

Информация по инвестиционному управлению пенсионными активами АО «ЕНПФ»

По состоянию на 1 декабря 2021 года пенсионные активы (далее – ПА) ЕНПФ, находящиеся в доверительном управлении АО «Halyk Global Markets» (далее – Halyk Global Markets), составили 1 671,32 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	<i>млн. тенге</i>				
	Текущая стоимость на 01.04.2021 г.	Доля на 01.04.2021 г.	Текущая стоимость на 01.12.2021 г.	Доля на 01.12.2021 г.	Прирост/снижение с 01.04.2021 г.
Обратное Репо (не более 90 календарных дней)	500,46	99,50%	220,00	13,16%	-56,04%
Ноты НБРК	0	0,00%	323,07	19,33%	-
Облигации банков второго уровня РК	0	0,00%	157,09	9,40%	-
МФО	0	0,00%	122,42	7,32%	-
Долевые инструменты иностранных эмитентов (Паи ETF)	0	0,00%	283,52	16,96%	-
Акции и депозитарные расписки иностранных эмитентов	0	0,00%	186,75	11,17%	-
Денежные средства на счетах	2,51	0,50%	1,00	0,06%	-60,21%
Корпоративные облигации организаций РК	0	0,00%	124,66	7,46%	-
Облигации квазигосударственных организаций РК	0	0,00%	252,64	15,12%	-
Прочие активы (дебиторская задолженность, просроченная задолженность, провизии)	0	0,00%	0,17	0,01%	
Итого ПА, находящиеся в управлении Halyk Global Markets	502,97	100,00%	1 671,32	100,00%	232,29%
Обязательства к оплате по совершенным сделкам	0	0,00%	0	0,00%	-
Итого пенсионные активы	502,97		1 671,32		232,29%

По состоянию на 01.12.2021г. средневзвешенная доходность долговых финансовых инструментов и операций обратного Репо, находящихся в инвестиционном портфеле ПА ЕНПФ в доверительном управлении Halyk Global Markets, номинированных в тенге, составила 10,56% годовых.

Операции обратного Репо (не более 90 календарных дней).

В инвестиционном портфеле ПА ЕНПФ в доверительном управлении Halyk Global Markets, присутствует операции обратного Репо, текущая стоимость которых за отчетный месяц выросла на 74,89 млн тенге и составила 220,00 млн тенге. Их доля в портфеле составила 13,16%. Средневзвешенная доходность операций обратного Репо, в инвестиционном портфеле ПА ЕНПФ, находящихся в доверительном управлении Halyk Global Markets, номинированных в тенге, на отчетную дату составила 10,75% годовых.

Ноты Национального Банка Республики Казахстан

Значительная доля в инвестиционном портфеле ПА ЕНПФ в доверительном управлении Halyk Global Markets, занимают ноты Национального Банка Республики Казахстан, текущая стоимость которых за отчетный месяц выросла на 2,70 млн тенге и составила 323,07 млн тенге. Их доля в портфеле составила 19,33%.

Средневзвешенная доходность к погашению нот Национального Банка Республики Казахстан в инвестиционном портфеле ПА ЕНПФ в доверительном управлении Halyk Global Markets, номинированных в тенге, на отчетную дату составила 9,33% годовых.

Облигации банков второго уровня Республики Казахстан.

В дополнение к этому, в инвестиционном портфеле ПА ЕНПФ, находящихся в доверительном управлении Halyk Global Markets, присутствуют долговые ценные бумаги банков второго уровня Республики Казахстан, текущая стоимость которых за отчетный месяц увеличилась на 1,51 млн тенге и составила 157,09 млн тенге. Их доля в портфеле составила 9,40%.

Средневзвешенная доходность к погашению долговых ценных бумаг банков второго уровня Республики Казахстан в инвестиционном портфеле ПА ЕНПФ, находящихся в доверительном управлении Halyk Global Markets, номинированных в тенге, на отчетную дату составила 11,96% годовых.

Облигации международных финансовых организаций

Текущая стоимость облигаций международных финансовых организаций за отчетный месяц выросла на 1,05 млн тенге и составила 122,42 млн тенге. Их доля в портфеле составила 7,32%.

Средневзвешенная доходность к погашению по облигациям международных финансовых организаций, номинированным в тенге, с фиксированной ставкой вознаграждения составила 10,47% годовых.

Долевые инструменты иностранных эмитентов (ПАИ ETF)

Также, 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 6,89 млн тенге и составила 283,52 млн тенге. Их доля в портфеле составила 16,96%.

Корпоративные облигации эмитентов РК

В дополнение к этому, в инвестиционном портфеле ПА ЕНПФ, находящихся в доверительном управлении Halyk Global Markets, присутствуют Корпоративные облигации эмитентов РК, текущая стоимость которых за отчетный месяц увеличилась на 1,10 млн тенге и составила 124,66 млн тенге. Их доля в портфеле составила 7,46%.

