

**Информация по инвестиционному управлению
пенсионными активами АО «ЕНПФ»
в доверительном управлении АО «Сентрас Секьюритиз»**

По состоянию на 1 декабря 2022 года пенсионные активы (далее – ПА) ЕНПФ, находящиеся в доверительном управлении АО «Сентрас Секьюритиз» (далее – Сентрас Секьюритиз), составили 971,11 млн. тенге.

Структура инвестиционного портфеля финансовых инструментов, сформированного за счет пенсионных активов ЕНПФ, находящихся в доверительном управлении Сентрас Секьюритиз, представлена в Таблице 1.

Таблица 1. Структура инвестиционного портфеля ПА ЕНПФ, находящихся в доверительном управлении Сентрас Секьюритиз, в разрезе финансовых инструментов

млн. тенге

Наименование	Текущая стоимость на 01.01.2022 г.	Доля на 01.01.2022 г.	Текущая стоимость на 01.12.2022 г.	Доля на 01.12.2022 г.	Прирост/снижение с начала года.
ГЦБ МФ РК	560,90	69,29%	528,39	54,41%	-5,80%
Облигации квазигосударственных организаций РК	0,00	0,00%	86,46	8,90%	0,00%
Акции и депозитарные расписки эмитентов РК	119,26	14,73%	70,73	7,28%	-40,69%
Долевые инструменты иностранных эмитентов (Паи ETF)	0,00	0,00%	28,77	2,96%	0,00%
Репо	127,09	15,70%	154,24	15,88%	21,36%
Денежные средства на инвестиционных счетах	2,20	0,27%	102,52	10,56%	4562,55%
Итого ПА, находящиеся в управлении УИП	809,46	100,00%	971,11	100,00%	19,97%
Обязательства к оплате по совершенным сделкам	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00%
Итого пенсионные активы	809,46		971,11		19,97%

По состоянию на 01.12.2022г. средневзвешенная доходность к погашению (YTM) долговых финансовых инструментов и РЕПО, номинированных в тенге, составила 11,96% годовых.

Денежные средства и операции обратное РЕПО

Текущая стоимость операций обратного РЕПО за отчетный месяц составила 154,24 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 15,88%. На конец отчетного периода остатки денежных средств на инвестиционных счетах составили 102,52 млн. тенге. Суммарная доля денежных средств и требований по операциям обратного РЕПО на конец отчетного месяца составила 26,44%.

Государственные ценные бумаги Министерства финансов Республики Казахстан

Текущая стоимость Государственных ценных бумаг Министерства финансов Республики Казахстан, которые занимают основную долю в портфеле, на конец отчетного месяца составила 528,39 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 54,41%.

На отчетную дату средневзвешенная доходность к погашению по ГЦБ Министерства финансов РК, номинированным в тенге, составила 11,61% годовых.

Облигации квазигосударственных организаций Республики Казахстан

На отчетную дату средневзвешенная доходность к погашению по облигациям квазигосударственных организаций Республики Казахстан, номинированным в тенге, составила 6,99% годовых. Текущая стоимость облигаций квазигосударственных организаций Республики Казахстан, номинированным в тенге, на конец отчетного месяца составила 86,46 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 8,90%.

В отчетном периоде Облигации квазигосударственных организаций РК не приобретались.

Акции и депозитарные расписки эмитентов Республики Казахстан

Текущая стоимость акций и депозитарных расписок эмитентов Республики Казахстан на конец отчетного месяца составила 70,73 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 7,28%.

Долевые инструменты иностранных эмитентов (Паи ETF)

Текущая стоимость долевых инструментов иностранных эмитентов (Паи ETF) на конец отчетного месяца составила 28,77 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 2,96%. В отчетном периоде была совершена покупка паев ETF эмитентов SPDR PORTFOLIO S&P 500 ETF.

Валютная структура

Инвестиционный портфель финансовых инструментов в разрезе валют, в которых номинированы финансовые инструменты, приобретенные за счет пенсионных активов ЕНПФ в доверительном управлении Центрас Секьюритиз, представлен в Таблице 2.

В отчетном периоде сделок купли-продажи с иностранной валютой на Казахстанской фондовой бирже не заключалось.

