

## Информация по инвестиционному управлению пенсионными активами АО «ЕНПФ»

По состоянию на 1 августа 2021 года пенсионные активы (далее – ПА) ЕНПФ, находящиеся в доверительном управлении АО «Halyk Global Markets» (далее – Halyk Global Markets), составили 1 335,80 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	Текущая стоимость на 01.04.2021 г.	Доля на 01.04.2021 г.	Текущая стоимость на 01.08.2021 г.	Доля на 01.08.2021 г.	Прирост/снижение с 01.04.2021 г.
Обратное Репо (не более 90 календарных дней)	500,46	99,50%	179,05	13,40%	-64,22%
Ноты НБРК	0	0,00%	477,53	35,75%	-
Облигации банков второго уровня РК	0	0,00%	49,69	3,72%	-
Долевые инструменты иностранных эмитентов (Паи ETF)	0	0,00%	259,02	19,39%	-
Денежные средства на счетах	2,51	0,50%	51,48	3,85%	1947,72%
Корпоративные облигации эмитентов РК	0	0,00%	120,26	9,00%	-
Акции и депозитарные расписки иностранных эмитентов	0	0	99,18	7,42%	-
Облигации квазигосударственных организаций РК	0	0,00%	99,59	7,46%	-
<b>Итого ПА, находящиеся в управлении Halyk Global Markets</b>	<b>502,97</b>	<b>100,00%</b>	<b>1 335,80</b>	<b>100,00%</b>	<b>165,58%</b>
Обязательства к оплате по совершенным сделкам	0	0,00%	0	0,00%	-
<b>Итого пенсионные активы</b>	<b>502,97</b>	<b>100,00%</b>	<b>1 335,80</b>	<b>100,00%</b>	<b>165,58%</b>

*млн. тенге*

По состоянию на 01.08.2021г. 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 9,41% 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 снизилась на 570,24 млн тенге и составила 179,05 млн тенге. Их доля в портфеле составила 13,40%. Средневзвешенная доходность операций обратного Репо, в инвестиционном портфеле ПА ЕНПФ, находящихся в доверительном управлении Halyk Global Markets, номинированных в тенге, на отчетную дату составила 8,80% годовых.

### **Ноты Национального Банка Республики Казахстан**

Основную долю в инвестиционном портфеле ПА ЕНПФ, находящихся в доверительном управлении Halyk Global Markets, занимают ноты Национального Банк Республики Казахстан, текущая стоимость которых за отчетный месяц составила 477,53 млн тенге. Их доля в портфеле составила 35,75%.

В отчетном периоде была совершена покупка нот Национального Банк Республики Казахстан в объеме 300,00 млн тенге с доходностью в размере 8,90% 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 8,98% 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 уменьшилась на 2,14 млн тенге и составила 49,69 млн тенге. Их доля в портфеле составила 3,72%.

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 10,52% 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, текущая стоимость которых за отчетный месяц увеличилась на 107,52 млн тенге и составила 259,02 млн тенге. Их доля в портфеле составила 19,39%.

В отчетном периоде была совершена покупка акций биржевых инвестиционных фондов Vanguard S&P 500 ETF на общую сумму 64,89 млн тенге, Energy Select Sector SPDR Fund на общую сумму 24,63 млн тенге, SPDR S&P 500 ETF на общую сумму 64,62 млн тенге.

Также в отчетном периода была совершена продажа акций биржевого инвестиционного фонда iShares 3-7 Year Treasury Bond ETF на общую сумму 49,35 млн тенге.

#### **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 составила 120,26 млн тенге. Их доля в портфеле составила 9,00%.

В отчетном периоде была совершена покупка облигаций ТОО "МФО "Тойота Файнаншл Сервисез Казахстан" в объеме 120,00 млн. тенге с доходностью в размере 11,00% годовых.

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 11,00% 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 составила 99,18 млн тенге. Их доля в портфеле составила 7,42%.

В отчетном периоде была совершена покупка акций иностранных эмитентов CITIGROUP INC. на общую сумму 101,06 млн тенге.

#### **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 составила 99,59 млн тенге. Их доля в портфеле составила 7,46%.

