

**Информация по инвестиционному управлению
пенсионными активами АО «ЕНПФ», находящимися в доверительном
управлении АО «ДО Народного Банка Казахстана «Halyk Finance»**

По состоянию на 1 августа 2023 года пенсионные активы (далее – ПА) АО «ЕНПФ» (далее – ЕНПФ), находящиеся в доверительном управлении АО «ДО Народного Банка Казахстана «Halyk Finance» (далее – Halyk Finance), составили **629,03** млн. тенге.

Структура портфеля финансовых инструментов, сформированного за счет пенсионных активов, находящихся в доверительном управлении Halyk Finance представлена в Таблице 1.

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

млн. тенге

Наименование	Текущая стоимость на 01.01.2023г.	Доля на 01.01.2023г.	Текущая стоимость на 01.08.2023г.	Доля на 01.08.2023г.	Прирост/снижение с 01.08.2023г.
ГЦБ МФ РК	0,00	0,00%	22,41	3,56%	0,00%
ГЦБ иностранных государств	0,00	0,00%	13,19	2,10%	0,00%
МФО	0,00	0,00%	17,82	2,83%	0,00%
Корпоративные облигации эмитентов РК	0,00	0,00%	20,82	3,31%	0,00%
Облигации квазигосударственных организаций РК	0,00	0,00%	38,16	6,07%	0,00%
Паи Exchange Traded Funds (ETF)	0,00	0,00%	13,24	2,10%	0,00%
Акции и депозитарные расписки иностранных эмитентов	0,00	0,00%	8,53	1,36%	0,00%
Денежные средства на счетах	1,35	16,19%	0,54	0,09%	-60,31%
Обратное Репо (не более 90 календарных дней)	7,01	83,81%	494,31	78,58%	6947,15%
Итого ПА, находящиеся в управлении УИП	8,37	100,00%	629,03	100,00%	7416,23%
Обязательства к оплате по совершенным сделкам	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00%
Деньги на счетах пенсионных взносов и выплат	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00%
Итого пенсионные активы	8,37		629,03		7416,23%

Операции обратного Репо (не более 90 календарных дней)

Основную долю в портфеле пенсионных активов, переданных в доверительное управление Halyk Finance, занимают операции обратного Репо, текущая стоимость которых за отчетный месяц составила 494,31 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 78,58%.

Средневзвешенная доходность операций обратного Репо на отчетную дату составила 16,91%.

Государственные ценные бумаги Министерства финансов Республики Казахстан

В отчетном периоде в состав портфеля государственные ценные бумаги (далее – ГЦБ) Министерства финансов Республики Казахстан (далее – МФ РК) не приобретались.

Текущая стоимость ГЦБ МФ РК на конец отчетного месяца составила 22,41 млн тенге. Их доля в портфеле составила 3,56%.

Средневзвешенная доходность ГЦБ МФ РК на отчетную дату составила 12,11% годовых.

Корпоративные облигации эмитентов-резидентов Республики Казахстан

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

Текущая стоимость корпоративных облигаций эмитентов-резидентов Республики Казахстан на конец отчетного месяца составила 20,82 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 3,31%

Средневзвешенная доходность к погашению корпоративных облигаций эмитентов-резидентов Республики Казахстан на отчетную дату составила 19,21% годовых.

Облигации международных финансовых организаций

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

Текущая стоимость облигаций МФО на конец отчетного месяца составила 17,82 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 2,83%.

Средневзвешенная доходность к погашению облигаций МФО на отчетную дату составила 13,41% годовых.

Государственные ценные бумаги иностранных государств

В отчетном периоде облигации государственные ценные бумаги иностранных государств в состав портфеля не приобретались.

Текущая стоимость государственных ценных бумаг иностранных государств на конец отчетного месяца составила 13,19 млн тенге. Их доля в портфеле составила 2,10%.

Средневзвешенная доходность к погашению государственных ценных бумаг иностранных государств на отчетную дату составила 4,10% годовых.

Облигации квазигосударственных организаций Республики Казахстан

В отчетном периоде были приобретены облигации АО «Казахстанский фонд устойчивости» в объеме 25 млн тенге по номинальной стоимости.

