

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

По состоянию на 1 августа 2024 года пенсионные активы (далее – ПА) ЕНПФ, находящиеся в доверительном управлении АО «Сентрас Секьюритиз» (далее – Сентрас Секьюритиз), составили 1 363,33 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 01.01.2024 г.	Доля на 01.01.2024 г.	Текущая стоимость на 01.08.2024 г.	Доля на 01.08.2024 г.	Прирост/снижение с начала года.
ГЦБ МФ РК	346,86	33,89%	342,93	25,15%	-1,13%
Облигации квазигосударственных организаций РК	197,07	19,25%	191,53	14,05%	-2,81%
Облигации БВУ РК	168,85	16,50%	121,66	8,92%	-27,95%
Корпоративные облигации эмитентов РК	-	-	103,40	7,58%	-
Акции и депозитарные расписки эмитентов РК	83,98	8,21%	147,30	10,80%	75,39%
Долевые инструменты иностранных эмитентов (Паи ETF)	9,48	0,93%	9,84	0,72%	3,84%
Акции и депозитарные расписки иностранных эмитентов	21,86	2,14%	45,25	3,32%	107,03%
Государственные облигации США	81,04	7,92%	108,13	7,93%	33,43%
Обратное РЕПО	88,07	8,60%	237,03	17,39%	169,13%
Прочие активы (дебиторская задолженность, просроченная задолженность, провизии)	-	-	0,31	0,02%	-
Денежные средства на инвестиционных счетах	26,33	2,57%	55,94	4,10%	112,43%
Итого ПА, находящиеся в управлении УИП	1 023,54	100,00%	1 363,33	100,00%	33,20%
Обязательства к оплате по совершенным сделкам	-	-	0,00	0,00%	-
Итого пенсионные активы	1 023,54	-	1 363,33	-	33,20%

По состоянию на 01.08.2024 г. средневзвешенная доходность к погашению (YTM) долговых финансовых инструментов составила 11,65% годовых.

Денежные средства на инвестиционных счетах и операции обратное РЕПО

На конец отчетного периода остатки денежных средств на инвестиционных счетах составили 55,94 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 4,10%. На конец отчетного периода

остатки денежных средств по операциям РЕПО составили 237,03 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 17,39%. Средневзвешенная доходность операций обратного РЕПО на отчетную дату составила 14,36% годовых.

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 342,93 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 25,15%. На отчетную дату средневзвешенная доходность к погашению по ГЦБ Министерства финансов РК, номинированным в тенге, составила 12,94% годовых.

Облигации квазигосударственных организаций Республики Казахстан

На отчетную дату средневзвешенная доходность к погашению по облигациям квазигосударственных организаций Республики Казахстан составила 5,89% годовых в долларах США и 14,10% годовых в тенге. Текущая стоимость облигаций квазигосударственных организаций Республики Казахстан на конец отчетного месяца составила 191,53 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 14,05%.

Облигации БВУ РК

На отчетную дату средневзвешенная доходность к погашению по облигациям составила 11,32% годовых. Текущая стоимость облигаций на конец отчетного месяца составила 121,66 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 8,92%.

В отчетном периоде была совершена сделка по покупке купонных облигаций АО «Home Credit Bank».

Корпоративные облигации эмитентов РК

На отчетную дату средневзвешенная доходность к погашению по облигациям составила 17,17% годовых. Текущая стоимость облигаций на конец отчетного месяца составила 103,40 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 7,58%.

Акции и депозитарные расписки эмитентов Республики Казахстан

Текущая стоимость акций и депозитарных расписок эмитентов Республики Казахстан на конец отчетного месяца составила 147,30 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 10,80%.

В отчетном периоде была совершена сделка по покупке акций АО «KEGOC».

Государственные облигации США

В отчетном периоде была совершена покупка казначейских обязательств US Treasury. Текущая стоимость на конец отчетного месяца составила 108,13 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 7,93%. На отчетную дату средневзвешенная доходность к погашению по государственным облигациям США составила 5,41% годовых в долларах США.

Долевые инструменты иностранных эмитентов (Паи ETF)

Текущая стоимость долевых инструментов иностранных эмитентов (Паи ETF) на конец отчетного месяца составила 9,84 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 0,72%.

Акции и депозитарные расписки иностранных эмитентов

Текущая стоимость акций и депозитарных расписок иностранных эмитентов на конец отчетного месяца составила 42,25 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 3,32%.

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.

