

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

По состоянию на 1 сентября 2023 года пенсионные активы (далее – ПА) АО «ЕНПФ» (далее – ЕНПФ), находящиеся в доверительном управлении АО «Halyk Global Markets» (далее – Halyk Global Markets), составили **2 483,41** 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**

*млн. тенге*

Наименование	Текущая стоимость на 01.01.2023г.	Доля на 01.01.2023г.	Текущая стоимость на 01.09.2023г.	Доля на 01.09.2023г.	Прирост/ снижение с 01.01.2023 г.
Облигации банков второго уровня РК	49,39	1,88%	49,60	2,00%	0,42%
Облигации МФО	115,27	4,38%	286,81	11,55%	148,82%
Корпоративные облигации организаций РК	121,62	4,62%	121,59	4,90%	-0,03%
Облигации квазигосударственных организаций РК	330,81	12,57%	519,06	20,90%	56,90%
Долевые инструменты иностранных эмитентов (Паи ETF)	334,78	12,72%	411,58	16,57%	22,94%
Ноты НБРК	0,00	0,00%	214,16	8,62%	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%	182,77	7,36%	2,26%
Обратное РЕПО (не более 90 календарных дней)	1 307,42	49,69%	663,37	26,71%	-49,26%
Прочие активы (дебиторская задолженность, просроченная задолженность, провизии)	0,66	0,03%	0,00	0,00%	0,00%
Денежные средства на счетах	62,51	2,38%	34,46	1,39%	-44,87%
<b>Итого ПА, находящиеся в управлении Halyk Global Markets</b>	<b>2 631,21</b>	<b>100,00%</b>	<b>2 483,41</b>	<b>100,00%</b>	<b>-5,62%</b>
Обязательства к оплате по совершенным сделкам	-	-	-	-	-
<b>Итого пенсионные активы</b>	<b>2 631,21</b>	<b>100,00%</b>	<b>2 483,41</b>	<b>100,00%</b>	<b>-5,62%</b>

По состоянию на 01.09.2023 г. средневзвешенная доходность долговых финансовых инструментов, номинированных в тенге, составила 13,84% годовых. Средневзвешенная доходность долговых финансовых инструментов, номинированных в долларах США, составила 6,32%.

### **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 663,37 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 26,71%. Средневзвешенная доходность операций обратного РЕПО на отчетную дату составила 17,00% годовых.

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

Текущая стоимость облигаций банков второго уровня Республики Казахстан (далее – РК) за отчетный месяц увеличилась на 1,16 млн. тенге и составила 49,60 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 2,00%.

Средневзвешенная доходность к погашению облигаций банков второго уровня РК на отчетную дату составила 11,10% годовых.

### **Облигации международных финансовых организаций**

Текущая стоимость облигаций международных финансовых организаций за отчетный месяц выросла на 10,36 млн тенге и составила 286,81 млн. тенге. Доля в портфеле облигаций международных финансовых организаций составила 11,55%.

Средневзвешенная доходность к погашению по облигациям международных финансовых организаций, номинированным в тенге, с фиксированной ставкой вознаграждения составила 8,49% годовых.

### **Корпоративные облигации эмитентов РК**

Текущая стоимость корпоративных облигаций эмитентов РК за отчетный месяц увеличилась на 2,71 млн. тенге и составила 121,59 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 4,90%.

Средневзвешенная доходность к погашению корпоративных облигаций эмитентов РК, номинированных в тенге, на отчетную дату составила 10,91% 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 увеличилась на 0,72 млн. тенге и составила 411,58 млн. тенге. Доля долевых инструментов иностранных эмитентов (ПАИ ETF) в портфеле составила 16,57%.

### **Ноты Национального Банка Республики Казахстан**

Текущая стоимость нот Национального Банка Республики Казахстана составила 214,16 млн тенге. Их доля в портфеле составила 8,62%.

В рассматриваемом периоде были приобретены 28-дневные ноты НБРК в объеме 215 млн тенге по номинальной стоимости с доходностью 16,61%.

### **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 6,14 млн. тенге и составила 182,77 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 6,32% годовых.

### **Облигации квазигосударственных организаций РК**

Текущая стоимость облигаций квазигосударственных организаций РК за отчетный месяц увеличилась на 0,98 млн. тенге и составила 519,06 млн. тенге. Доля облигаций квазигосударственных организаций РК в портфеле составила 20,90%.

