

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

По состоянию на 1 июля 2023 года пенсионные активы (далее – ПА) АО «ЕНПФ» (далее – ЕНПФ), находящиеся в доверительном управлении АО «Halyk Global Markets» (далее – Halyk Global Markets), составили **2 425,34** 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

<i>млн. тенге</i>					
Наименование	Текущая стоимость на 01.01.2023г.	Доля на 01.01.2023г.	Текущая стоимость на 01.07.2023г.	Доля на 01.07.2023г.	Прирост/снижение с 01.01.2023 г.
Облигации банков второго уровня РК	49,39	1,88%	50,58	2,09%	2,41%
Облигации МФО	115,27	4,38%	273,69	11,28%	137,44%
Корпоративные облигации организаций РК	121,62	4,62%	124,38	5,13%	2,27%
Облигации квазигосударственных организаций РК	330,81	12,57%	522,33	21,54%	57,89%
Долевые инструменты иностранных эмитентов (Паи ETF)	334,78	12,72%	393,81	16,24%	17,63%
Ноты НБРК	0,00	0,00%	0,00	0,00%	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%	178,42	7,36%	-0,18%
Обратное РЕПО (не более 90 календарных дней)	1 307,42	49,69%	864,02	35,62%	-33,91%
Прочие активы (дебиторская задолженность, просроченная задолженность, провизии)	0,66	0,03%	1,30	0,05%	95,79%
Денежные средства на счетах	62,51	2,38%	16,81	0,69%	-73,10%
Итого ПА, находящиеся в управлении Halyk Global Markets	2 631,21	100,00%	2 425,34	100,00%	-7,82%
Обязательства к оплате по совершенным сделкам	-	-	-	-	-
Итого пенсионные активы	2 631,21	100,00%	2 425,34	100,00%	-7,82%

По состоянию на 01.07.2023 г. средневзвешенная доходность долговых финансовых инструментов, номинированных в тенге, составила 13,74% годовых. Средневзвешенная доходность долговых финансовых инструментов, номинированных в долларах США, составила 5,46%.

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 864,02 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 35,62%. Средневзвешенная доходность операций обратного РЕПО на отчетную дату составила 17,50% годовых.

Облигации банков второго уровня Республики Казахстан

Текущая стоимость облигаций банков второго уровня Республики Казахстан (далее – РК) за отчетный месяц выросла на 0,43 млн. тенге и составила 50,58 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 2,09%.

Средневзвешенная доходность к погашению облигаций банков второго уровня РК на отчетную дату составила 11,65% годовых.

Облигации международных финансовых организаций

Текущая стоимость облигаций международных финансовых организаций за отчетный месяц выросла на 2,77 млн тенге и составила 273,69 млн. тенге. Доля в портфеле облигаций международных финансовых организаций составила 11,28%.

Средневзвешенная доходность к погашению по облигациям международных финансовых организаций, номинированным в тенге, с фиксированной ставкой вознаграждения составила 11,25% 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 увеличилась на 17,53 млн. тенге и составила 393,81 млн. тенге. Доля долевых инструментов иностранных эмитентов (ПАИ ETF) в портфеле составила 16,24%.

Корпоративные облигации эмитентов РК

Текущая стоимость корпоративных облигаций эмитентов РК за отчетный месяц выросла на 1,10 млн. тенге и составила 124,38 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 5,13%.

Средневзвешенная доходность к погашению корпоративных облигаций эмитентов РК, номинированных в тенге, на отчетную дату составила 11,45% 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 2,41 млн. тенге и составила 178,42 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 7,36%.

Средневзвешенная доходность к погашению ценных бумаг, имеющих статус государственных, выпущенных центральными правительствами иностранных государств, на отчетную дату составила 5,46% годовых.

Облигации квазигосударственных организаций РК

Текущая стоимость облигаций квазигосударственных организаций РК за отчетный месяц выросла на 8,59 млн. тенге и составила 522,33 млн. тенге. Доля облигаций квазигосударственных организаций РК в портфеле составила 21,54%.

Средневзвешенная доходность к погашению облигаций квазигосударственных организаций РК, номинированных в тенге, на отчетную дату составила 15,79% годовых.

