

Информация по инвестиционному управлению пенсионными активами АО «ЕНПФ»

По состоянию на 1 июля 2021 года пенсионные активы (далее – ПА) ЕНПФ, находящиеся в доверительном управлении АО «Halyk Global Markets» (далее – Halyk Global Markets), составили 1 130,47 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	Текущая стоимость на 01.04.2021 г.	Доля на 01.04.2021 г.	Текущая стоимость на 01.07.2021 г.	Доля на 01.07.2021 г.	Прирост/снижение с 01.04.2021 г.
Обратное Репо (не более 90 календарных дней)	500,46	99,50%	749,29	66,28%	49,72%
Ноты НБРК	0	0,00%	177,01	15,66%	-
Облигации банков второго уровня РК	0	0,00%	51,83	4,58%	-
Долевые инструменты иностранных эмитентов (Паи ETF)	0	0,00%	151,50	13,40%	-
Денежные средства на счетах	2,51	0,50%	0,84	0,07%	-66,48%
Итого ПА, находящиеся в управлении Halyk Global Markets	502,97	100,00%	1 130,47	100,00%	124,76%
Обязательства к оплате по совершенным сделкам	0	0,00%	0	0,00%	-
Итого пенсионные активы	502,97		1 130,47		124,76%

млн. тенге

По состоянию на 01.07.2021г. средневзвешенная доходность долговых финансовых инструментов и операций обратного Репо, находящихся в инвестиционном портфеле ПА ЕНПФ, находящихся в доверительном управлении Halyk Global Markets, номинированных в тенге составила 8,61% годовых.

Операции обратного Репо (не более 90 календарных дней).

Основную долю в инвестиционном портфеле ПА ЕНПФ, находящихся в доверительном управлении Halyk Global Markets, занимают операций обратного Репо, текущая стоимость которых за отчетный месяц снизилась на 13,45 млн тенге и составила 749,29 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 66,28%. Средневзвешенная доходность операций обратного Репо, в инвестиционном портфеле ПА ЕНПФ, находящихся в доверительном управлении Halyk Global Markets, номинированных в тенге, на отчетную дату составила 8,40% годовых.

Ноты Национального Банка Республики Казахстан

Кроме того, в инвестиционном портфеле ПА ЕНПФ, находящихся в доверительном управлении Halyk Global Markets, присутствуют ноты Национального Банк Республики Казахстан, текущая стоимость которых за отчетный месяц составила 177,01 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 15,66%.

В отчетном периоде была совершена покупка нот Национального Банк Республики Казахстан в объеме 180,00 млн. тенге с доходностью в размере 9,12% годовых. Средневзвешенная доходность к погашению нот Национального Банка Республики Казахстан в инвестиционном портфеле ПА ЕНПФ, находящихся в доверительном управлении Halyk Global Markets, номинированных в тенге, на отчетную дату составила 8,92% годовых.

Облигации банков второго уровня Республики Казахстан.

В дополнение к этому, в инвестиционном портфеле ПА ЕНПФ, находящихся в доверительном управлении Halyk Global Markets, присутствуют долговые ценные бумаги,

облигаций банков второго уровня Республики Казахстан, текущая стоимость которых за отчетный месяц увеличилась на 1,00 млн. тенге и составила 51,83 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 4,58%.

Средневзвешенная доходность к погашению долговых ценных бумаг, банков второго уровня Республики Казахстан в инвестиционном портфеле ПА ЕНПФ, находящихся в доверительном управлении Halyk Global Markets, номинированных в тенге, на отчетную дату составила 10,52% годовых.

Долевые инструменты иностранных эмитентов.

Также, в инвестиционном портфеле ПА ЕНПФ, находящихся в доверительном управлении Halyk Global Markets, присутствуют долевые инструменты иностранных эмитентов, текущая стоимость которых за отчетный месяц увеличилась на 1,59 млн. тенге и составила 151,50 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 13,40%.

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

<i>млн. тенге</i>					
Валюта	Текущая стоимость на 01.04.2021г.	Доля на 01.04.2021г.	Текущая стоимость на 01.07.2021г.	Доля на 01.07.2021г.	Прирост/ снижение с 01.04.2021 г.
Национальная валюта	502,97	100%	978,92	86,59%	94,63%
Доллары США	0	0,00%	151,55	13,41%	
Итого:	502,97	100,00%	1 130,47	100,00%	124,76%

Результаты инвестиционной деятельности

В результате инвестиционной деятельности, размер начисленного инвестиционного дохода (по состоянию на 01 июля 2021 года с начала деятельности) составил 20,36 млн. тенге. Доходность пенсионных активов составила 2,32%.

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 за отчетный период
Доходы в виде вознаграждения по ценным бумагам, в том числе по размещенным вкладам и операциям «обратное РЕПО»	17,32
Доходы (убытки) от рыночной переоценки ценных бумаг	4,01
Доходы (убытки) от переоценки иностранной валюты	-0,94
Прочие доходы (убытки)	-0,03
Итого:	20,36

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	01.06.2021	913,3866738
2	02.06.2021	913,3866738
3	03.06.2021	913,3866738
4	04.06.2021	913,3866738

5	05.06.2021	913,3866738
6	06.06.2021	913,3866738
7	07.06.2021	914,6022466
8	08.06.2021	914,6022466
9	09.06.2021	914,6022466
10	10.06.2021	914,6022466
11	11.06.2021	914,6022466
12	12.06.2021	914,6022466
13	13.06.2021	914,6022466
14	14.06.2021	916,3741553
15	15.06.2021	916,3741553
16	16.06.2021	916,3741553
17	17.06.2021	916,3741553
18	18.06.2021	916,3741553
19	19.06.2021	916,3741553
20	20.06.2021	916,3741553
21	21.06.2021	915,8956999
22	22.06.2021	915,8956999
23	23.06.2021	915,8956999
24	24.06.2021	915,8956999
25	25.06.2021	915,8956999
26	26.06.2021	915,8956999
27	27.06.2021	915,8956999
28	28.06.2021	919,0341320
29	29.06.2021	919,0341320
30	30.06.2021	920,3713341

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 1 июня 2021 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)
	Денежные средства, включая остатки на банковских счетах	0,10%	да
	Обратное РЕПО	66,28%	да
1	Государственные ценные бумаги Республики Казахстан, выпущенные Министерством финансов РК и НБ РК, долговые ценные бумаги, выпущенные местными исполнительными органами РК, долговые ценные бумаги, выпущенные юридическим лицом, сто процентов акций которого принадлежат НБ РК	15,66%	да
2	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	0,00%	да
3	Вклады в банках второго уровня Республики Казахстан	0,00%	да
4	Вклады в банках-нерезидентах	0,00%	да
5	Долговые ценные бумаги, выпущенные международными финансовыми организациями	0,00%	да
6	Ценные бумаги, имеющие статус государственных, выпущенные центральными правительствами иностранных государств	0,00%	да
7	Акции и депозитарные расписки иностранных эмитентов, паи Exchange Traded Funds (ETF), Exchange Traded Commodities (ETC), Exchange Traded Notes (ETN)	13,37%	да
8	Долговые ценные бумаги, иностранных негосударственных эмитентов	0,00%	да
9	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

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

10	Долговые ценные бумаги, негосударственных эмитентов РК	4,58%	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	Номинальная стоимость в тенге
Ноты	KZT	Национальный Банк Республики Казахстан	180 000 000,00
Итого			180 000 000,00