

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

По состоянию на 1 сентября 2022 года пенсионные активы (далее – ПА) ЕНПФ, находящиеся в доверительном управлении АО «Сентрас Секьюритиз» (далее – Сентрас Секьюритиз), составили 971,96 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 01.01.2022 г. | Доля на 01.01.2022 г. | Текущая стоимость на 01.09.2022 г. | Доля на 01.09.2022 г. | Прирост/снижение с начала года. |
|---|------------------------------------|-----------------------|------------------------------------|-----------------------|---------------------------------|
| ГЦБ МФ РК | 560,90 | 69,29% | 523,79 | 53,89% | -6,62% |
| Акции и депозитарные расписки эмитентов РК | 119,26 | 14,73% | 84,83 | 8,73% | -28,87% |
| Долевые инструменты иностранных эмитентов (Паи ETF) | 0,00 | 0,00% | 17,68 | 1,82% | 0,00% |
| Репо | 127,09 | 15,70% | 157,19 | 16,17% | 23,69% |
| 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% | 188,47 | 19,39% | 8471,76% |
| Итого ПА, находящиеся в управлении УИП | 809,46 | 100,00% | 971,96 | 100,00% | 20,08% |
| Обязательства к оплате по совершенным сделкам | 0,00 | 0,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% |
| Итого пенсионные активы | 809,46 | | 971,96 | | 20,08% |

По состоянию на 01.09.2022г. средневзвешенная доходность к погашению (YTM) долговых финансовых инструментов и РЕПО, номинированных в тенге, составила 11,94% годовых.

Денежные средства и операции обратное РЕПО

Текущая стоимость операций обратного Репо за отчетный месяц составила 157,19 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 16,17%. На конец отчетного периода остатки денежных средств на инвестиционных счетах составили 188,47 млн. тенге. Суммарная доля денежных средств и требований по операциям обратного Репо на конец отчетного месяца составила 35,56%.

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 523,79 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 53,89%.

На отчетную дату средневзвешенная доходность к погашению по ГЦБ Министерства финансов РК, номинированным в тенге, составила 11,22% годовых.

Акции и депозитарные расписки эмитентов Республики Казахстан

Текущая стоимость акций и депозитарных расписок эмитентов Республики Казахстан на конец отчетного месяца составила 84,83 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 8,73%.

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 17,68 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 1,82%. 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 01.09.2022 г. | Доля на 01.09.2022 г. | Прирост/снижение с начала года |
| Национальная валюта | 809,46 | 100% | 796,50 | 81,95% | -1,60% |
| Доллары США | 0,00 | 0,00 | 175,46 | 18,05% | - |
| Российские рубли | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00% | - |
| Другие валюты | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00% | - |
| Итого: | 809,46 | 100% | 971,96 | 100% | 20,08% |

Результаты инвестиционной деятельности

В результате инвестиционной деятельности и изменения рыночной стоимости финансовых инструментов, размер начисленного инвестиционного дохода с начала 2022 года составил 25,05 млн. тенге. Доходность пенсионных активов с начала 2022 года составила 2,07%.

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» | 55,75 |
| Доходы (убытки) от рыночной переоценки ценных бумаг, от переоценки иностранной валюты и прочие доходы (убытки) | -30,70 |
| Итого: | 25,05 |

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 Центрас Секьюритиз

| № | Дата | Стоимость условной единицы |
|---|------------|----------------------------|
| 1 | 01.08.2022 | 1 004,1316511 |
| 2 | 02.08.2022 | 1 004,1316511 |
| 3 | 03.08.2022 | 1 004,1316511 |
| 4 | 04.08.2022 | 1 004,1316511 |
| 5 | 05.08.2022 | 1 004,1316511 |

