

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

По состоянию на 1 апреля 2023 года пенсионные активы (далее – ПА) АО «ЕНПФ» (далее – ЕНПФ), находящиеся в доверительном управлении АО «Halyk Global Markets» (далее – Halyk Global Markets), составили **2 689,92** 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 01.01.2023г.	Доля на 01.01.2023г.	Текущая стоимость на 01.04.2023г.	Доля на 01.04.2023г.	Прирост/снижение с 01.01.2023г.
Облигации банков второго уровня РК	49,39	1,88%	46,70	1,74%	-5,44%
Облигации МФО	115,27	4,38%	250,77	9,32%	117,55%
Корпоративные облигации организаций РК	121,62	4,62%	114,09	4,24%	-6,20%
Облигации квазигосударственных организаций РК	330,81	12,57%	319,49	11,88%	-3,42%
Долевые инструменты иностранных эмитентов (Паи ETF)	334,78	12,72%	366,02	13,61%	9,33%
Ноты НБРК	0,00	0,00%	241,60	8,98%	0,00%
Акции и депозитарные расписки, выпущенные организациями Республики Казахстан	130,00	4,94%	0,00	0,00%	0,00%
Ценные бумаги, имеющие статус государственных, выпущенные центральными правительствами иностранных государств	178,74	6,79%	176,71	6,57%	-1,13%
Обратное РЕПО (не более 90 календарных дней)	1 307,42	49,69%	1 112,92	41,37%	-14,88%
Прочие активы (дебиторская задолженность, просроченная задолженность, провизии)	0,66	0,03%	0,58	0,02%	-12,22%
Денежные средства на счетах	62,51	2,38%	61,03	2,27%	-2,37%
Итого ПА, находящиеся в управлении Halyk Global Markets	2 631,21	100,00%	2 689,92	100,00%	2,23%
Обязательства к оплате по совершенным сделкам	-	-	-	-	-
Итого пенсионные активы	2 631,21	100,00%	2 689,92	100,00%	2,23%

По состоянию на 01.04.2023 г. средневзвешенная доходность долговых финансовых инструментов, номинированных в тенге, составила 15,09% годовых. Средневзвешенная доходность долговых финансовых инструментов, номинированных в долларах США, составила 4,37%.

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 1 112,92 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 41,37%. Средневзвешенная доходность операций обратного РЕПО на отчетную дату составила 16,10% годовых.

Ноты Национального Банка Республики Казахстан

Текущая стоимость нот Национального Банка Республики Казахстана составила 241,60 млн тенге. Их доля в портфеле составила 8,98%.

В рассматриваемом периоде были приобретены 27-дневные ноты НБРК в объеме 240,00 млн тенге с доходностью 16,6% годовых.

Облигации банков второго уровня Республики Казахстан

Текущая стоимость облигаций банков второго уровня Республики Казахстан (далее – РК) за отчетный месяц снизилась на 0,97 млн. тенге и составила 46,70 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 1,74%.

Средневзвешенная доходность к погашению облигаций банков второго уровня РК на отчетную дату составила 13,60% годовых.

Облигации международных финансовых организаций

Текущая стоимость облигаций международных финансовых организаций за отчетный месяц выросла на 133,40 млн тенге и составила 250,77 млн. тенге. В отчетном месяце были приобретены облигации Азиатского Банка Развития. Доля в портфеле облигаций международных финансовых организаций составила 9,32%.

Средневзвешенная доходность к погашению по облигациям международных финансовых организаций, номинированным в тенге, с фиксированной ставкой вознаграждения составила 15,50% годовых.

Долевые инструменты иностранных эмитентов (ПАИ ETF)

В инвестиционном портфеле ПА ЕНПФ, находящихся в доверительном управлении Nalyk Global Markets, присутствуют долевые инструменты иностранных эмитентов (ПАИ ETF), текущая стоимость которых за отчетный месяц выросла на 28,42 млн. тенге и составила 366,02 млн. тенге. В отчетном месяце была увеличена позиция по VOO US и SPY US. Доля долевых инструментов иностранных эмитентов (ПАИ ETF) в портфеле составила 13,61%.

Корпоративные облигации эмитентов РК

Текущая стоимость корпоративных облигаций эмитентов РК за отчетный месяц снизилась на 3,14 млн. тенге и составила 114,09 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 4,24%.

Средневзвешенная доходность к погашению корпоративных облигаций эмитентов РК, номинированных в тенге, на отчетную дату составила 13,67% 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 выросла на 3,49 млн. тенге и составила 176,71 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 6,57%.

Средневзвешенная доходность к погашению ценных бумаг, имеющих статус государственных, выпущенных центральными правительствами иностранных государств, на отчетную дату составила 4,37% годовых.

Облигации квазигосударственных организаций РК

Текущая стоимость облигаций квазигосударственных организаций РК за отчетный месяц снизилась на 9,73 млн. тенге и составила 319,49 млн. тенге. Доля облигаций квазигосударственных организаций РК в портфеле составила 11,88%.

