000,00
Ноты НБРК	KZT	Национальный Банк Республики Казахстан	180 000 000,00
Итого			480 000 000,00