Средневзвешенная доходность к погашению облигаций квазигосударственных организаций РК, номинированных в тенге, на отчетную дату составила 17,75% 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 01.01.2023г.	Доля на 01.01.2023г.	Текущая стоимость на 01.09.2023г.	Доля на 01.09.2023г.	Прирост/снижение с 01.01.2023г.
Национальная валюта	2 095,80	79,65%	1 874,74	75,49%	-10,55%
Доллары США	535,40	20,35%	608,65	24,51%	13,68%
Евро	0	0,00%	0,01	0,001%	0,00%
<b>Итого:</b>	<b>2 631,21</b>	<b>100,00%</b>	<b>2 483,41</b>	<b>100,00%</b>	<b>-5,62%</b>

### Результаты инвестиционной деятельности

В результате инвестиционной деятельности, размер начисленного инвестиционного дохода (по состоянию на 01 сентября 2023 года с 15 марта 2021 г.) составил 524,86 млн. тенге и размер начисленного инвестиционного дохода (по состоянию на 01 сентября 2023 года с 01 января 2023 года) составил 301,46 млн. тенге. Доходность пенсионных активов составила 26,11% с начала деятельности и 11,65% 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»	200,94
Доходы (убытки) от рыночной переоценки ценных бумаг	99,77
Доходы (убытки) от переоценки иностранной валюты	1,87
Прочие доходы (убытки)	- 1,12
<b>Итого:</b>	<b>301,46</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	01.08.2023	1 116,8541046
2	02.08.2023	1 116,8541046
3	03.08.2023	1 116,8541046
4	04.08.2023	1 116,8541046
5	05.08.2023	1 116,8541046

№	Дата	Стоимость одной условной единицы
6	06.08.2023	1 116,8541046
7	07.08.2023	1 115,8016228
8	08.08.2023	1 115,8016228
9	09.08.2023	1 115,8016228
10	10.08.2023	1 115,8016228
11	11.08.2023	1 115,8016228
12	12.08.2023	1 115,8016228
13	13.08.2023	1 115,8016228
14	14.08.2023	1 118,7396251
15	15.08.2023	1 118,7396251
16	16.08.2023	1 118,7396251
17	17.08.2023	1 118,7396251
18	18.08.2023	1 118,7396251
19	19.08.2023	1 118,7396251
20	20.08.2023	1 118,7396251
21	21.08.2023	1 124,5602151
22	22.08.2023	1 124,5602151
23	23.08.2023	1 124,5602151
24	24.08.2023	1 124,5602151
25	25.08.2023	1 124,5602151
26	26.08.2023	1 124,5602151
27	27.08.2023	1 124,5602151
28	28.08.2023	1 134,5014545
29	29.08.2023	1 134,5014545
30	30.08.2023	1 134,5014545
31	31.08.2023	1 134,3484941

### 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 сентября 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	1,39%	да
2	Обратное РЕПО	26,71%	да
3	Государственные ценные бумаги Республики Казахстан, выпущенные Министерством финансов РК и НБ РК, долговые ценные бумаги, выпущенные местными исполнительными органами РК	8,62%	да
4	Долговые ценные бумаги, выпущенные юридическим лицом, сто процентов акций которого принадлежат НБ РК	8,30%	да
5	Долговые ценные бумаги, выпущенные акционерными обществами «Банк Развития Казахстана», «Фонд национального благосостояния «Самрук-Казына», «Национальный управляющий холдинг «Байтерек»,	7,52%	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

№	Вид финансового инструмента	Фактическое значение (в процентах от общего объема ПА)	Выполнение (да/нет)
	«Фонд проблемных кредитов» в соответствии с законодательством Республики Казахстан и других государств		
6	Вклады в банках второго уровня Республики Казахстан		да
7	Вклады в банках-нерезидентах		да
8	Долговые ценные бумаги, выпущенные международными финансовыми организациями	11,55%	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	16,57%	да
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	11,97%	да
17	Производные финансовые инструменты		да
18	Виды финансовых инструментов, указанные в строках 10, 11,12,13 и 15	16,57%	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 (NTK028_2834)	KZT	ГУ "Национальный Банк Республики Казахстан"	212 486 005,00
<b>Итого</b>			<b>212 486 005,00</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	Стоимость сделки, в тенге
В отчетном месяце погашений по ценным бумагам не было			
<b>Итого</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 погашения в тенге
В отчетном месяце не осуществлялись погашения основного долга по вкладам			
<b>Итого</b>			