

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

По состоянию на 1 октября 2022 года пенсионные активы (далее – ПА) ЕНПФ, находящиеся в доверительном управлении АО «Сентрас Секьюритиз» (далее – Сентрас Секьюритиз), составили 970,10 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**

Наименование	Текущая стоимость на 01.01.2022 г.	Доля на 01.01.2022 г.	Текущая стоимость на 01.10.2022 г.	Доля на 01.10.2022 г.	Прирост/снижение с начала года.
ГЦБ МФ РК	560,90	69,29%	528,06	54,43%	-5,86%
Облигации квазигосударственных организаций РК	0,00	0,00%	86,10	8,88%	0,00%
Акции и депозитарные расписки эмитентов РК	119,26	14,73%	80,38	8,29%	-32,61%
Долевые инструменты иностранных эмитентов (Паи ETF)	0,00	0,00%	16,52	1,70%	0,00%
Репо	127,09	15,70%	136,21	14,04%	7,18%
Прочие активы (дебиторская задолженность, просроченная задолженность, провизии)	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00%
Денежные средства на инвестиционных счетах	2,20	0,27%	122,83	12,66%	5486,51%
<b>Итого ПА, находящиеся в управлении УИП</b>	<b>809,46</b>	<b>100,00%</b>	<b>970,10</b>	<b>100,00%</b>	<b>19,85%</b>
Обязательства к оплате по совершенным сделкам	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00%
<b>Итого пенсионные активы</b>	<b>809,46</b>		<b>970,10</b>		<b>19,85%</b>

По состоянию на 01.10.2022г. средневзвешенная доходность к погашению (YTM) долговых финансовых инструментов и РЕПО, номинированных в тенге, составила 11,43% годовых.

**Денежные средства и операции обратное РЕПО**

Текущая стоимость операций обратного РЕПО за отчетный месяц составила 136,21 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 14,04%. На конец отчетного периода остатки денежных средств на инвестиционных счетах составили 122,83 млн. тенге. Суммарная доля денежных средств и требований по операциям обратного РЕПО на конец отчетного месяца составила 26,70%.

**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 528,06 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 54,43%.

На отчетную дату средневзвешенная доходность к погашению по ГЦБ Министерства финансов РК, номинированным в тенге, составила 11,27% годовых.

**Облигации квазигосударственных организаций Республики Казахстан**

В отчетном периоде были приобретены еврооблигации эмитента АО "Национальная компания "КазМунайГаз".

На отчетную дату средневзвешенная доходность к погашению по облигациям квазигосударственных организаций Республики Казахстан, номинированным в тенге, составила

7,89% годовых. Текущая стоимость облигаций квазигосударственных организаций Республики Казахстан, номинированным в тенге, на конец отчетного месяца составила 86,10 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 8,88%.

#### **Акции и депозитарные расписки эмитентов Республики Казахстан**

Текущая стоимость акций и депозитарных расписок эмитентов Республики Казахстан на конец отчетного месяца составила 80,38 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 8,29%.

В отчетном месяце были реализованы простые акции АО «Кселл».

#### **Долевые инструменты иностранных эмитентов (Паи ETF)**

Текущая стоимость долевых инструментов иностранных эмитентов (Паи ETF) на конец отчетного месяца составила 16,52 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 1,70%. В отчетном периоде в состав портфеля ПА ЕНПФ в доверительном управлении Центрас Секьюритиз ETF не приобретались.

#### **Валютная структура**

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

<i>млн. тенге</i>					
Валюта	Текущая стоимость на 01.01.2022 г.	Доля на 01.01.2022 г.	Текущая стоимость на 01.10.2022 г.	Доля на 01.10.2022 г.	Прирост/снижение с начала года
Национальная валюта	809,46	100%	778,46	80,25%	-3,83%
Доллары США	0,00	0,00	191,64	19,75%	0,00%
Российские рубли	0,00	0,00	0,00	0,00%	-
Другие валюты	0,00	0,00	0,00	0,00%	-
<b>Итого:</b>	<b>809,46</b>	<b>100%</b>	<b>970,10</b>	<b>100%</b>	<b>19,85%</b>

#### **Результаты инвестиционной деятельности**

В результате инвестиционной деятельности и изменения рыночной стоимости финансовых инструментов, размер начисленного инвестиционного дохода с начала 2022 года составил 25,00 млн. тенге. Доходность пенсионных активов с начала 2022 года составила 2,06%.

