

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

По состоянию на 1 февраля 2023 года пенсионные активы (далее – ПА) АО «ЕНПФ» (далее – ЕНПФ), находящиеся в доверительном управлении АО «Halyk Global Markets» (далее – Halyk Global Markets), составили 2 679,91 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 01.01.2023г.	Доля на 01.01.2023г.	Текущая стоимость на 01.02.2023г.	Доля на 01.02.2023г.	Прирост/снижение с 01.01.2023 г.
Облигации банков второго уровня РК	49,39	1,88%	47,25	1,76%	-4,33%
Облигации МФО	115,27	4,38%	116,32	4,34%	0,91%
Корпоративные облигации организаций РК	121,62	4,62%	116,12	4,33%	-4,52%
Облигации квазигосударственных организаций РК	330,81	12,57%	333,59	12,45%	0,84%
Долевые инструменты иностранных эмитентов (Паи ETF)	334,78	12,72%	353,83	13,20%	5,69%
Акции и депозитарные расписки, выпущенные организациями Республики Казахстан	130,00	4,94%	-	-	-
Ценные бумаги, имеющие статус государственных, выпущенные центральными правительствами иностранных государств	178,74	6,79%	178,54	6,66%	-0,11%
Обратное Репо (не более 90 календарных дней)	1 307,42	49,69%	1 467,73	54,77%	12,26%
Прочие активы (дебиторская задолженность, просроченная задолженность, провизии)	0,66	0,03%	0,66	0,02%	-0,46%
Денежные средства на счетах	62,51	2,38%	65,86	2,46%	5,36%
Итого ПА, находящиеся в управлении Halyk Global Markets	2 631,21	100,00%	2 679,91	100,00%	1,85%
Обязательства к оплате по совершенным сделкам	0	-			-
Итого пенсионные активы	2 631,21	100,00%	2 679,91	100,00%	1,85%

По состоянию на 01.02.2023 г. средневзвешенная доходность долговых финансовых инструментов, номинированных в тенге, составила 13,45% годовых. Средневзвешенная доходность долговых финансовых инструментов, номинированных в долларах США, составила 4,67%.

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 1 467,73 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 54,77%.

Средневзвешенная доходность операций обратного Репо на отчетную дату составила 15,87% годовых.

Облигации банков второго уровня Республики Казахстан

Текущая стоимость облигаций банков второго уровня Республики Казахстан (далее – РК) за отчетный месяц снизилась на 2,14 млн. тенге и составила 47,25 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 1,76%.

Средневзвешенная доходность к погашению облигаций банков второго уровня РК на отчетную дату составила 12,40% годовых.

Облигации международных финансовых организаций

Текущая стоимость облигаций международных финансовых организаций за отчетный месяц выросла на 1,05 млн тенге и составила 116,32 млн. тенге. Доля в портфеле облигаций международных финансовых организаций составила 4,34%.

Средневзвешенная доходность к погашению по облигациям международных финансовых организаций, номинированным в тенге, с фиксированной ставкой вознаграждения составила 15,39% 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 19,05 млн. тенге и составила 353,83 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 13,20%.

Корпоративные облигации эмитентов РК

Текущая стоимость корпоративных облигаций эмитентов РК за отчетный месяц снизилась на 5,50 млн. тенге и составила 116,12 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 4,33%.

Средневзвешенная доходность к погашению корпоративных облигаций эмитентов РК, номинированных в тенге, на отчетную дату составила 12,24% 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 снизилась на 0,19 млн. тенге и составила 178,54 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 6,66%.

Средневзвешенная доходность к погашению ценных бумаг, имеющих статус государственных, выпущенных центральными правительствами иностранных государств, на отчетную дату составила 4,67% годовых.

Облигации квазигосударственных организаций РК

Текущая стоимость облигаций квазигосударственных организаций РК за отчетный месяц выросла на 2,78 млн. тенге и составила 333,59 млн. тенге. Доля облигаций квазигосударственных организаций РК в портфеле составила 12,45%.

Средневзвешенная доходность к погашению облигаций квазигосударственных организаций РК, номинированных в тенге, на отчетную дату составила 13,34% 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 01.01.2023г.	Доля на 01.01.2023г.	Текущая стоимость на 01.02.2023г.	Доля на 01.02.2023г.	Прирост/снижение с 01.01.2023г.
Национальная валюта	2 095,80	79,65%	2 125,75	79,32%	1,43%
Доллары США	535,40	20,35%	554,16	20,68%	3,50%
Итого:	2 631,21	100,00%	2 679,91	100,00%	1,85%

Результаты инвестиционной деятельности

В результате инвестиционной деятельности, размер начисленного инвестиционного дохода (по состоянию на 01 февраля 2023 года с момента передачи активов) составил 285,66 млн. тенге и размер начисленного инвестиционного дохода (по состоянию на 01 февраля 2023 года с 01 января 2023 года) составил 62,26 млн. тенге. Доходность пенсионных активов составила 15,44% с начала деятельности и 2,20% с начала 2023 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 2023 года.
Доходы в виде вознаграждения по ценным бумагам, в том числе по размещенным вкладам и операциям «обратное РЕПО»	24,60
Доходы (убытки) от рыночной переоценки ценных бумаг	36,63
Доходы (убытки) от переоценки иностранной валюты	-0,93
Прочие доходы (убытки)	1,96
Итого:	62,26

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	01.01.2023	1 015,9992123
2	02.01.2023	1 015,9992123
3	03.01.2023	1 015,9992123
4	04.01.2023	1 018,0543156
5	05.01.2023	1 018,0543156
6	06.01.2023	1 018,0543156
7	07.01.2023	1 018,0543156
8	08.01.2023	1 018,0543156
9	09.01.2023	1 024,2301594
10	10.01.2023	1 024,2301594
11	11.01.2023	1 024,2301594
12	12.01.2023	1 024,2301594
13	13.01.2023	1 024,2301594
14	14.01.2023	1 024,2301594
15	15.01.2023	1 024,2301594
16	16.01.2023	1 032,0274774
17	17.01.2023	1 032,0274774
18	18.01.2023	1 032,0274774

19	19.01.2023	1 032,0274774
20	20.01.2023	1 032,0274774
21	21.01.2023	1 032,0274774
22	22.01.2023	1 032,0274774
23	23.01.2023	1 033,0579982
24	24.01.2023	1 033,0579982
25	25.01.2023	1 033,0579982
26	26.01.2023	1 033,0579982
27	27.01.2023	1 033,0579982
28	28.01.2023	1 033,0579982
29	29.01.2023	1 033,0579982
30	30.01.2023	1 038,0030657
31	31.01.2023	1 038,3223257

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 февраля 2023 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	2,48%	да
	Обратное РЕПО	54,77%	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	4,34%	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

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

7	Ценные бумаги, имеющие статус государственных, выпущенные центральными правительствами иностранных государств	6,66%	да
8	Акции и депозитарные расписки иностранных эмитентов, паи Exchange Traded Funds (ETF), Exchange Traded Commodities (ETC), Exchange Traded Notes (ETN)	13,20%	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	18,54%	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
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
Простые акции	KZT	АО "НК КазМунайГаз"	150 167 475
Итого			150 167 475

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 не осуществлялись погашения основного долга			
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			