

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

По состоянию на 1 ноября 2022 года пенсионные активы (далее – ПА) АО «ЕНПФ» (далее – ЕНПФ), находящиеся в доверительном управлении АО «Halyk Global Markets» (далее – Halyk Global Markets), составили **2 611,89** 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 01.01.2022г.	Доля на 01.01.2022г.	Текущая стоимость на 01.11.2022г.	Доля на 01.11.2022г.	Прирост/снижение с 01.11.2022г.
Облигации банков второго уровня РК	155,3	7,54%	149,20	5,71%	-3,93%
Облигации МФО	120,2	5,83%	110,80	4,24%	-7,81%
Корпоративные облигации организаций РК	125,67	6,10%	116,82	4,47%	-7,04%
Облигации квазигосударственных организаций РК	296,51	14,39%	345,62	13,23%	16,56%
Долевые инструменты иностранных эмитентов (Паи ETF)	288,4	13,99%	345,46	13,23%	19,79%
Ноты НБРК	0	0,00%		0,00%	-
Акции и депозитарные расписки иностранных эмитентов	180,38	8,75%		0,00%	-
Ценные бумаги, имеющие статус государственных, выпущенные центральными правительствами иностранных государств			179,67	6,88%	-
Обратное Репо (не более 90 календарных дней)	892,98	43,33%	1 286,65	49,26%	44,08%
Прочие активы (дебиторская задолженность, просроченная задолженность, провизии)	0,38	0,02%	0,60	0,02%	59,73%
Денежные средства на счетах	1,02	0,05%	77,06	2,95%	7423,16%
Итого ПА, находящиеся в управлении Halyk Global Markets	2 060,84		2 611,89	100,00%	26,74%
Обязательства к оплате по совершенным сделкам	0		0		
Итого пенсионные активы	2 060,84	100,00%	2 611,89	100,00%	26,74%

По состоянию на 01.11.2022 г. средневзвешенная доходность долговых финансовых инструментов, номинированных в тенге, составила 16,09% годовых.

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 1286,65 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 49,26%. Средневзвешенная доходность операций обратного Репо на отчетную дату составила 15,85% годовых.

Облигации банков второго уровня Республики Казахстан

Текущая стоимость облигаций банков второго уровня Республики Казахстан (далее – РК) за отчетный месяц увеличилась на 1,51 млн. тенге и составила 149,20 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 5,71%.

Средневзвешенная доходность к погашению облигаций банков второго уровня РК на отчетную дату составила 32,06% годовых.

Облигации международных финансовых организаций

Текущая стоимость облигаций международных финансовых организаций за отчетный месяц снизилась на 11,55 млн тенге и составила 110,80 млн. тенге. Снижение произошло ввиду того, что на конец сентября 2022 года в стоимости облигаций (EABRb21) отражалось купонное вознаграждение, которое было начислено, но не выплачено. Доля в портфеле облигаций международных финансовых организаций составила 4,24%.

Средневзвешенная доходность к погашению по облигациям международных финансовых организаций, номинированным в тенге, с фиксированной ставкой вознаграждения составила 16,22% 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 11,68 млн. тенге и составила 345,46 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 13,23%.

Корпоративные облигации эмитентов РК

Текущая стоимость корпоративных облигаций эмитентов РК за отчетный месяц увеличилась на 1,10 млн. тенге и составила 116,82 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 4,47%.

Средневзвешенная доходность к погашению корпоративных облигаций эмитентов РК, номинированных в тенге, на отчетную дату составила 12,93% годовых.

Ценные бумаги, имеющие статус государственных, выпущенные центральными правительствами иностранных государств

Текущая стоимость ценных бумаг, имеющих статус государственных, выпущенных центральными правительствами иностранных государств, составила 179,67 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 6,88%.

Средневзвешенная доходность к погашению корпоративных облигаций эмитентов РК, номинированных в тенге, на отчетную дату составила 4,55% годовых.

