

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

По состоянию на 1 июня 2024 года пенсионные активы (далее – ПА) ЕНПФ, находящиеся в доверительном управлении АО «Сентрас Секьюритиз» (далее – Сентрас Секьюритиз), составили 1 265,79 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 01.06.2024 г.	Доля на 01.06.2024 г.	Прирост/снижение с начала года.
ГЦБ МФ РК	346,86	33,89%	337,91	26,70%	-2,58%
Облигации квазигосударственных организаций РК	197,07	19,25%	182,06	14,38%	-7,62%
Облигации БВУ РК	168,85	16,50%	85,32	6,74%	-49,47%
Корпоративные облигации эмитентов РК	-	-	100,44	7,94%	-
Акции и депозитарные расписки эмитентов РК	83,98	8,21%	130,82	10,33%	55,77%
Долевые инструменты иностранных эмитентов (Паи ETF)	9,48	0,93%	9,04	0,71%	-4,60%
Акции и депозитарные расписки иностранных эмитентов	21,86	2,14%	21,16	1,67%	-3,20%
Государственные облигации США	81,04	7,92%	-	-	-100,00%
Репо	88,07	8,60%	251,34	19,86%	185,38%
Прочие активы (дебиторская задолженность, просроченная задолженность, провизии)	-	-	87,70	6,93%	-
Денежные средства на инвестиционных счетах	26,33	2,57%	60,00	4,74%	127,85%
<b>Итого ПА, находящиеся в управлении УИП</b>	<b>1 023,54</b>	<b>100,00%</b>	<b>1 265,79</b>	<b>100,00%</b>	<b>23,67%</b>
Обязательства к оплате по совершенным сделкам	-	-	-	-	-
<b>Итого пенсионные активы</b>	<b>1 023,54</b>	<b>-</b>	<b>1 265,79</b>	<b>-</b>	<b>23,67%</b>

По состоянию на 01.06.2024 г. средневзвешенная доходность к погашению (YTM) долговых финансовых инструментов составила 13,05% годовых.

**Денежные средства на инвестиционных счетах и операции обратное РЕПО**

На конец отчетного периода остатки денежных средств на инвестиционных счетах составили 60,00 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 4,74%. На конец отчетного периода

остатки денежных средств по операциям РЕПО составили 251,34 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 19,86%. Средневзвешенная доходность операций обратного РЕПО на отчетную дату составила 15,23% 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 337,91 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 26,70%. На отчетную дату средневзвешенная доходность к погашению по ГЦБ Министерства финансов РК, номинированным в тенге, составила 12,76% годовых.

В отчетном периоде были совершены сделки по продаже и покупке купонных МЕУКАМ Министерства финансов Республики Казахстан.

#### **Облигации квазигосударственных организаций Республики Казахстан**

На отчетную дату средневзвешенная доходность к погашению по облигациям квазигосударственных организаций Республики Казахстан составила 6,04% годовых в долларах США и 14,41% годовых в тенге. Текущая стоимость облигаций квазигосударственных организаций Республики Казахстан на конец отчетного месяца составила 182,06 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 14,39%.

#### **Облигации БВУ РК**

На отчетную дату средневзвешенная доходность к погашению по облигациям составила 14,40% годовых. Текущая стоимость облигаций на конец отчетного месяца составила 85,32 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 6,74%.

#### **Корпоративные облигации эмитентов РК**

В отчетном периоде была совершена сделка по покупке купонных облигации АО «Микрофинансовая организация «КМФ (КМФ)»» на сумму 100 000 000,00 тенге.

На отчетную дату средневзвешенная доходность к погашению по облигациям составила 17,67% годовых. Текущая стоимость облигаций на конец отчетного месяца составила 100,44 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 7,94%.

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

Текущая стоимость акций и депозитарных расписок эмитентов Республики Казахстан на конец отчетного месяца составила 130,82 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 10,34%.

В отчетном периоде была совершена сделка по продаже депозитарных расписок АО «НАК «Казатомпром» на сумму 1 058 611,53 тенге.

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

Текущая стоимость долевых инструментов иностранных эмитентов (Паи ETF) на конец отчетного месяца составила 9,04 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 0,71%.

#### **Акции и депозитарные расписки иностранных эмитентов**

Текущая стоимость акций и депозитарных расписок иностранных эмитентов на конец отчетного месяца составила 21,16 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 1,67%.

### Государственные облигации США

В отчетном периоде было погашение государственных облигаций США на сумму 80 505 000,00 тенге.