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**

<i>млн. тенге</i>	
Наименование	Инвестиционный доход за 2022 год
Доходы в виде вознаграждения по ценным бумагам, в том числе по размещенным вкладам и операциям «обратное РЕПО»	62,57
Доходы (убытки) от рыночной переоценки ценных бумаг, от переоценки иностранной валюты и прочие доходы (убытки)	-37,57
<b>Итого:</b>	<b>25,00</b>

#### **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 Сентрас Секьюритиз**

№	Дата	Стоимость условной единицы
1	01.09.2022	1 012,7140884
2	02.09.2022	1 012,7140884
3	03.09.2022	1 012,7140884
4	04.09.2022	1 012,7140884
5	05.09.2022	1 012,7260439
6	06.09.2022	1 012,7260439
7	07.09.2022	1 012,7260439
8	08.09.2022	1 012,7260439
9	09.09.2022	1 012,7260439
10	10.09.2022	1 012,7260439
11	11.09.2022	1 012,7260439
12	12.09.2022	1 015,0127390
13	13.09.2022	1 015,0127390
14	14.09.2022	1 015,0127390
15	15.09.2022	1 015,0127390
16	16.09.2022	1 015,0127390
17	17.09.2022	1 015,0127390
18	18.09.2022	1 015,0127390
19	19.09.2022	1 013,3405120
20	20.09.2022	1 013,3405120
21	21.09.2022	1 013,3405120
22	22.09.2022	1 013,3405120
23	23.09.2022	1 013,3405120
24	24.09.2022	1 013,3405120
25	25.09.2022	1 013,3405120
26	26.09.2022	1 012,0169935
27	27.09.2022	1 012,0169935
28	28.09.2022	1 012,0169935
29	29.09.2022	1 012,0169935
30	30.09.2022	1 012,5886898

**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 октября 2022 года представлены в Таблице 5.

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

№	Вид финансового инструмента	Фактическое значение (в процентах от общего объема ПА)	Выполнение (да/нет)
1	Денежные средства в национальной валюте – тенге (KZT)	3,49%	да
2	Иностранная валюта других стран, согласно Постановлению	9,18%	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	54,43%	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	<p>Долговые ценные бумаги, выпущенные следующими международными финансовыми организациями, имеющие рейтинговую оценку не ниже «BB+» по международной шкале агентства Standard &amp; 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	0,00%	да
11	<p>Негосударственные ЦБ, выпущенные иностранными организациями:</p> <p>*акции иностранных эмитентов, имеющих рейтинговую оценку не ниже «BB» по международной шкале агентства Standard &amp; Poor's (Стандарт энд Пурс) или рейтинговую оценку аналогичного уровня агентств Moody's Investors Service (Мудис Инвесторс Сервис) или Fitch (Фич);</p> <p>*акции иностранных эмитентов, входящие в состав основных фондовых индексов, и депозитарные расписки, базовым активом которых являются данные акции;</p> <p>*долговые ЦБ, имеющие рейтинговую оценку не ниже</p>	0,00%	да

	«ВВ» 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).		
12	Негосударственные ЦБ, выпущенные организациями РК в соответствии с законодательством РК и других государств, согласно Постановлению	17,17%	да
13	Паи Exchange Traded Funds (Эксчейндж Трэйдэд Фандс), Exchange, Traded Commodities (Эксчейндж Трэйдэд Коммодитис), Exchange Traded Notes (Эксчейндж Трэйдэд Ноутс), согласно Постановлению	1,70%	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	Сумма сделки в тенге
Еврооблигации	USD	АО "Национальная компания "КазМунайГаз"	88 870 631,48
<b>Итого</b>			<b>88 870 631,48</b>

Таблица 7. Сведения по продаже финансовых инструментов в отчетном месяце

Вид инструмента	Валюта	Эмитент ценной бумаги	Сумма сделки в тенге
Акции	KZT	АО "Кселл"	1 306 164,26
<b>Итого</b>			<b>1 306 164,26</b>