Таблица 2. Структура инвестиционного портфеля ПА ЕНПФ, находящихся в доверительном управлении Центрас Секьюритиз, в разрезе валют

Валюта	Текущая стоимость на 01.01.2022 г.	Доля на 01.01.2022 г.	Текущая стоимость на 01.12.2022 г.	Доля на 01.12.2022 г.	Прирост/снижение с начала года
Национальная валюта	809,46	100%	777,05	80,02%	-4,00%
Доллары США	0,00	0,00	194,06	19,98%	0,00%
Российские рубли	0,00	0,00	0,00	0,00%	-
Другие валюты	0,00	0,00	0,00	0,00%	-
Итого:	809,46	100%	971,11	100%	19,97%

млн. тенге

Результаты инвестиционной деятельности

В результате инвестиционной деятельности и изменения рыночной стоимости финансовых инструментов, размер начисленного инвестиционного дохода с начала 2022 года составил 26,44 млн. тенге. Доходность пенсионных активов с начала 2022 года составила 2,18%.

Структура начисленного инвестиционного дохода за указанный период представлена в Таблице 3.

Таблица 3. Структура инвестиционного дохода, полученного по ПА ЕНПФ, находящихся в доверительном управлении Центрас Секьюритиз

Наименование	Инвестиционный доход за 2022 год
Доходы в виде вознаграждения по ценным бумагам, в том числе по размещенным вкладам и операциям «обратное РЕПО»	81,25
Доходы (убытки) от рыночной переоценки ценных бумаг	-76,20
Доходы (убытки) от переоценки иностранной валюты	2,55
Доходы (убытки) от переоценки прочих активов (ПФИ)	0,00
Доходы (убытки) по активам, находящимся во внешнем управлении	0,00
Прочие доходы (убытки)	18,84
Итого:	26,44

млн. тенге

Информация о стоимости условной единицы

Динамика стоимости условной пенсионной единицы ПА ЕНПФ, находящихся в доверительном управлении Центрас Секьюритиз представлена в Таблице 4.

Таблица 4. Стоимость одной условной единицы, находящихся в доверительном управлении Центрас Секьюритиз

№	Дата	Стоимость условной единицы
1	01.11.2022	1 016,7461923
2	02.11.2022	1 016,7461923
3	03.11.2022	1 016,7461923
4	04.11.2022	1 016,7461923
5	05.11.2022	1 016,7461923
6	06.11.2022	1 016,7461923
7	07.11.2022	1 017,6623954
8	08.11.2022	1 017,6623954
9	09.11.2022	1 017,6623954
10	10.11.2022	1 017,6623954
11	11.11.2022	1 017,6623954
12	12.11.2022	1 017,6623954
13	13.11.2022	1 017,6623954
14	14.11.2022	1 017,7854187
15	15.11.2022	1 017,7854187
16	16.11.2022	1 017,7854187
17	17.11.2022	1 017,7854187
18	18.11.2022	1 017,7854187
19	19.11.2022	1 017,7854187
20	20.11.2022	1 017,7854187
21	21.11.2022	1 005,1467172
22	22.11.2022	1 005,1467172
23	23.11.2022	1 005,1467172
24	24.11.2022	1 005,1467172
25	25.11.2022	1 005,1467172
26	26.11.2022	1 005,1467172
27	27.11.2022	1 005,1467172
28	28.11.2022	1 013,0243562
29	29.11.2022	1 013,0243562
30	30.11.2022	1 013,7635860

Информация о соблюдении параметров инвестиционной декларации

Структурное распределение ПА ЕНПФ, находящихся в доверительном управлении Центрас Секьюритиз, соответствует требованиям Инвестиционной декларации. Доли валютных позиций остаются в рамках допустимого уровня и не нарушают требований Инвестиционной декларации. Сведения о соблюдении лимитов инвестирования по ПА ЕНПФ, находящихся в доверительном управлении Центрас Секьюритиз, по состоянию на 1 декабря 2022 года представлены в Таблице 5.

