

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

По состоянию на 1 января 2023 года пенсионные активы (далее – ПА) АО «ЕНПФ» (далее – ЕНПФ), находящиеся в доверительном управлении АО «Halyk Global Markets» (далее – Halyk Global Markets), составили **2 631,21** 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 01.01.2023г.	Доля на 01.01.2023г.	Прирост/снижение с 01.01.2022г.
Облигации банков второго уровня РК	155,30	7,54%	49,39	1,88%	-68,20%
Облигации МФО	120,20	5,83%	115,27	4,38%	-4,10%
Корпоративные облигации организаций РК	125,67	6,10%	121,62	4,62%	-3,22%
Облигации квазигосударственных организаций РК	296,51	14,39%	330,81	12,57%	11,57%
Долевые инструменты иностранных эмитентов (Паи ETF)	288,40	13,99%	334,78	12,72%	16,08%
Ноты НБРК	-	-	-	-	-
Акции и депозитарные расписки иностранных эмитентов	180,38	8,75%	-	-	-
Акции и депозитарные расписки, выпущенные организациями Республики Казахстан			130,00	4,94%	-
Ценные бумаги, имеющие статус государственных, выпущенные центральными правительствами иностранных государств	-	-	178,74	6,79%	-
Обратное Repo (не более 90 календарных дней)	892,98	43,33%	1 307,42	49,69%	46,41%
Прочие активы (дебиторская задолженность, просроченная задолженность, провизии)	0,38	0,02%	0,66	0,03%	
Денежные средства на счетах	1,02	0,05%	62,51	2,38%	6002,91%
<b>Итого ПА, находящиеся в управлении Halyk Global Markets</b>	<b>2 060,84</b>	<b>100,00%</b>	<b>2 631,21</b>	<b>100,00%</b>	<b>27,68%</b>
Обязательства к оплате по совершенным сделкам	0	-	0	-	-
<b>Итого пенсионные активы</b>	<b>2 060,84</b>	<b>100,00%</b>	<b>2 631,21</b>	<b>100,00%</b>	<b>27,68%</b>

По состоянию на 01.01.2023 г. средневзвешенная доходность долговых финансовых инструментов, номинированных в тенге, составила 13,24% годовых. Средневзвешенная доходность долговых финансовых инструментов, номинированных в долларах США, составила 4,62%.

### **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 1307,42 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 49,69%. Средневзвешенная доходность операций обратного РЕПО на отчетную дату составила 16,38% годовых.

### **Облигации банков второго уровня Республики Казахстан**

Текущая стоимость облигаций банков второго уровня Республики Казахстан (далее – РК) за отчетный месяц снизилась на 103,96 млн. тенге и составила 49,39 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 1,88%. В отчетном периоде произошло погашение облигаций ДБ АО "Хоум Кредит энд Финанс Банк" на сумму 100 млн. тенге.

Средневзвешенная доходность к погашению облигаций банков второго уровня РК на отчетную дату составила 12,36% годовых.

### **Облигации международных финансовых организаций**

Текущая стоимость облигаций международных финансовых организаций за отчетный месяц выросла на 1,05 млн тенге и составила 115,27 млн. тенге. Доля в портфеле облигаций международных финансовых организаций составила 4,38%.

Средневзвешенная доходность к погашению по облигациям международных финансовых организаций, номинированным в тенге, с фиксированной ставкой вознаграждения составила 15,19% 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 снизилась на 22,25 млн. тенге и составила 334,78 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 12,72%.

### **Корпоративные облигации эмитентов РК**

Текущая стоимость корпоративных облигаций эмитентов РК за отчетный месяц увеличилась на 1,10 млн. тенге и составила 121,62 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 4,62%.

Средневзвешенная доходность к погашению корпоративных облигаций эмитентов РК, номинированных в тенге, на отчетную дату составила 12,21% 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 снизилась на 1,61 млн. тенге и составила 178,74 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 6,79%.

Средневзвешенная доходность к погашению ценных бумаг, имеющих статус государственных, выпущенных центральными правительствами иностранных государств, на отчетную дату составила 4,62% годовых.

### **Акции и депозитарные расписки иностранных эмитентов**

По состоянию на 01.01.2023г. в инвестиционном портфеле ПА ЕНПФ, находящихся в доверительном управлении Halyk Global Markets, отсутствовали акции и депозитарные расписки иностранных эмитентов.

### **Акции и депозитарные расписки эмитентов РК**

По состоянию на 01.01.2023г. в инвестиционном портфеле ПА ЕНПФ, находящихся в доверительном управлении Halyk Global Markets, присутствовали акции и депозитарные

расписки эмитентов РК, текущая стоимость которых составила 130,00 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 4,94%.

В отчетном периоде была совершена сделка по приобретению 15 465 простых акций АО "НК КазМунайГаз" на общую сумму 130,00 млн. тенге.