| | | |
|----|------------|---------------|
| 6 | 06.08.2022 | 1 004,1316511 |
| 7 | 07.08.2022 | 1 004,1316511 |
| 8 | 08.08.2022 | 1 005,1796428 |
| 9 | 09.08.2022 | 1 005,1796428 |
| 10 | 10.08.2022 | 1 005,1796428 |
| 11 | 11.08.2022 | 1 005,1796428 |
| 12 | 12.08.2022 | 1 005,1796428 |
| 13 | 13.08.2022 | 1 005,1796428 |
| 14 | 14.08.2022 | 1 005,1796428 |
| 15 | 15.08.2022 | 1 007,3469269 |
| 16 | 16.08.2022 | 1 007,3469269 |
| 17 | 17.08.2022 | 1 007,3469269 |
| 18 | 18.08.2022 | 1 007,3469269 |
| 19 | 19.08.2022 | 1 007,3469269 |
| 20 | 20.08.2022 | 1 007,3469269 |
| 21 | 21.08.2022 | 1 007,3469269 |
| 22 | 22.08.2022 | 1 011,1522485 |
| 23 | 23.08.2022 | 1 011,1522485 |
| 24 | 24.08.2022 | 1 011,1522485 |
| 25 | 25.08.2022 | 1 011,1522485 |
| 26 | 26.08.2022 | 1 011,1522485 |
| 27 | 27.08.2022 | 1 011,1522485 |
| 28 | 28.08.2022 | 1 011,1522485 |
| 29 | 29.08.2022 | 1 011,1522485 |
| 30 | 30.08.2022 | 1 011,1522485 |
| 31 | 31.08.2022 | 1 012,7140884 |

Информация о соблюдении параметров инвестиционной декларации

Структурное распределение ПА ЕНПФ, находящихся в доверительном управлении Центрас 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 Центрас Секьюритиз, по состоянию на 1 сентября 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) | 3,16% | да |
| 2 | Иностранная валюта других стран, согласно Постановлению | 16,23% | 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 | 53,89% | 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 | 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): Азиатский банк развития (the Asian Development Bank); Межамериканский банк развития (the Inter-American Development Bank); Африканский банк развития (the African Development Bank); Евразийский банк развития (Eurasian Development Bank); Европейский банк реконструкции и развития (the European Bank for Reconstruction and Development); Европейский инвестиционный банк (the European Investment Bank); Банк Развития Европейского Совета (the Council of Europe Development Bank); Исламская корпорация по развитию частного сектора (the Islamic Corporation for the Development of the Private Sector); Исламский банк развития (the Islamic Development Bank); Многостороннее агентство гарантии инвестиций (the Multilateral Investment Guarantee Agency); Скандинавский инвестиционный банк (the Nordic Investment Bank); Международный валютный фонд (the International Monetary Fund); Международная ассоциация развития (the International Development Association); Международный центр по урегулированию инвестиционных споров (the International Centre for Settlement of Investment Disputes); Международный банк реконструкции и развития (the International Bank for Reconstruction and Development); Международная финансовая корпорация (the International Finance Corporation). | 0,00% | да |
| 10 | ЦБ, имеющие статус государственных, выпущенные правительствами иностранных государств, согласно Постановлению | 0,00% | 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). | 0,00% | да |
| 12 | Негосударственные ЦБ, выпущенные организациями РК в соответствии с законодательством РК и других государств, согласно Постановлению | 8,73% | да |
| 13 | Паи Exchange Traded Funds (Эксчейндж Трэйдэд Фандс), Exchange, Traded Commodities (Эксчейндж Трэйдэд Коммодитис), Exchange Traded Notes (Эксчейндж Трэйдэд Ноутс), согласно Постановлению | 1,82% | 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 |
|-----------------|--------|-----------------------|----------------------|
| - | - | - | - |
| Итого | | | |

Таблица 7. Сведения по продаже финансовых инструментов в отчетном месяце

| Вид инструмента | Валюта | Эмитент ценной бумаги | Сумма сделки в тенге |
|-----------------|--------|-----------------------|----------------------|
| Акции | KZT | АО "Кселл" | 7 248 876 |
| Итого | | | 7 248 876 |