Текущая стоимость облигаций квазигосударственных организаций Республики Казахстан на конец отчетного месяца составила 38,16 млн тенге. Их доля в портфеле составила 6,07%.

Средневзвешенная доходность к погашению облигаций квазигосударственных организаций Республики Казахстан на отчетную дату составила 15,52% годовых.

Паи Exchange Traded Funds (ETF)

В отчетном периоде были приобретены паи Exchange Traded Funds (далее – ETF) в объеме 13,43 млн тенге.

Текущая стоимость ETF на конец отчетного месяца составила 13,24 млн тенге. Их доля в портфеле составила 2,10%.

Акции и депозитарные расписки иностранных эмитентов

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

Текущая стоимость акций и депозитарных расписок иностранных эмитентов на конец отчетного месяца составила 8,53 млн тенге. Их доля в портфеле составила 1,36%.

Валютная структура

Инвестиционный портфель финансовых инструментов в разрезе валют, в которых номинированы финансовые инструменты, приобретенные за счет пенсионных активов, находящихся в доверительном управлении Nalyk Finance представлен в Таблице 2.

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

млн. тенге

Валюта	Текущая стоимость на 01.01.2023 г.	Доля на 01.01.2023 г.	Текущая стоимость на 01.08.2023г.	Доля на 01.08.2023г.	Прирост/снижение с 01.01.2023 г.
Национальная валюта	8,37	100,00%	594,03	94,44%	7156,67%
Евро	0,00	0,00%	8,53	1,36%	0,00%
Доллар США	0,00	0,00%	26,46	4,21%	0,00%
Итого:	8,37	100,00%	629,03	100,00%	3250,16%

Результаты инвестиционной деятельности

В результате инвестиционной деятельности, размер начисленного инвестиционного дохода с начала 2023 года составил 17,53 млн тенге. Доходность пенсионных активов с начала 2023 года составила 8,71%.

Структура начисленного инвестиционного дохода представлена в Таблице 3.

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

млн тенге

Наименование	Инвестиционный доход с начала 2023 года
Доходы в виде вознаграждения по ценным бумагам, в том числе по размещенным вкладам и операциям «обратное РЕПО»	15,58
Доходы (убытки) от рыночной переоценки ценных бумаг	2,37
Доходы (убытки) от переоценки иностранной валюты	-0,14
Доходы (убытки) от переоценки прочих активов	0,00
Прочие доходы (убытки)	-0,28
Итого:	17,53

Информация о стоимости условной единицы

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

Таблица 4. Стоимость одной условной единицы ПА ЕНПФ, находящихся в доверительном управлении Halyk Finance

№	Дата	Стоимость одной условной единицы
1	01.07.2023	1 128,4708667
2	02.07.2023	1 128,4708667
3	03.07.2023	1 129,4707736
4	04.07.2023	1 129,4707736
5	05.07.2023	1 129,4707736
6	06.07.2023	1 129,4707736
7	07.07.2023	1 129,4707736
8	08.07.2023	1 129,4707736
9	09.07.2023	1 129,4707736
10	10.07.2023	1 130,4271338
11	11.07.2023	1 130,4271338
12	12.07.2023	1 130,4271338
13	13.07.2023	1 130,4271338
14	14.07.2023	1 130,4271338
15	15.07.2023	1 130,4271338
16	16.07.2023	1 130,4271338
17	17.07.2023	1 133,5098052
18	18.07.2023	1 133,5098052
19	19.07.2023	1 133,5098052

20	20.07.2023	1 133,5098052
21	21.07.2023	1 133,5098052
22	22.07.2023	1 133,5098052
23	23.07.2023	1 133,5098052
24	24.07.2023	1 136,9965136
25	25.07.2023	1 136,9965136
26	26.07.2023	1 136,9965136
27	27.07.2023	1 136,9965136
28	28.07.2023	1 136,9965136
29	29.07.2023	1 136,9965136
30	30.07.2023	1 136,9965136
31	31.07.2023	1 139,3131885

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 Finance¹. 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 Finance. Сведения о соблюдении лимитов инвестирования по состоянию на 01 августа 2023 года представлены в Таблице 5.