### Облигации квазигосударственных организаций РК

Текущая стоимость облигаций квазигосударственных организаций РК за отчетный месяц снизилась на 24,19 млн. тенге и составила 330,81 млн. тенге. Доля облигаций квазигосударственных организаций РК в портфеле составила 12,57%. В отчетном периоде произошло погашение облигаций АО «Казахстанский фонд устойчивости» на сумму 25 млн. тенге.

Средневзвешенная доходность к погашению облигаций квазигосударственных организаций РК, номинированных в тенге, на отчетную дату составила 13,06% 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**

<i>млн. тенге</i>					
Валюта	Текущая стоимость на 01.01.2022г.	Доля на 01.01.2022г.	Текущая стоимость на 01.01.2023г.	Доля на 01.01.2023г.	Прирост/снижение с 01.01.2022 г.
Национальная валюта	1 591,16	77,21%	2 095,80	79,65%	31,72%
Доллары США	469,68	22,79%	535,40	20,35%	13,99%
<b>Итого:</b>	<b>2 060,84</b>	<b>100,00%</b>	<b>2 631,21</b>	<b>100,00%</b>	<b>27,68%</b>

### Результаты инвестиционной деятельности

В результате инвестиционной деятельности, размер начисленного инвестиционного дохода (по состоянию на 01 января 2023 года с момента передачи активов) составил 223,40 млн. тенге и размер начисленного инвестиционного дохода (по состоянию на 01 января 2023 года с 01 января 2022 года) составил 110,61 млн. тенге. Доходность пенсионных активов составила 12,95% с начала деятельности и 4,19% 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**

<i>млн. тенге</i>	
Наименование	Инвестиционный доход с начала 2022 года.
Доходы в виде вознаграждения по ценным бумагам, в том числе по размещенным вкладам и операциям «обратное РЕПО»	203,85
Доходы (убытки) от рыночной переоценки ценных бумаг	- 100,09
Доходы (убытки) от переоценки иностранной валюты	- 4,15
Прочие доходы (убытки)	11,00
<b>Итого:</b>	<b>110,61</b>

### 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	01.12.2022	1 015,5889819
2	02.12.2022	1 015,5889819
3	03.12.2022	1 015,5889819
4	04.12.2022	1 015,5889819
5	05.12.2022	1 019,0252385
6	06.12.2022	1 019,0252385
7	07.12.2022	1 019,0252385
8	08.12.2022	1 019,0252385
9	09.12.2022	1 019,0252385
10	10.12.2022	1 019,0252385
11	11.12.2022	1 019,0252385
12	12.12.2022	1 017,4345353
13	13.12.2022	1 017,4345353
14	14.12.2022	1 017,4345353
15	15.12.2022	1 017,4345353
16	16.12.2022	1 017,4345353
17	17.12.2022	1 017,4345353
18	18.12.2022	1 017,4345353
19	19.12.2022	1 015,8299324
20	20.12.2022	1 015,8299324
21	21.12.2022	1 015,8299324
22	22.12.2022	1 015,8299324
23	23.12.2022	1 015,8299324
24	24.12.2022	1 015,8299324
25	25.12.2022	1 015,8299324
26	26.12.2022	1 014,4286646
27	27.12.2022	1 014,4286646
28	28.12.2022	1 014,4286646
29	29.12.2022	1 014,4286646
30	30.12.2022	1 014,4286646
31	31.12.2022	1 015,9992123

#### **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 Markets<sup>1</sup>. 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 января 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)
	Денежные средства, включая остатки на банковских счетах	2,40%	да
	Обратное РЕПО	49,69%	да
1	Государственные ценные бумаги Республики Казахстан, выпущенные Министерством финансов РК и НБ РК, долговые ценные бумаги,	0,00%	да

<sup>1</sup> 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

	выпущенные местными исполнительными органами РК, долговые ценные бумаги, выпущенные юридическим лицом, сто процентов акций которого принадлежат НБ РК		
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	4,38%	да
4	Вклады в банках второго уровня Республики Казахстан	0,00%	да
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	6,79%	да
8	Акции и депозитарные расписки иностранных эмитентов, паи Exchange Traded Funds (ETF), Exchange Traded Commodities (ETC), Exchange Traded Notes (ETN)	12,72%	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	4,94%	да
11	Долговые ценные бумаги, негосударственных эмитентов РК	19,07%	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
Простые акции	KZT	АО "НК КазМунайГаз"	129 998 790
<b>Итого</b>			<b>129 998 790</b>

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			
<b>Итого</b>			

Таблица 8. Сведения по погашениям основного долга по ценным бумагам в отчетном месяце

Вид инструмента	Валюта	Эмитент ценной бумаги	Сумма сделки в тенге
Купонные облигации (KFUSb33)	KZT	АО "Казахстанский фонд устойчивости"	25 000 000
Дисконтные облигации (НСBNb5)	KZT	Дочерний банк АО "Хоум Кредит энд Финанс Банк"	100 000 000
<b>Итого</b>			<b>125 000 000</b>

**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			
<b>Итого</b>			

**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			
<b>Итого</b>			