Средневзвешенная доходность к погашению корпоративных облигаций эмитентов РК в инвестиционном портфеле ПА ЕНПФ, находящихся в доверительном управлении Halyk Global Markets, номинированных в тенге, на отчетную дату составила 10,99% годовых.

Акции и депозитарные расписки иностранных эмитентов

Также, в инвестиционном портфеле ПА ЕНПФ, находящихся в доверительном управлении Halyk Global Markets, присутствуют акции иностранных эмитентов, текущая стоимость которых за отчетный месяц увеличилась на 33,47 млн тенге и составила 186,75 млн тенге. Их доля в портфеле составила 11,17%.

В отчетном периоде была совершена покупка депозитарных расписок компании ASML Holding N.V. и глобальных депозитарных расписок ПАО «Сбербанк» на общую сумму 39,98 млн тенге.

Облигации квазигосударственных организаций РК

В дополнение к этому, в инвестиционном портфеле ПА ЕНПФ, находящихся в доверительном управлении Halyk Global Markets, присутствуют облигации квазигосударственных организаций РК, текущая стоимость которых за отчетный месяц выросла на 2,18 млн тенге и составила 252,64 млн тенге. Их доля в портфеле составила 15,12%.

Средневзвешенная доходность к погашению облигаций квазигосударственных организаций РК в инвестиционном портфеле ПА ЕНПФ, находящихся в доверительном управлении Halyk Global Markets, номинированных в тенге, на отчетную дату составила 10,93% 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	<i>млн. тенге</i>				
	Текущая стоимость на 01.04.2021г.	Доля на 01.04.2021г.	Текущая стоимость на 01.12.2021г.	Доля на 01.12.2021г.	Прирост/снижение с 01.04.2021 г.
Национальная валюта	502,97	100%	1 200,88	71,85%	138,76%
Доллары США	0	0,00%	470,44	28,15%	-
Итого:	502,97	100,00%	1 671,32	100,00%	232,29%

Результаты инвестиционной деятельности

В результате инвестиционной деятельности, размер начисленного инвестиционного дохода (по состоянию на 1 декабря 2021 года с начала деятельности) составил 86,15 млн тенге. Доходность пенсионных активов составила 6,87%.

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	<i>млн. тенге</i>
	Инвестиционный доход за отчетный период
Доходы в виде вознаграждения по ценным бумагам, в том числе по размещенным вкладам и операциям «обратное РЕПО»	62,90
Доходы (убытки) от рыночной переоценки ценных бумаг	24,06
Доходы (убытки) от переоценки иностранной валюты	0,23
Прочие доходы (убытки)	-1,04
Итого:	86,15

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	01.11.2021.	956,3423434
2	02.11.2021.	956,3423434
3	03.11.2021.	956,3423434
4	04.11.2021.	956,3423434
5	05.11.2021.	956,3423434
6	06.11.2021.	956,3423434
7	07.11.2021.	956,3423434
8	08.11.2021.	960,0933364
9	09.11.2021.	960,0933364
10	10.11.2021.	960,0933364
11	11.11.2021.	960,0933364
12	12.11.2021.	960,0933364
13	13.11.2021.	960,0933364
14	14.11.2021.	960,0933364
15	15.11.2021.	963,3845769
16	16.11.2021.	963,3845769
17	17.11.2021.	963,3845769
18	18.11.2021.	963,3845769
19	19.11.2021.	963,3845769
20	20.11.2021.	963,3845769
21	21.11.2021.	963,3845769

22	22.11.2021.	963,5965409
23	23.11.2021.	963,5965409
24	24.11.2021.	963,5965409
25	25.11.2021.	963,5965409
26	26.11.2021.	963,5965409
27	27.11.2021.	963,5965409
28	28.11.2021.	963,5965409
29	29.11.2021.	961,0236983
30	30.11.2021.	961,2556845

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 1 декабря 2021 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	0,06%	да
	Обратное РЕПО	13,16%	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	27,02%	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 или эмитента не ниже «BB+» по международной шкале агентства «Standard & Poor's» или рейтинговой оценкой аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств	7,33%	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	0,00%	да
8	Акции и депозитарные расписки иностранных эмитентов, паи Exchange Traded Funds (ETF), Exchange Traded Commodities (ETC), Exchange Traded Notes (ETN)	28,14%	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	24,29%	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

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

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
Депозитарные расписки	USD	ПАО «Сбербанк»	20 307 160,65
Депозитарные расписки	USD	ASML Holding N.V.	19 673 140,42
Итого	USD		39 980 301,07