

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

По состоянию на 1 августа 2023 года пенсионные активы (далее – ПА) АО «ЕНПФ» (далее – ЕНПФ), находящиеся в доверительном управлении АО «Halyk Global Markets» (далее – Halyk Global Markets), составили **2 417,97** 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

| <i>млн. тенге</i> | | | | | |
|---|-----------------------------------|----------------------|-----------------------------------|----------------------|-----------------------------------|
| Наименование | Текущая стоимость на 01.01.2023г. | Доля на 01.01.2023г. | Текущая стоимость на 01.08.2023г. | Доля на 01.08.2023г. | Прирост/ снижение с 01.01.2023 г. |
| Облигации банков второго уровня РК | 49,39 | 1,88% | 48,44 | 2,00% | -1,92% |
| Облигации МФО | 115,27 | 4,38% | 276,46 | 11,43% | 139,84% |
| Корпоративные облигации организаций РК | 121,62 | 4,62% | 118,88 | 4,92% | -2,25% |
| Облигации квазигосударственных организаций РК | 330,81 | 12,57% | 518,08 | 21,43% | 56,61% |
| Долевые инструменты иностранных эмитентов (Паи ETF) | 334,78 | 12,72% | 410,86 | 16,99% | 22,72% |
| Ноты НБРК | 0,00 | 0,00% | 0,00 | 0,00% | 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% | 176,63 | 7,30% | -1,18% |
| Обратное РЕПО (не более 90 календарных дней) | 1 307,42 | 49,69% | 854,64 | 35,35% | -34,63% |
| Прочие активы (дебиторская задолженность, просроченная задолженность, провизии) | 0,66 | 0,03% | 0,63 | 0,03% | -5,71% |
| Денежные средства на счетах | 62,51 | 2,38% | 13,36 | 0,55% | -78,63% |
| Итого ПА, находящиеся в управлении Halyk Global Markets | 2 631,21 | 100,00% | 2 417,97 | 100,00% | -8,10% |
| Обязательства к оплате по совершенным сделкам | - | - | - | - | - |
| Итого пенсионные активы | 2 631,21 | 100,00% | 2 417,97 | 100,00% | -8,10% |

По состоянию на 01.08.2023 г. средневзвешенная доходность долговых финансовых инструментов, номинированных в тенге, составила 14,46% годовых. Средневзвешенная доходность долговых финансовых инструментов, номинированных в долларах США, составила 5,64%.

Операции обратного РЕПО (не более 90 календарных дней)

В инвестиционном портфеле ПА ЕНПФ, находящихся в доверительном управлении Nalyk Global Markets, присутствуют операции обратного РЕПО, текущая стоимость которых за отчетный месяц составила 854,64 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 35,35%. Средневзвешенная доходность операций обратного РЕПО на отчетную дату составила 16,68% годовых.

Облигации банков второго уровня Республики Казахстан

Текущая стоимость облигаций банков второго уровня Республики Казахстан (далее – РК) за отчетный месяц снизилась на 2,14 млн. тенге и составила 48,44 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 2,00%.

Средневзвешенная доходность к погашению облигаций банков второго уровня РК на отчетную дату составила 11,69% годовых.

Облигации международных финансовых организаций

Текущая стоимость облигаций международных финансовых организаций за отчетный месяц выросла на 2,77 млн тенге и составила 276,46 млн. тенге. Доля в портфеле облигаций международных финансовых организаций составила 11,43%.

Средневзвешенная доходность к погашению по облигациям международных финансовых организаций, номинированным в тенге, с фиксированной ставкой вознаграждения составила 11,17% 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 увеличилась на 17,05 млн. тенге и составила 410,86 млн. тенге. Доля долевых инструментов иностранных эмитентов (ПАИ ETF) в портфеле составила 16,99%.

Корпоративные облигации эмитентов РК

Текущая стоимость корпоративных облигаций эмитентов РК за отчетный месяц снизилась на 5,50 млн. тенге и составила 118,88 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 4,92%.

Средневзвешенная доходность к погашению корпоративных облигаций эмитентов РК, номинированных в тенге, на отчетную дату составила 11,46% 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 снизилась на 1,79 млн. тенге и составила 176,63 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 7,30%.

Средневзвешенная доходность к погашению ценных бумаг, имеющих статус государственных, выпущенных центральными правительствами иностранных государств, на отчетную дату составила 5,64% годовых.

Облигации квазигосударственных организаций РК

Текущая стоимость облигаций квазигосударственных организаций РК за отчетный месяц снизилась на 4,25 млн. тенге и составила 518,08 млн. тенге. Доля облигаций квазигосударственных организаций РК в портфеле составила 21,43%.

