

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

По состоянию на 1 января 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 8,37 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**

| <i>млн. тенге</i>                             |                                   |                      |                                   |                      |                                  |
|---|-----------------------------------|----------------------|-----------------------------------|----------------------|----------------------------------|
| Наименование                                  | Текущая стоимость на 01.01.2022г. | Доля на 01.01.2022г. | Текущая стоимость на 01.01.2023г. | Доля на 01.01.2023г. | Прирост/снижение с 01.01.2022 г. |
| Денежные средства на счетах                   | 0,00                              | 0,00%                | 1,35                              | 16,19%               | -                                |
| Обратное Репо (не более 90 календарных дней)  | 0,00                              | 0,00%                | 7,01                              | 83,81%               | -                                |
| <b>Итого ПА, находящиеся в управлении УИП</b> | <b>0,00</b>                       | <b>0,00%</b>         | <b>8,37</b>                       | <b>100,00%</b>       | -                                |
| Обязательства к оплате по совершенным сделкам | 0,00                              | 0,00%                | 0,001                             | 0,00%                | -                                |
| <b>Итого пенсионные активы</b>                | <b>0,00</b>                       | <b>0,00%</b>         | <b>8,37</b>                       | <b>100,00%</b>       | -                                |

### Операции обратного Репо (не более 90 календарных дней)

Текущая стоимость операций обратного Репо за отчетный месяц составила 7,01 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 83,81%.

### Валютная структура

Инвестиционный портфель финансовых инструментов в разрезе валют, в которых номинированы финансовые инструменты, приобретенные за счет пенсионных активов, находящихся в доверительном управлении Halyk Finance 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 Finance, в разрезе валют**

| <i>млн. тенге</i>   |                                   |                      |                                   |                      |                                  |
|---------------------|-----------------------------------|----------------------|-----------------------------------|----------------------|----------------------------------|
| Валюта              | Текущая стоимость на 01.01.2022г. | Доля на 01.01.2022г. | Текущая стоимость на 01.01.2023г. | Доля на 01.01.2023г. | Прирост/снижение с 01.01.2022 г. |
| Национальная валюта | 0                                 | 0,00%                | 8,37                              | 100,00%              | -                                |
| <b>Итого:</b>       | <b>0</b>                          | <b>0,00%</b>         | <b>8,37</b>                       | <b>100,00%</b>       | -                                |

### Результаты инвестиционной деятельности

В результате инвестиционной деятельности, размер начисленного инвестиционного дохода (по состоянию на 01 января 2023 года с момента передачи активов) составил 11 463,10 тенге. Доходность пенсионных активов с начала деятельности составила 0,13%.

Структура начисленного инвестиционного дохода представлена в Таблице 3.

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

тенге

| Наименование   | Инвестиционный доход с начала 2022 года. |
|--|--|
| Доходы в виде вознаграждения по ценным бумагам, в том числе по размещенным вкладам и операциям «обратное РЕПО» | 11 940,26                                |
| Доходы (убытки) от рыночной переоценки ценных бумаг  | 0,00                                     |
| Доходы (убытки) от переоценки иностранной валюты   | 0,00                                     |
| Доходы (убытки) от переоценки прочих активов   | 0,00                                     |
| Прочие доходы (убытки)   | -477,16                                  |
| <b>Итого:</b>  | <b>11 463,10</b>                         |

### 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  | 15.12.2022 | 1 046,6998560                    |
| 2  | 16.12.2022 | 1 046,6998560                    |
| 3  | 17.12.2022 | 1 046,6998560                    |
| 4  | 18.12.2022 | 1 046,6998560                    |
| 5  | 19.12.2022 | 1 046,6998560                    |
| 6  | 20.12.2022 | 1 046,6998560                    |
| 7  | 21.12.2022 | 1 046,6998560                    |
| 8  | 22.12.2022 | 1 046,6998560                    |
| 9  | 23.12.2022 | 1 046,6998560                    |
| 10 | 24.12.2022 | 1 046,6998560                    |
| 11 | 25.12.2022 | 1 046,6998560                    |
| 12 | 26.12.2022 | 1 046,6463620                    |
| 13 | 27.12.2022 | 1 046,6463620                    |
| 14 | 28.12.2022 | 1 046,6463620                    |
| 15 | 29.12.2022 | 1 046,6463620                    |
| 16 | 30.12.2022 | 1 046,6463620                    |
| 17 | 31.12.2022 | 1 048,0504632                    |

### 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 Finance<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 Finance. Сведения о соблюдении лимитов инвестирования по состоянию на 01 января 2023 года представлены в Таблице 5.