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

млн. тенге

Валюта	Текущая стоимость на 01.01.2024 г.	Доля на 01.01.2024 г.	Текущая стоимость на 01.08.2024 г.	Доля на 01.08.2024 г.	Прирост/снижение с начала года
Национальная валюта	759,45	74,20%	991,39	72,72%	30,54%
Доллары США	242,24	23,67%	349,95	25,67%	44,47%
Канадские доллары	21,86	2,14%	21,99	1,61%	0,58%
Итого:	1 023,54	100%	1 363,33	100%	33,20%

Результаты инвестиционной деятельности

В результате инвестиционной деятельности и изменения рыночной стоимости финансовых инструментов, размер начисленного инвестиционного дохода с начала 2024 года составил 111,43 млн. тенге. Доходность пенсионных активов с начала 2024 года составила 9,05%.

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

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

млн. тенге

Наименование	Инвестиционный доход за 2024 год
Доходы в виде вознаграждения по ценным бумагам, в том числе по размещенным вкладам и операциям «обратное РЕПО»	82,10
Доходы (убытки) от рыночной переоценки ценных бумаг	18,46
Доходы (убытки) от переоценки иностранной валюты	11,44
Доходы (убытки) от переоценки прочих активов (ПФИ)	0,00
Доходы (убытки) по активам, находящимся во внешнем управлении	0,00
Прочие доходы (убытки)	-0,57
Итого:	111,43

Информация о стоимости условной единицы

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

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

№	Дата	Стоимость условной единицы
1	01.07.2024	1 244,1191894
2	02.07.2024	1 244,1191894
3	03.07.2024	1 244,1191894
4	04.07.2024	1 244,1191894
5	05.07.2024	1 244,1191894
6	06.07.2024	1 244,1191894
7	07.07.2024	1 244,1191894
8	08.07.2024	1 244,1191894
9	09.07.2024	1 251,3688099
10	10.07.2024	1 251,3688099
11	11.07.2024	1 251,3688099
12	12.07.2024	1 251,3688099
13	13.07.2024	1 251,3688099
14	14.07.2024	1 251,3688099
15	15.07.2024	1 246,1946044
16	16.07.2024	1 246,1946044
17	17.07.2024	1 246,1946044
18	18.07.2024	1 246,1946044
19	19.07.2024	1 246,1946044
20	20.07.2024	1 246,1946044
21	21.07.2024	1 246,1946044
22	22.07.2024	1 244,1621768
23	23.07.2024	1 244,1621768
24	24.07.2024	1 244,1621768
25	25.07.2024	1 244,1621768
26	26.07.2024	1 244,1621768
27	27.07.2024	1 244,1621768
28	28.07.2024	1 244,1621768
29	29.07.2024	1 246,0779209
30	30.07.2024	1 246,0779209
31	31.07.2024	1 246,6969166

Информация о соблюдении параметров инвестиционной декларации

Структурное распределение ПА ЕНПФ, находящихся в доверительном управлении Сен-трас 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 Сен-трас Секьюритиз, по состоянию на 1 августа 2024 года представлены в Таблице 5.

Таблица 5. Лимиты инвестирования по ПА ЕНПФ, находящихся в доверительном управлении Сен-трас Секьюритиз

№	Вид финансового инструмента	Фактическое значение	Выполнение (да/нет)
---	-----------------------------	----------------------	---------------------

		(в процентах от общего объема ПА)	
1	Денежные средства в национальной валюте – тенге (KZT)	1,17%	да
2	Иностранная валюта других стран, согласно Постановлению	2,95%	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	25,15	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	7,17%	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	7,93%	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).	3,32%	да
12	Негосударственные ЦБ, выпущенные организациями РК в соответствии с законодательством РК и других государств, согласно Постановлению	51,58%	да
13	Паи Exchange Traded Funds (Эксчейндж Трэйдэд Фандс), Exchange, Traded Commodities (Эксчейндж Трэйдэд Коммодитис), Exchange Traded Notes (Эксчейндж Трэйдэд Ноутс), согласно Постановлению	0,72%	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	Стоимость сделки в тенге
казначейские обязательства	USD	US Treasury	108 090 028,05
простые акции	KZT	АО «KEGOC»	22 263 917,52
купонные облигации	KZT	АО «Home Credit Bank»	30 332 760,00
Итого			160 686 705,57

Таблица 7. Сведения по продаже финансовых инструментов в отчетном месяце

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

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

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

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			-