

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

По состоянию на 1 ноября 2021 года пенсионные активы (далее – ПА) ЕНПФ, находящиеся в доверительном управлении АО «Сентрас Секьюритиз» (далее – Сентрас Секьюритиз), составили 572,98 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 01.05.2021 г. | Доля на 01.05.2021 г. | Текущая стоимость на 01.11.2021 г. | Доля на 01.11.2021 г. | Прирост/снижение с 01.05.2021 г. |
|---|------------------------------------|-----------------------|------------------------------------|-----------------------|----------------------------------|
| ГЦБ МФ РК | 267,54 | 79,31% | 496,66 | 86,68% | 85,64% |
| Акции и депозитарные расписки эмитентов РК | 0,00 | 0,00% | 76,27 | 13,31% | |
| Репо | 69,06 | 20,47% | 0,00 | 0,00% | -100% |
| Денежные средства на инвестиционных счетах | 0,74 | 0,22% | 0,05 | 0,01% | |
| Итого ПА, находящиеся в управлении УИП | 337,35 | 100% | 572,98 | 100% | 69,85% |
| Обязательства к оплате по совершенным сделкам | 0,00 | 0,00% | 0,00 | 0,00% | |
| Итого пенсионные активы | 337,35 | | 572,98 | | 69,85% |

По состоянию на 01.11.2021г. средневзвешенная доходность к погашению (YTM) долговых финансовых инструментов, номинированных в тенге, составила 10,10% годовых.

Денежные средства на инвестиционных счетах

На конец отчетного периода остатки денежных средств на инвестиционных счетах составляли 0,05 млн. тенге. Доля денежных средств на конец отчетного месяца составила 0,01%.

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 496,66 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 86,68%.

В отчетном месяце были приобретены ГЦБ Министерства финансов РК, в объеме номинала 28,28 млн. тенге.

На отчетную дату средневзвешенная доходность к погашению по ГЦБ Министерства финансов РК, номинированным в тенге, составила 10,10% годовых.

Акции и депозитарные расписки эмитентов Республики Казахстан

Текущая стоимость акций и депозитарных расписок эмитентов Республики Казахстан на конец отчетного месяца составила 76,27 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 13,31%.

В отчетном периоде в портфель инвестиций были приобретены простые акции эмитента АО "Кселл" и АО "Народный Сберегательный Банк Казахстана".

Валютная структура

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

млн. тенге

| Валюта | Текущая стоимость на 01.05.2021 г. | Доля на 01.05.2021 г. | Текущая стоимость на 01.11.2021 г. | Доля на 01.11.2021 г. | Прирост/снижение с 01.05.2021 г. |
|---------------------|------------------------------------|-----------------------|------------------------------------|-----------------------|----------------------------------|
| Национальная валюта | 337,35 | 100% | 572,98 | 100% | 69,85% |
| Доллары США | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | - |
| Российские рубли | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | - |
| Другие валюты | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | - |
| Итого: | 337,35 | 100% | 572,98 | 100% | 69,85% |

Результаты инвестиционной деятельности

В результате инвестиционной деятельности и изменения рыночной стоимости финансовых инструментов, размер начисленного инвестиционного дохода составил 40,69 млн. тенге. Доходность пенсионных активов составила 8,45%.

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

млн. тенге

| Наименование | Инвестиционный доход за 2021 год |
|--|----------------------------------|
| Доходы в виде вознаграждения по ценным бумагам, в том числе по размещенным вкладам и операциям «обратное РЕПО» | 24,18 |
| Доходы (убытки) от рыночной переоценки ценных бумаг | 16,51 |
| Доходы (убытки) от переоценки иностранной валюты | 0,00 |
| Доходы (убытки) от переоценки прочих активов (ПФИ) | 0,00 |
| Доходы (убытки) по активам, находящимся во внешнем управлении | 0,00 |
| Прочие доходы (убытки) | 0,00 |
| Итого: | 40,69 |