<sup>1</sup> 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

**Таблица 5. Лимиты инвестирования по ПА ЕНПФ, находящихся в доверительном управлении Nalyk 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)   | 16,19%   | да                  |
| 2. | Обратное РЕПО   | 83,81%   | 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  | 0,00%  | 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   | 0,00%  | 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   | 0,00%  | да                  |
| 7. | Вклады в банках второго уровня Республики Казахстан, при соответствии одному из следующих условий:<br>- 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 «кzA-» по национальной шкале Standard & Poor's (Стандарт энд Пурс);<br>- 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).   | 0,00%  | да                  |
| 8. | 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)   | 0,00%  | да                  |
| 9. | 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):<br>- Азиатский банк развития (the Asian Development Bank);<br>- Межамериканский банк развития (the Inter-American Development Bank);<br>- Африканский банк развития (the African Development Bank);<br>- Европейский банк реконструкции и развития (the European Bank for Reconstruction and Development);<br>- Европейский инвестиционный банк (the European Investment Bank);<br>- Банк Развития Европейского Совета (the Council of Europe Development Bank);<br>- Исламская корпорация по развитию частного сектора (the Islamic Corporation for the Development of the Private Sector);<br>- Исламский банк развития (the Islamic Development Bank);<br>- Многостороннее агентство гарантии инвестиций (the Multilateral Investment Guarantee Agency);<br>- Скандинавский инвестиционный банк (the Nordic Investment Bank);<br>- Международный валютный фонд (the International Monetary Fund);<br>- Международная ассоциация развития (the International Development Association);<br>- Международный центр по урегулированию инвестиционных споров (the International Centre for Settlement of Investment Disputes); | 0,00%  | да                  |

| №   | Наименование финансового инструмента  | Фактическое значение (в процентах от стоимости пенсионных активов, находящихся в доверительном управлении) | Выполнение (да/нет) |
|-----|---|--|---------------------|
|     | <p>- Международный банк реконструкции и развития (the International Bank for Reconstruction and Development);</p> <p>- Международная финансовая корпорация (the International Finance Corporation);</p> <p>а также ценные бумаги, выпущенные международной финансовой организацией, доля Республики Казахстан в уставном капитале которой составляет не менее 25%.</p>  |  |                     |
| 10. | <p>Ценные бумаги, имеющие статус государственных, выпущенные центральными правительствами иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг не ниже «BBB-» по международной шкале агентства Standard &amp; 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                  |
|     | <p>Негосударственные ценные бумаги, выпущенные иностранными организациями:</p>  | 0,00%  | да                  |
| 11. | <p>1. акции иностранных эмитентов, имеющих рейтинговую оценку не ниже «BB+» по международной шкале агентства Standard &amp; Poor's (Стандарт энд Пурс) или рейтинговую оценку аналогичного уровня агентств Moody's Investors Service (Мудис Инвесторс Сервис) или Fitch (Фич);</p> <p>2. акции иностранных эмитентов, входящие в состав основных фондовых индексов, и депозитарные расписки, базовым активом которых являются данные акции;</p>   | 0,00%  | да                  |
|     | <p>3. долговые ценные бумаги, имеющие рейтинговую оценку не ниже «BB» по международной шкале агентства Standard &amp; 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                  |
|     | <p>Негосударственные ценные бумаги, выпущенные организациями Республики Казахстан в соответствии с законодательством Республики Казахстан и других государств:</p>  | 0,00%  | да                  |
| 12. | <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>   | 0,00%  | да                  |
|     | <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&amp;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 &amp; 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> | 0,00%  | да                  |
| 13. | <p>Паи Exchange Traded Funds (Экстейндж Трэйдэд Фандс), Exchange Traded Commodities (Экстейндж Трэйдэд Коммодитис), Exchange Traded Notes (Экстейндж Трэйдэд Ноутс), имеющие рейтинговую оценку не ниже «3 звезды» рейтингового агентства Morningstar (Морнингстар), за исключением Паев Exchange Traded Funds (Экстейндж Трэйдэд Фандс), структура активов которых повторяет структуру одного из основных фондовых индексов, или ценообразование по паям которых привязано к основным фондовым индексам</p>  | 0,00%  | да                  |
| 14. | <p>Паи интервальных паевых инвестиционных фондов, управляющая компания которых является юридическим лицом, созданным в соответствии</p>   | 0,00%  | да                  |

| №   | Наименование финансового инструмента   | Фактическое значение (в процентах от стоимости пенсионных активов, находящихся в доверительном управлении) | Выполнение (да/нет) |
|-----|--|--|---------------------|
|     | с законодательством Республики Казахстан, включенные в официальный список фондовой биржи, соответствующие требованиям сектора «ценные бумаги инвестиционных фондов» площадки «Смешанная» официального списка фондовой биржи  |  |                     |
| 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 «ВВВ» 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 «АА» 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:<br><b>опционы</b> – контракт, дающий покупателю право, но не обязательство, купить или продать указанный актив по определенной цене или до определенной даты;<br><b>фьючерсы</b> – контракт, связанный с взаимной передачей прав и обязанностей в отношении сделки купли-продажи, которая будет совершена в будущем;<br><b>форварды</b> – 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;<br><b>свопы</b> – соглашение между двумя контрагентами об обмене в будущем платежами в соответствии с определенными в контракте условиями;<br>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 | Номинальная стоимость в тенге |
|---|--------|-----------------------|-------------------------------|
| В отчетном месяце покупки финансовых инструментов не осуществлялись |        |                       |                               |
| <b>Итого</b>  |        |                       |                               |

**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 |        |                       |                      |
| <b>Итого</b>  |        |                       |                      |

**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 погашений по ценным бумагам не было |        |                       |                      |
| <b>Итого</b>  |        |                       |                      |

**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 |        |                    |                      |
| <b>Итого</b>  |        |                    |                      |

**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 |        |                    |                           |
| <b>Итого</b>   |        |                    |                           |