Таблица 5. Лимиты инвестирования по ПА ЕНПФ, находящихся в доверительном управлении Halyk Finance

№	Наименование финансового инструмента	Фактическое значение (в процентах от стоимости пенсионных активов, находящихся в доверительном управлении)	Выполнение (да/нет)
1.	Денежные средства в национальной валюте – тенге (KZT)	0,09%	да
2.	Обратное РЕПО	78,58%	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	3,56%	да
4.	Долговые ценные бумаги, выпущенные местными исполнительными органами Республики Казахстан	0,00%	да
5.	Долговые ценные бумаги, выпущенные юридическим лицом, сто процентов акций которого принадлежат Национальному Банку Республики Казахстан	4,01%	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	2,06%	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 (Стандард	0,00%	да

¹ Инвестиционная декларация на портфель финансовых инструментов, сформированный за счет пенсионных активов, находящихся в доверительном управлении Halyk Finance утверждена решением Совета директоров АО «Halyk Finance» Протокол об итогах заочного голосования Совета директоров от 01 ноября 2022 года №34/22-3

№	Наименование финансового инструмента	Фактическое значение (в процентах от стоимости пенсионных активов, находящихся в доверительном управлении)	Выполнение (да/нет)
	<p>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);</p> <p>- 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).</p>		
8.	<p>Вклады в банках-нерезидентах, имеющих долгосрочный рейтинг не ниже «A-» 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
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>	2,83%	да

№	Наименование финансового инструмента	Фактическое значение (в процентах от стоимости пенсионных активов, находящихся в доверительном управлении)	Выполнение (да/нет)
10.	Ценные бумаги, имеющие статус государственных, выпущенные центральными правительствами иностранных государств, 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)	2,10%	да
11.	Негосударственные ценные бумаги, выпущенные иностранными организациями:	0,00%	да
	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); 2. акции иностранных эмитентов, входящие в состав основных фондовых индексов, и депозитарные расписки, базовым активом которых являются данные акции;	1,36%	да
	3. 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)	0,00%	да
12.	Негосударственные ценные бумаги, выпущенные организациями Республики Казахстан в соответствии с законодательством Республики Казахстан и других государств:	0,00%	да
	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; 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; 3. акции юридических лиц, входящие в состав основных фондовых индексов;	0,00%	да
	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); 5. ценные бумаги, выпущенные в рамках реструктуризации обязательств эмитента в целях обмена на ранее выпущенные ценные бумаги либо иные обязательства данного эмитента.	3,31%	да
	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	2,10%	да

№	Наименование финансового инструмента	Фактическое значение (в процентах от стоимости пенсионных активов, находящихся в доверительном управлении)	Выполнение (да/нет)
	(Эксчейндж Трэйдэд Фандс), структура активов которых повторяет структуру одного из основных фондовых индексов, или ценообразование по паям которых привязано к основным фондовым индексам		
14.	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	0,00%	да
15.	Паи 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	0,00%	да
16.	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)	0,00%	да
17.	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	0,00%	да
18.	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.	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 Finance

Таблица 6. Сведения по приобретению финансовых инструментов в отчетном месяце

Вид инструмента	Валюта	Эмитент ценной бумаги	Сумма сделки в тенге
Облигации квазигосударственных организаций РК	KZT	АО «Казахстанский фонд устойчивости»	25 000 000,00
Ноты НБРК	KZT	Национальный Банк Республики Казахстан	24 718 775,00
Паи Exchange Traded Funds (ETF)	USD	iShares 7-10 Year Treasury Bond ETF (Эмитент – Blackrock)	6 694 790,72
Паи Exchange Traded Funds (ETF)	USD	iShares 5-10 Year Investment Grade Corporate Bond ETF (Эмитент – Blackrock)	6 687 874,41
Итого			63 101 440,13

Таблица 7. Сведения по продаже финансовых инструментов в отчетном месяце

Вид инструмента	Валюта	Эмитент ценной бумаги	Сумма 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
Ноты НБРК	KZT	Национальный Банк Республики Казахстан	25 000 000,00
Итого			25 000 000,00

Таблица 9. Сведения по размещениям во вклады иностранных банков в отчетном месяце

Вид инструмента	Валюта	Эмитент ценной бумаги	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	Эмитент ценной бумаги	Сумма сделки в тенге
В отчетном месяце не осуществлялись погашения основного долга по вкладам			
Итого			