Акции и депозитарные расписки иностранных эмитентов

По состоянию на 01.11.2022г. в инвестиционном портфеле ПА ЕНПФ, находящихся в доверительном управлении Halyk Global Markets, отсутствовали акции и депозитарные расписки иностранных эмитентов.

Облигации квазигосударственных организаций РК

Текущая стоимость облигаций квазигосударственных организаций РК за отчетный месяц выросла на 2,97 млн. тенге и составила 345,62 млн. тенге. Доля облигаций квазигосударственных организаций РК в портфеле составила 13,23%.

Средневзвешенная доходность к погашению облигаций квазигосударственных организаций РК, номинированных в тенге, на отчетную дату составила 16,22% 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

Валюта	Текущая стоимость на 01.01.2022г.	Доля на 01.01.2022г.	Текущая стоимость на 01.11.2022г.	Доля на 01.11.2022г.	Прирост/снижение с 01.01.2022 г.
Национальная валюта	1 591,16	77,21%	2 065,98	79,10%	29,84%
Доллары США	469,68	22,79%	545,91	20,90%	16,23%
Итого:	2 060,84	100,00%	2 611,89	100,00%	26,74%

млн. тенге

Результаты инвестиционной деятельности

В результате инвестиционной деятельности, размер начисленного инвестиционного дохода (по состоянию на 01 ноября 2022 года с момента передачи активов) составил 172,88 млн. тенге и размер начисленного инвестиционного дохода (по состоянию на 01 ноября 2022 года с 01 января 2022 года) составил 60,09 млн. тенге. Доходность пенсионных активов составила 10,90% с начала деятельности и 2,29% с начала 2022 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

Наименование	Инвестиционный доход за 10 мес. 2022г.
Доходы в виде вознаграждения по ценным бумагам, в том числе по размещенным вкладам и операциям «обратное РЕПО»	155,10
Доходы (убытки) от рыночной переоценки ценных бумаг	-104,47
Доходы (убытки) от переоценки иностранной валюты	-1,72
Прочие доходы (убытки)	11,18
Итого:	60,09

млн. тенге

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	01.10.2022	986,4505793
2	02.10.2022	986,4505793
3	03.10.2022	982,7406449
4	04.10.2022	982,7406449
5	05.10.2022	982,7406449
6	06.10.2022	982,7406449
7	07.10.2022	982,7406449
8	08.10.2022	982,7406449
9	09.10.2022	982,7406449
10	10.10.2022	985,5942862
11	11.10.2022	985,5942862
12	12.10.2022	985,5942862
13	13.10.2022	985,5942862

14	14.10.2022	985,5942862
15	15.10.2022	985,5942862
16	16.10.2022	985,5942862
17	17.10.2022	985,4092287
18	18.10.2022	985,4092287
19	19.10.2022	985,4092287
20	20.10.2022	985,4092287
21	21.10.2022	985,4092287
22	22.10.2022	985,4092287
23	23.10.2022	985,4092287
24	24.10.2022	985,4092287
25	25.10.2022	985,4092287
26	26.10.2022	996,0812623
27	27.10.2022	996,0812623
28	28.10.2022	996,0812623
29	29.10.2022	996,0812623
30	30.10.2022	996,0812623
31	31.10.2022	997,5252141

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 ноября 2022 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	2,97%	да
	Обратное РЕПО	49,26%	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	4,24%	да
4	Вклады в банках второго уровня Республики Казахстан	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

5	Вклады в банках-нерезидентах	0,00%	да
6	Долговые ценные бумаги, выпущенные международными финансовыми организациями	0,00%	да
7	Ценные бумаги, имеющие статус государственных, выпущенные центральными правительствами иностранных государств	6,88%	да
8	Акции и депозитарные расписки иностранных эмитентов, паи Exchange Traded Funds (ETF), Exchange Traded Commodities (ETC), Exchange Traded Notes (ETN)	13,23%	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	23,42%	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 0 10/05/23	USD	U.S. Treasury Department	183 495 213,03
Итого			183 495 213,03

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 погашений по ценным бумагам не было			
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			