### 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 01.06.2024 г.	Доля на 01.06.2024 г.	Прирост/снижение с начала года
Национальная валюта	759,45	74,20%	928,09	73,32%	22,21%
Доллары США	242,24	23,67%	316,55	25,01%	30,68%
Канадские доллары	21,86	2,14%	21,16	1,67%	-3,20%
<b>Итого:</b>	<b>1 023,54</b>	<b>100%</b>	<b>1 265,79</b>	<b>100%</b>	<b>23,67%</b>

### Результаты инвестиционной деятельности

В результате инвестиционной деятельности и изменения рыночной стоимости финансовых инструментов, размер начисленного инвестиционного дохода с начала 2024 года составил 73,34 млн. тенге. Доходность пенсионных активов с начала 2024 года составила 6,14%.

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»	56,49
Доходы (убытки) от рыночной переоценки ценных бумаг	20,17
Доходы (убытки) от переоценки иностранной валюты	-2,87
Доходы (убытки) от переоценки прочих активов (ПФИ)	0,00
Доходы (убытки) по активам, находящимся во внешнем управлении	0,00
Прочие доходы (убытки)	-0,45
<b>Итого:</b>	<b>73,34</b>

### 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**

<b>№</b>	<b>Дата</b>	<b>Стоимость условной единицы</b>
1	01.05.2024	1 191,7494244
2	02.05.2024	1 191,7494244
3	03.05.2024	1 191,7494244
4	04.05.2024	1 191,7494244
5	05.05.2024	1 191,7494244
6	06.05.2024	1 196,6053694
7	07.05.2024	1 196,6053694
8	08.05.2024	1 196,6053694
9	09.05.2024	1 196,6053694
10	10.05.2024	1 196,6053694
11	11.05.2024	1 196,6053694
12	12.05.2024	1 196,6053694
13	13.05.2024	1 200,2277092
14	14.05.2024	1 200,2277092
15	15.05.2024	1 200,2277092
16	16.05.2024	1 200,2277092
17	17.05.2024	1 200,2277092
18	18.05.2024	1 200,2277092
19	19.05.2024	1 200,2277092
20	20.05.2024	1 207,7590822
21	21.05.2024	1 207,7590822
22	22.05.2024	1 207,7590822
23	23.05.2024	1 207,7590822
24	24.05.2024	1 207,7590822
25	25.05.2024	1 207,7590822
26	26.05.2024	1 207,7590822
27	27.05.2024	1 210,3807825
28	28.05.2024	1 210,3807825
29	29.05.2024	1 210,3807825
30	30.05.2024	1 210,3807825
31	31.05.2024	1 213,3677870

#### **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 июня 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 (в процентах от общего объема ПА)	Выполнение (да/нет)
1	Денежные средства в национальной валюте – тенге (KZT)	0,13%	да
2	Иностранная валюта других стран, согласно Постановлению	11,54%	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	33,49%	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	7,51%	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>	0,00%	да

	а также ценные бумаги, выпущенные международной финансовой организацией, доля Республики Казахстан в уставном капитале которой составляет не менее 25%		
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 «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); *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 «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).	1,67%	да
12	Негосударственные ЦБ, выпущенные организациями РК в соответствии с законодательством РК и других государств, согласно Постановлению	44,94%	да
13	Паи Exchange Traded Funds (Эксчейндж Трэйдэд Фандс), Exchange, Traded Commodities (Эксчейндж Трэйдэд Коммодитис), Exchange Traded Notes (Эксчейндж Трэйдэд Ноутс), согласно Постановлению	0,71%	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
купонные облигации	KZT	ТОО «Микрофинансовая организация «КМФ (КМФ)»»	100 000 000,00
купонные МЕУКАМ	KZT	Министерство финансов Республики Казахстан	195 458 700,00
<b>Итого</b>			<b>295 458 700,00</b>

**Таблица 7. Сведения по продаже финансовых инструментов в отчетном месяце**

Вид инструмента	Валюта	Эмитент ценной бумаги	Сумма сделки в тенге
GDR	USD	АО «НАК «Казатомпром»	1 058 611,53
купонные МЕУКАМ	KZT	Министерство финансов Республики Казахстан	193 555 350,00
<b>Итого</b>			<b>194 613 961,53</b>

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

Вид инструмента	Валюта	Эмитент ценной бумаги	Стоимость сделки в тенге
казначейские обязательства	USD	US Treasury	80 505 000,00
<b>Итого</b>			<b>80 505 000,00</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>			<b>-</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>			<b>-</b>