

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

По состоянию на 1 мая 2023 года пенсионные активы (далее – ПА) АО «ЕНПФ» (далее – ЕНПФ), находящиеся в доверительном управлении АО «Halyk Global Markets» (далее – Halyk Global Markets), составили **2 555,45** 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**

Наименование	<i>млн. тенге</i>				
	Текущая стоимость на 01.01.2023г.	Доля на 01.01.2023г.	Текущая стоимость на 01.05.2023г.	Доля на 01.05.2023г.	Прирост/снижение с 01.01.2023г.
Облигации банков второго уровня РК	49,39	1,88%	47,13	1,84%	-4,57%
Облигации МФО	115,27	4,38%	253,54	9,92%	119,96%
Корпоративные облигации организаций РК	121,62	4,62%	115,19	4,51%	-5,29%
Облигации квазигосударственных организаций РК	330,81	12,57%	502,08	19,65%	51,77%
Долевые инструменты иностранных эмитентов (Паи ETF)	334,78	12,72%	379,15	14,84%	13,25%
Ноты НБРК	0,00	0,00%	235,83	9,23%	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%	177,38	6,94%	-0,76%
Обратное РЕПО (не более 90 календарных дней)	1 307,42	49,69%	834,29	32,65%	-36,19%
Прочие активы (дебиторская задолженность, просроченная задолженность, провизии)	0,66	0,03%	0,59	0,02%	-11,90%
Денежные средства на счетах	62,51	2,38%	10,28	0,40%	-83,55%
<b>Итого ПА, находящиеся в управлении Halyk Global Markets</b>	<b>2 631,21</b>	<b>100,00%</b>	<b>2 555,45</b>	<b>100,00%</b>	<b>-2,88%</b>
Обязательства к оплате по совершенным сделкам	-	-	-	-	-
<b>Итого пенсионные активы</b>	<b>2 631,21</b>	<b>100,00%</b>	<b>2 555,45</b>	<b>100,00%</b>	<b>-2,88%</b>

По состоянию на 01.05.2023 г. средневзвешенная доходность долговых финансовых инструментов, номинированных в тенге, составила 16,34% годовых. Средневзвешенная доходность долговых финансовых инструментов, номинированных в долларах США, составила 5,18%.

### **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 834,29 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 32,65%. Средневзвешенная доходность операций обратного РЕПО на отчетную дату составила 16,60% годовых.

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

Текущая стоимость нот Национального Банка Республики Казахстана составила 235,83 млн тенге. Их доля в портфеле составила 9,23%.

В рассматриваемом периоде были погашены 27-дневные ноты НБРК в объеме 242,5 млн тенге и с доходностью 16,60% годовых и приобретены 28-дневные ноты НБРК в объеме 234 млн тенге с доходностью 16,61% годовых.

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

Текущая стоимость облигаций банков второго уровня Республики Казахстан (далее – РК) за отчетный месяц выросла на 0,43 млн. тенге и составила 47,13 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 1,84%.

Средневзвешенная доходность к погашению облигаций банков второго уровня РК на отчетную дату составила 13,68% годовых.

#### **Облигации международных финансовых организаций**

Текущая стоимость облигаций международных финансовых организаций за отчетный месяц выросла на 2,77 млн тенге и составила 253,54 млн. тенге. Доля в портфеле облигаций международных финансовых организаций составила 9,92%.

Средневзвешенная доходность к погашению по облигациям международных финансовых организаций, номинированным в тенге, с фиксированной ставкой вознаграждения составила 15,61% годовых.

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

В инвестиционном портфеле ПА ЕНПФ, находящихся в доверительном управлении Nalyk Global Markets, присутствуют долевые инструменты иностранных эмитентов (ПАИ ETF), текущая стоимость которых за отчетный месяц выросла на 13,13 млн. тенге и составила 379,15 млн. тенге. Доля долевых инструментов иностранных эмитентов (ПАИ ETF) в портфеле составила 14,84%.

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

Текущая стоимость корпоративных облигаций эмитентов РК за отчетный месяц выросла на 1,10 млн. тенге и составила 115,19 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 4,51%.

Средневзвешенная доходность к погашению корпоративных облигаций эмитентов РК, номинированных в тенге, на отчетную дату составила 13,73% годовых.

#### **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 0,67 млн. тенге и составила 177,38 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 6,94%.

Средневзвешенная доходность к погашению ценных бумаг, имеющих статус государственных, выпущенных центральными правительствами иностранных государств, на отчетную дату составила 5,18% годовых.

#### **Облигации квазигосударственных организаций РК**

Текущая стоимость облигаций квазигосударственных организаций РК за отчетный месяц выросла на 182,59 млн. тенге и составила 502,08 млн. тенге. Доля облигаций квазигосударственных организаций РК в портфеле составила 19,65%.