В отчетном периоде была совершена покупка облигаций АО «Казахстанский фонд устойчивости» в объеме 100,32 млн тенге с доходностью в размере 10,09% 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 10,09% 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 Казахской 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 01.08.2021г.	Доля на 01.08.2021г.	Прирост/снижение с 01.04.2021 г.
Национальная валюта	502,97	100%	928,09	69,48%	84,52%
Доллары США	0	0,00%	407,71	30,52%	-
<b>Итого:</b>	<b>502,97</b>	<b>100,00%</b>	<b>1 335,80</b>	<b>100,00%</b>	<b>165,58%</b>

### Результаты инвестиционной деятельности

В результате инвестиционной деятельности, размер начисленного инвестиционного дохода (по состоянию на 01 августа 2021 года с начала деятельности) составил 28,54 млн тенге. Доходность пенсионных активов составила 2,96%.

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»	25,07
Доходы (убытки) от рыночной переоценки ценных бумаг	4,65
Доходы (убытки) от переоценки иностранной валюты	-0,01
Прочие доходы (убытки)	-1,17
<b>Итого:</b>	<b>28,54</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	01.07.2021	920,3713341
2	02.07.2021	920,3713341
3	03.07.2021	920,3713341
4	04.07.2021	920,3713341
5	05.07.2021	920,3713341
6	06.07.2021	920,3713341
7	07.07.2021	922,8344461
8	08.07.2021	922,8344461
9	09.07.2021	922,8344461
10	10.07.2021	922,8344461
11	11.07.2021	922,8344461
12	12.07.2021	924,6363986
13	13.07.2021	924,6363986
14	14.07.2021	924,6363986
15	15.07.2021	924,6363986

16	16.07.2021	924,6363986
17	17.07.2021	924,6363986
18	18.07.2021	924,6363986
19	19.07.2021	922,9391767
20	20.07.2021	922,9391767
21	21.07.2021	922,9391767
22	22.07.2021	922,9391767
23	23.07.2021	922,9391767
24	24.07.2021	922,9391767
25	25.07.2021	922,9391767
26	26.07.2021	925,8644655
27	27.07.2021	925,8644655
28	28.07.2021	925,8644655
29	29.07.2021	925,8644655
30	30.07.2021	925,8644655
31	31.07.2021	926,1378106

### 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 1 июня 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	3,91%	да
	Обратное РЕПО	13,40%	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	43,21%	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	Вклады в банках второго уровня Республики Казахстан	0,00%	да
4	Вклады в банках-нерезидентах	0,00%	да
5	Долговые ценные бумаги, выпущенные международными финансовыми организациями	0,00%	да
6	Ценные бумаги, имеющие статус государственных, выпущенные центральными правительствами иностранных государств	0,00%	да
7	Акции и депозитарные расписки иностранных эмитентов, паи Exchange Traded Funds (ETF), Exchange Traded Commodities (ETC), Exchange Traded Notes (ETN)	26,76%	да
8	Долговые ценные бумаги, иностранных негосударственных эмитентов	0,00%	да
9	Акции и депозитарные расписки эмитентов РК, паи интервальных пассивных инвестиционных фондов, управляющая компания которых является юридическим лицом, созданным в соответствии с законодательством Республики Казахстан	0,00%	да
10	Долговые ценные бумаги, негосударственных эмитентов РК	9,00%	да

№	Вид финансового инструмента	Фактическое значение (в процентах от ПА)	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

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	Номинальная стоимость в тенге
Ноты	KZT	Национальный Банк Республики Казахстан	300 000 000,00
Облигации	KZT	ТОО "МФО "Тойота Файнаншл Сервисез Казахстан"	120 000 000,00
Акции (паи) биржевых инвестиционных фондов	USD	Vanguard S&P 500 ETF	64 892 594,30
Акции	USD	CITIGROUP INC	101 061 234,90
Акции (паи) биржевых инвестиционных фондов	USD	SPDR S&P 500 ETF TRUST	64 622 736,94
Акции (паи) биржевых инвестиционных фондов	USD	Energy Select Sector SPDR Fund	24 628 567,57
Облигации		Казахстанский фонд устойчивости	100 319 000,00
<b>Итого</b>			<b>775 524 133,71</b>

**Таблица 7. Сведения по продаже финансовых инструментов в отчетном месяце**

Вид инструмента	Валюта	Эмитент ценной бумаги	Сумма сделки в тенге
Акции (паи) биржевых инвестиционных фондов	USD	iShares 3-7 Year Treasury ETF (эмитент – Blackrock)	49 350 145,01
<b>Итого</b>			<b>49 350 145,01</b>