Средневзвешенная доходность к погашению облигаций квазигосударственных организаций РК, номинированных в тенге, на отчетную дату составила 17,15% 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

| Валюта | Текущая стоимость на 01.01.2023г. | Доля на 01.01.2023г. | Текущая стоимость на 01.08.2023г. | Доля на 01.08.2023г. | Прирост/снижение с 01.01.2023г. |
|---------------------|-----------------------------------|----------------------|-----------------------------------|----------------------|---------------------------------|
| Национальная валюта | 2 095,80 | 79,65% | 1 816,59 | 75,13% | -13,32% |
| Доллары США | 535,40 | 20,35% | 601,37 | 24,87% | 12,32% |
| Евро | 0 | 0,00% | 0,01 | 0,001% | 0,00% |
| Итого: | 2 631,21 | 100,00% | 2 417,97 | 100,00% | -8,10% |

млн. тенге

Результаты инвестиционной деятельности

В результате инвестиционной деятельности, размер начисленного инвестиционного дохода (по состоянию на 01 августа 2023 года с 15 марта 2021 г.) составил 483,43 млн. тенге и размер начисленного инвестиционного дохода (по состоянию на 01 августа 2023 года с 01 января 2023 года) составил 260,03 млн. тенге. Доходность пенсионных активов составила 24,17% с начала деятельности и 9,93% 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

| Наименование | Инвестиционный доход с начала 2023 года. |
|--|--|
| Доходы в виде вознаграждения по ценным бумагам, в том числе по размещенным вкладам и операциям «обратное РЕПО» | 177,98 |
| Доходы (убытки) от рыночной переоценки ценных бумаг | 87,07 |
| Доходы (убытки) от переоценки иностранной валюты | -3,96 |
| Прочие доходы (убытки) | -1,06 |
| Итого: | 260,03 |

млн. тенге

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 | 01.07.2023 | 1 101,3741577 |
| 2 | 02.07.2023 | 1 101,3741577 |
| 3 | 03.07.2023 | 1 104,6855917 |
| 4 | 04.07.2023 | 1 104,6855917 |
| 5 | 05.07.2023 | 1 104,6855917 |
| 6 | 06.07.2023 | 1 104,6855917 |
| 7 | 07.07.2023 | 1 104,6855917 |
| 8 | 08.07.2023 | 1 104,6855917 |
| 9 | 09.07.2023 | 1 104,6855917 |
| 10 | 10.07.2023 | 1 103,0443541 |
| 11 | 11.07.2023 | 1 103,0443541 |

| | | |
|----|------------|---------------|
| 12 | 12.07.2023 | 1 103,0443541 |
| 13 | 13.07.2023 | 1 103,0443541 |
| 14 | 14.07.2023 | 1 103,0443541 |
| 15 | 15.07.2023 | 1 103,0443541 |
| 16 | 16.07.2023 | 1 103,0443541 |
| 17 | 17.07.2023 | 1 110,2485017 |
| 18 | 18.07.2023 | 1 110,2485017 |
| 19 | 19.07.2023 | 1 110,2485017 |
| 20 | 20.07.2023 | 1 110,2485017 |
| 21 | 21.07.2023 | 1 110,2485017 |
| 22 | 22.07.2023 | 1 110,2485017 |
| 23 | 23.07.2023 | 1 110,2485017 |
| 24 | 24.07.2023 | 1 112,7016893 |
| 25 | 25.07.2023 | 1 112,7016893 |
| 26 | 26.07.2023 | 1 112,7016893 |
| 27 | 27.07.2023 | 1 112,7016893 |
| 28 | 28.07.2023 | 1 112,7016893 |
| 29 | 29.07.2023 | 1 112,7016893 |
| 30 | 30.07.2023 | 1 112,7016893 |
| 31 | 31.07.2023 | 1 116,8541046 |

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 Markets¹. 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 августа 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 | 0,58% | да |
| 2 | Обратное РЕПО | 35,35% | да |
| 3 | Государственные ценные бумаги Республики Казахстан, выпущенные Министерством финансов РК и НБ РК, долговые ценные бумаги, выпущенные местными исполнительными органами РК | 0,00% | да |
| 4 | Долговые ценные бумаги, выпущенные юридическим лицом, сто процентов акций которого принадлежат НБ РК | 8,36% | 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 | 7,56% | да |
| 6 | Вклады в банках второго уровня Республики Казахстан | | да |
| 7 | Вклады в банках-нерезидентах | | да |
| 8 | Долговые ценные бумаги, выпущенные международными финансовыми организациями | 11,43% | да |

¹ 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

| | | | |
|----|--|--------|----|
| 9 | Ценные бумаги, имеющие статус государственных, выпущенные центральными правительствами иностранных государств | 7,30% | 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 | 16,99% | 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 | 12,42% | да |
| 17 | Производные финансовые инструменты | | да |
| 18 | Виды финансовых инструментов, указанные в строках 10, 11,12,13 и 15 | 16,99% | 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 (NTK027_2831) | KZT | ГУ "Национальный Банк Республики Казахстан" | 229 999 994,74 |
| Итого | | | 229 999 994,74 |

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 | | | |
| Итого | | | |

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_2831) | KZT | ГУ "Национальный Банк Республики Казахстан" | 232 616 700,00 |
| Итого | | | 232 616 700,00 |

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 | | | |
| Итого | | | |

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 | | | |
| Итого | | | |