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 | 01.10.2021 | 966,7408498 |
| 2 | 02.10.2021 | 966,7408498 |
| 3 | 03.10.2021 | 966,7408498 |
| 4 | 04.10.2021 | 966,3013091 |
| 5 | 05.10.2021 | 966,3013091 |
| 6 | 06.10.2021 | 966,3013091 |
| 7 | 07.10.2021 | 966,3013091 |
| 8 | 08.10.2021 | 966,3013091 |
| 9 | 09.10.2021 | 966,3013091 |

| | | |
|----|------------|-------------|
| 10 | 10.10.2021 | 966,3013091 |
| 11 | 11.10.2021 | 967,6518591 |
| 12 | 12.10.2021 | 967,6518591 |
| 13 | 13.10.2021 | 967,6518591 |
| 14 | 14.10.2021 | 967,6518591 |
| 15 | 15.10.2021 | 967,6518591 |
| 16 | 16.10.2021 | 967,6518591 |
| 17 | 17.10.2021 | 967,6518591 |
| 18 | 18.10.2021 | 977,4155409 |
| 19 | 19.10.2021 | 977,4155409 |
| 20 | 20.10.2021 | 977,4155409 |
| 21 | 21.10.2021 | 977,4155409 |
| 22 | 22.10.2021 | 977,4155409 |
| 23 | 23.10.2021 | 977,4155409 |
| 24 | 24.10.2021 | 977,4155409 |
| 25 | 25.10.2021 | 982,8285248 |
| 26 | 26.10.2021 | 982,8285248 |
| 27 | 27.10.2021 | 982,8285248 |
| 28 | 28.10.2021 | 982,8285248 |
| 29 | 29.10.2021 | 982,8285248 |
| 30 | 30.10.2021 | 982,8285248 |
| 31 | 31.10.2021 | 983,8291510 |

Информация о соблюдении параметров инвестиционной декларации

Структурное распределение ПА ЕНПФ, находящихся в доверительном управлении Сентрас 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 Сентрас Секьюритиз, по состоянию на 1 сентября 2021 года представлены в Таблице 5.

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

| № | Вид финансового инструмента | Фактическое значение (в процентах от общего объема ПА) | Выполнение (да/нет) |
|---|---|--|---------------------|
| 1 | Денежные средства в национальной валюте – тенге (KZT) | 0,01% | да |
| 2 | Иностранная валюта других стран, согласно Постановлению | 0,00% | 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 | 86,68% | 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 | 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): Азиатский банк развития (the Asian Development Bank); Межамериканский банк развития (the Inter-American Development Bank); Африканский банк развития (the African Development Bank); Евразийский банк развития (Eurasian Development Bank); Европейский банк реконструкции и развития (the European Bank for Reconstruction and Development); Европейский инвестиционный банк (the European Investment Bank); Банк Развития Европейского Совета (the Council of Europe Development Bank); Исламская корпорация по развитию частного сектора (the Islamic Corporation for the Development of the Private Sector); Исламский банк развития (the Islamic Development Bank); Многостороннее агентство гарантии инвестиций (the Multilateral Investment Guarantee Agency); Скандинавский инвестиционный банк (the Nordic Investment Bank); Международный валютный фонд (the International Monetary Fund); Международная ассоциация развития (the International Development Association); Международный центр по урегулированию инвестиционных споров (the International Centre for Settlement of Investment Disputes); Международный банк реконструкции и развития (the International Bank for Reconstruction and Development); Международная финансовая корпорация (the International Finance Corporation). | 0,00% | да |
| 10 | ЦБ, имеющие статус государственных, выпущенные правительствами иностранных государств, согласно Постановлению | 0,00% | да |
| 11 | Негосударственные ЦБ, выпущенные иностранными организациями: *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); *акции иностранных эмитентов, входящие в состав основных фондовых индексов, и депозитарные расписки, базовым активом которых являются данные акции; *долговые ЦБ, 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). | 0,00% | да |
| 12 | Негосударственные ЦБ, выпущенные организациями РК в соответствии с законодательством РК и других государств, согласно Постановлению | 13,31% | да |
| 13 | Паи Exchange Traded Funds (Экстейндж Трэйдэд Фандс), Exchange, Traded Commodities (Экстейндж Трэйдэд Коммодитис), Exchange Traded Notes (Экстейндж Трэйдэд Ноутс), согласно Постановлению | 0,00% | 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
Сентрас Секьюритиз**

Таблица 6. Сведения по приобретению финансовых инструментов в отчетном месяце

| Вид инструмента | Валюта | Эмитент ценной бумаги | Номинальная стоимость в тенге |
|------------------------|---------------|--|--------------------------------------|
| Простые акции | KZT | АО "Кселл" | 16 010 560,94 |
| Простые акции | KZT | АО "Народный Сберегательный Банк Казахстана" | 9 336 711,28 |
| ГЦБ РК | KZT | Министерство Финансов РК | 28 284 000 |
| Итого | | | 53 631 272,22 |