Средневзвешенная доходность к погашению облигаций квазигосударственных организаций РК, номинированных в тенге, на отчетную дату составила 15,51% 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 01.04.2023г.	Доля на 01.04.2023г.	Прирост/снижение с 01.01.2023г.
Национальная валюта	2 095,80	79,65%	2 145,90	79,78%	2,39%
Доллары США	535,40	20,35%	544,02	20,22%	1,61%
Итого:	2 631,21	100,00%	2 689,92	100,00%	2,23%

Результаты инвестиционной деятельности

В результате инвестиционной деятельности, размер начисленного инвестиционного дохода (по состоянию на 01 апреля 2023 года с 15 марта 2021 г.) составил 306,67 млн. тенге и размер начисленного инвестиционного дохода (по состоянию на 01 апреля 2023 года с 01 января 2023 года) составил 83,27 млн. тенге. Доходность пенсионных активов составила 16,26% с начала деятельности и 2,93% 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»	76,71
Доходы (убытки) от рыночной переоценки ценных бумаг	8,90
Доходы (убытки) от переоценки иностранной валюты	-4,09
Прочие доходы (убытки)	1,75
Итого:	83,27

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	01.03.2023	1 038,5348541
2	02.03.2023	1 038,5348541
3	03.03.2023	1 038,5348541
4	04.03.2023	1 038,5348541
5	05.03.2023	1 038,5348541
6	06.03.2023	1 036,2280690
7	07.03.2023	1 036,2280690
8	08.03.2023	1 036,2280690

9	09.03.2023	1 036,2280690
10	10.03.2023	1 036,2280690
11	11.03.2023	1 036,2280690
12	12.03.2023	1 036,2280690
13	13.03.2023	1 043,0495678
14	14.03.2023	1 043,0495678
15	15.03.2023	1 043,0495678
16	16.03.2023	1 043,0495678
17	17.03.2023	1 043,0495678
18	18.03.2023	1 043,0495678
19	19.03.2023	1 043,0495678
20	20.03.2023	1 049,5094562
21	21.03.2023	1 049,5094562
22	22.03.2023	1 049,5094562
23	23.03.2023	1 049,5094562
24	24.03.2023	1 049,5094562
25	25.03.2023	1 049,5094562
26	26.03.2023	1 049,5094562
27	27.03.2023	1 045,8054794
28	28.03.2023	1 045,8054794
29	29.03.2023	1 045,8054794
30	30.03.2023	1 045,8054794
31	31.03.2023	1 045,7366613

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 апреля 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)
1	Денежные средства, включая остатки на банковских счетах	2,29%	да
2	Обратное РЕПО	41,37%	да
3	Государственные ценные бумаги Республики Казахстан, выпущенные Министерством финансов РК и НБ РК, долговые ценные бумаги, выпущенные местными исполнительными органами РК	9,00%	да
4	Долговые ценные бумаги, выпущенные юридическим лицом, сто процентов акций которого принадлежат НБ РК	7,49%	да
5	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
6	Вклады в банках второго уровня Республики Казахстан	0,00%	да
7	Вклады в банках-нерезидентах	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

8	Долговые ценные бумаги, выпущенные международными финансовыми организациями	9,32%	да
9	Ценные бумаги, имеющие статус государственных, выпущенные центральными правительствами иностранных государств	6,57%	да
10	Акции и депозитарные расписки иностранных эмитентов	0,00%	да
11	Паи Exchange Traded Funds (ETF) структура активов которых повторяет структуру одного из фондовых индексов акций или ценообразование которых привязано к индексам акций	13,61%	да
12	Паи Exchange Traded Funds (ETF) структура активов которых повторяет структуру одного из индексов облигаций или ценообразование которых привязано к индексам облигаций и инструментов денежного рынка	0,00%	да
13	Паи Exchange Traded Funds (ETF), Exchange Traded Commodities (ETC), Exchange Traded Notes (ETN), ценообразование которых привязано к валютам, драгоценным металлам, товарно-сырьевым рынкам (commodities), или к рынку недвижимости (в том числе REIT в форме ETF или ETN)	0,00%	да
14	Долговые ценные бумаги, иностранных негосударственных эмитентов	0,00%	да
15	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
16	Долговые ценные бумаги, негосударственных эмитентов РК	10,36%	да
17	Производные финансовые инструменты	0,00%	да
18	Виды финансовых инструментов, указанные в строках 10, 11,12,13 и 15	13,61%	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
Купонные облигации (ASDBe14)	KZT	Азиатский банк развития	130 000 000,00
Ноты НБ РК (NTK027_2823)	KZT	ГУ "Национальный Банк Республики Казахстан"	239 999 932,34
ETF (VOO US)	USD	Vanguard S&P 500 ETF	10 953 285,04
ETF (SPY US)	USD	SPDR S&P 500 ETF TRUST	10 991 817,00
Итого			391 945 034,38

Таблица 7. Сведения по продаже финансовых инструментов в отчетном месяце

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