Валютная структура

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

<i>млн. тенге</i>					
Валюта	Текущая стоимость на 01.01.2023г.	Доля на 01.01.2023г.	Текущая стоимость на 01.07.2023г.	Доля на 01.07.2023г.	Прирост/снижение с 01.01.2023г.
Национальная валюта	2 095,80	79,65%	1 839,02	75,83%	-12,25%
Доллары США	535,40	20,35%	586,31	24,17%	9,51%
Евро	0	0,00%	0,01	0,001%	0,00%
Итого:	2 631,21	100,00%	2 425,34	100,00%	-7,82%

Результаты инвестиционной деятельности

В результате инвестиционной деятельности, размер начисленного инвестиционного дохода (по состоянию на 01 июля 2023 года с 15 марта 2021 г.) составил 447,21 млн. тенге и размер начисленного инвестиционного дохода (по состоянию на 01 июля 2023 года с 01 января 2023 года) составил 223,81 млн. тенге. Доходность пенсионных активов составила 22,45% с начала деятельности и 8,40% 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

<i>млн. тенге</i>	
Наименование	Инвестиционный доход с начала 2023 года.
Доходы в виде вознаграждения по ценным бумагам, в том числе по размещенным вкладам и операциям «обратное РЕПО»	155,50
Доходы (убытки) от рыночной переоценки ценных бумаг	70,55
Доходы (убытки) от переоценки иностранной валюты	-1,24
Прочие доходы (убытки)	-1,00
Итого:	223,81

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	01.06.2023	1 082,2851110
2	02.06.2023	1 082,2851110
3	03.06.2023	1 082,2851110
4	04.06.2023	1 082,2851110
5	05.06.2023	1 089,3521050
6	06.06.2023	1 089,3521050
7	07.06.2023	1 089,3521050
8	08.06.2023	1 089,3521050
9	09.06.2023	1 089,3521050
10	10.06.2023	1 089,3521050
11	11.06.2023	1 089,3521050
12	12.06.2023	1 091,3951174
13	13.06.2023	1 091,3951174
14	14.06.2023	1 091,3951174
15	15.06.2023	1 091,3951174
16	16.06.2023	1 091,3951174

17	17.06.2023	1 091,3951174
18	18.06.2023	1 091,3951174
19	19.06.2023	1 097,4611839
20	20.06.2023	1 097,4611839
21	21.06.2023	1 097,4611839
22	22.06.2023	1 097,4611839
23	23.06.2023	1 097,4611839
24	24.06.2023	1 097,4611839
25	25.06.2023	1 097,4611839
26	26.06.2023	1 099,4961147
27	27.06.2023	1 099,4961147
28	28.06.2023	1 099,4961147
29	29.06.2023	1 099,4961147
30	30.06.2023	1 101,3741577

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 июля 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	0,75%	да
2	Обратное РЕПО	35,62%	да
3	Государственные ценные бумаги Республики Казахстан, выпущенные Министерством финансов РК и НБ РК, долговые ценные бумаги, выпущенные местными исполнительными органами РК	0,00%	да
4	Долговые ценные бумаги, выпущенные юридическим лицом, сто процентов акций которого принадлежат НБ РК	8,67%	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	7,44%	да
6	Вклады в банках второго уровня Республики Казахстан		да
7	Вклады в банках-нерезидентах		да
8	Долговые ценные бумаги, выпущенные международными финансовыми организациями	11,28%	да
9	Ценные бумаги, имеющие статус государственных, выпущенные центральными правительствами иностранных государств	7,36%	да
10	Акции и депозитарные расписки иностранных эмитентов		да
11	Паи Exchange Traded Funds (ETF) структура активов которых повторяет структуру одного из фондовых индексов акций или ценообразование которых привязано к индексам акций	16,24%	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

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		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)		да
14	Долговые ценные бумаги, иностранных негосударственных эмитентов		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		да
16	Долговые ценные бумаги, негосударственных эмитентов РК	12,65%	да
17	Производные финансовые инструменты		да
18	Виды финансовых инструментов, указанные в строках 10, 11,12,13 и 15	16,24%	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
Ноты НБ РК (NTK029_2829)	KZT	ГУ "Национальный Банк Республики Казахстан"	226 999 919,90
Итого			226 999 919,90

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	Стоимость сделки, в тенге
Ноты НБ РК (NTK029_2829)	KZT	ГУ "Национальный Банк Республики Казахстан"	229 789 100,00
Итого			229 789 100,00

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			