Средневзвешенная доходность к погашению облигаций квазигосударственных организаций РК, номинированных в тенге, на отчетную дату составила 17,56% 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 осуществлялись сделки купли-продажи иностранной валюты на Казахстанской фондовой бирже. Были приобретены доллары США в объеме 410 321 USD.

**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 01.05.2023г.	Доля на 01.05.2023г.	Прирост/снижение с 01.01.2023г.
Национальная валюта	2 095,80	79,65%	1 998,08	78,19%	-4,66%
Доллары США	535,40	20,35%	557,37	21,81%	4,10%
<b>Итого:</b>	<b>2 631,21</b>	<b>100,00%</b>	<b>2 555,45</b>	<b>100,00%</b>	<b>-2,88%</b>

### Результаты инвестиционной деятельности

В результате инвестиционной деятельности, размер начисленного инвестиционного дохода (по состоянию на 01 апреля 2023 года с 15 марта 2021 г.) составил 338,66 млн. тенге и размер начисленного инвестиционного дохода (по состоянию на 01 мая 2023 года с 01 января 2023 года) составил 115,26 млн. тенге. Доходность пенсионных активов составила 17,58% с начала деятельности и 4,09% 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»	105,23
Доходы (убытки) от рыночной переоценки ценных бумаг	11,79
Доходы (убытки) от переоценки иностранной валюты	-0,89
Прочие доходы (убытки)	-0,87
<b>Итого:</b>	<b>115,26</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	01.04.2023	1 045,7366613
2	02.04.2023	1 045,7366613
3	03.04.2023	1 048,7055806
4	04.04.2023	1 048,7055806
5	05.04.2023	1 048,7055806
6	06.04.2023	1 048,7055806
7	07.04.2023	1 048,7055806
8	08.04.2023	1 048,7055806

9	09.04.2023	1 048,7055806
10	10.04.2023	1 044,7653848
11	11.04.2023	1 044,7653848
12	12.04.2023	1 044,7653848
13	13.04.2023	1 044,7653848
14	14.04.2023	1 044,7653848
15	15.04.2023	1 044,7653848
16	16.04.2023	1 044,7653848
17	17.04.2023	1 051,4631600
18	18.04.2023	1 051,4631600
19	19.04.2023	1 051,4631600
20	20.04.2023	1 051,4631600
21	21.04.2023	1 051,4631600
22	22.04.2023	1 051,4631600
23	23.04.2023	1 051,4631600
24	24.04.2023	1 056,4373376
25	25.04.2023	1 056,4373376
26	26.04.2023	1 056,4373376
27	27.04.2023	1 056,4373376
28	28.04.2023	1 056,4373376
29	29.04.2023	1 056,4373376
30	30.04.2023	1 057,5688102

### 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 мая 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	0,43%	да
2	Обратное РЕПО	32,65%	да
3	Государственные ценные бумаги Республики Казахстан, выпущенные Министерством финансов РК и НБ РК, долговые ценные бумаги, выпущенные местными исполнительными органами РК	9,23%	да
4	Долговые ценные бумаги, выпущенные юридическим лицом, сто процентов акций которого принадлежат НБ РК	7,95%	да
5	Долговые ценные бумаги, выпущенные акционерными обществами «Банк Развития Казахстана», «Фонд национального благосостояния «Самрук-Казына», «Национальный управляющий холдинг «Байтерек», «Фонд проблемных кредитов» в соответствии с законодательством Республики Казахстан и других государств	7,04%	да
6	Вклады в банках второго уровня Республики Казахстан	0,00%	да
7	Вклады в банках-нерезидентах	0,00%	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

8	Долговые ценные бумаги, выпущенные международными финансовыми организациями	9,92%	да
9	Ценные бумаги, имеющие статус государственных, выпущенные центральными правительствами иностранных государств	6,94%	да
10	Акции и депозитарные расписки иностранных эмитентов	0,00%	да
11	Паи Exchange Traded Funds (ETF) структура активов которых повторяет структуру одного из фондовых индексов акций или ценообразование которых привязано к индексам акций	14,84%	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	0,00%	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)	0,00%	да
14	Долговые ценные бумаги, иностранных негосударственных эмитентов	0,00%	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	0,00%	да
16	Долговые ценные бумаги, негосударственных эмитентов РК	11,02%	да
17	Производные финансовые инструменты	0,00%	да
18	Виды финансовых инструментов, указанные в строках 10, 11,12,13 и 15	14,84%	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
Купонные облигации (BRKZe11)	KZT	Банк Развития Казахстана	186 315 901,24
Ноты НБ РК (NTK028_2825)	KZT	ГУ "Национальный Банк Республики Казахстан"	233 999 965,93
<b>Итого</b>			<b>420 315 867,17</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
Ноты НБ РК (NTK027_2823)	KZT	ГУ "Национальный Банк Республики Казахстан"	242 510 400,00
<b>Итого</b>			<b>242 510 400,00</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>			

**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>			