Таблица 5. Лимиты инвестирования по ПА ЕНПФ, находящихся в доверительном управлении Центрас Секьюритиз

№	Вид финансового инструмента	Фактическое значение (в процентах от общего объема ПА)	Выполнение (да/нет)
1	Денежные средства в национальной валюте – тенге (KZT)	2,44%	да
2	Иностранная валюта других стран, согласно Постановлению	8,12%	да
3	Государственные ценные бумаги РК (в том числе, эмитированные в соответствии с законодательством иностранных государств), выпущенные Министерством финансов РК и Национальным Банком РК, а также ЦБ, выпущенные под гарантию и (или) поручительство Правительства РК	54,41%	да
4	Долговые ЦБ, выпущенные местными исполнительными органами РК	0,00%	да
5	Долговые ЦБ, выпущенные юридическим лицом, сто процентов акций которого принадлежат Национальному Банку РК	0,00%	да
6	Долговые ЦБ, выпущенные акционерными обществами «Банк Развития Казахстана», «Фонд национального благосостояния «Самрук-Казына», «Национальный управляющий холдинг «Байтерек», «Фонд проблемных кредитов» в соответствии с законодательством РК и других государств	0,00%	да
7	Вклады в банках второго уровня РК, согласно Постановлению	0,00%	да
8	Вклады в банках-нерезидентах, согласно Постановлению	0,00%	да
9	<p>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):</p> <p>Азиатский банк развития (the Asian Development Bank);</p> <p>Межамериканский банк развития (the Inter-American Development Bank);</p> <p>Африканский банк развития (the African Development Bank);</p> <p>Европейский банк реконструкции и развития (the European Bank for Reconstruction and Development);</p> <p>Европейский инвестиционный банк (the European Investment Bank);</p> <p>Банк Развития Европейского Совета (the Council of Europe Development Bank);</p> <p>Исламская корпорация по развитию частного сектора (the Islamic Corporation for the Development of the Private Sector);</p> <p>Исламский банк развития (the Islamic Development Bank);</p> <p>Многостороннее агентство гарантии инвестиций (the Multilateral Investment Guarantee Agency);</p> <p>Скандинавский инвестиционный банк (the Nordic Investment Bank);</p> <p>Международный валютный фонд (the International Monetary Fund);</p> <p>Международная ассоциация развития (the International Development Association);</p> <p>Международный центр по урегулированию инвестиционных споров (the International Centre for Settlement of Investment Disputes);</p> <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>	0,00%	да
10	ЦБ, имеющие статус государственных, выпущенные правительствами иностранных государств, согласно Постановлению	0,00%	да
11	<p>Негосударственные ЦБ, выпущенные иностранными организациями:</p> <p>*акции иностранных эмитентов, имеющих 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);</p> <p>*акции иностранных эмитентов, входящие в состав основных фондовых индексов, и депозитарные расписки, базовым активом которых являются данные акции;</p> <p>*долговые ЦБ, имеющие рейтинговую оценку не ниже</p>	0,00%	да

	«ВВ» 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).		
12	Негосударственные ЦБ, выпущенные организациями РК в соответствии с законодательством РК и других государств, согласно Постановлению	16,19%	да
13	Паи Exchange Traded Funds (Эксчейндж Трэйдэд Фандс), Exchange, Traded Commodities (Эксчейндж Трэйдэд Коммодитис), Exchange Traded Notes (Эксчейндж Трэйдэд Ноутс), согласно Постановлению	2,96%	да
14	Паи интервальных паевых инвестиционных фондов, управляющая компания которых является юридическим лицом, созданным в соответствии с законодательством РК, включенные в официальный список фондовой биржи, согласно Постановлению	0,00%	да
15	Аффинированные драгоценные металлы, согласно Постановлению	0,00%	да
16	Производные финансовые инструменты, заключенные в целях хеджирования, согласно Постановлению	0,00%	да

Информация по покупкам, продажам и погашениям финансовых инструментов, находящихся в инвестиционном портфеле ПА ЕНПФ в доверительном управлении Центрас Секьюритиз

Таблица 6. Сведения по приобретению финансовых инструментов в отчетном месяце

Вид инструмента	Валюта	Эмитент ценной бумаги	Сумма сделки в тенге
ETF	USD	SPDR PORTFOLIO S&P 500 ETF	10 731 950,23
Итого			10 731 950,23

Таблица 7. Сведения по продаже финансовых инструментов в отчетном месяце

Вид инструмента	Валюта	Эмитент ценной бумаги	Сумма сделки в тенге
-	-	-	-
Итого			-