

БЖЗҚ» АҚ Зейнетақы активтерін инвестициялық басқару бойынша ақпарат

2022 жылғы 1 ақпандағы жағдай бойынша «Halyk Global Markets» АҚ басқаруындағы (бұдан әрі – Halyk Global Markets) БЖЗҚ зейнетақы активтері (бұдан әрі – ЗА) 2 145,35 млн. теңгені құрады.

Halyk Global Markets басқаруындағы зейнетақы активтерінің есебінен құрылған қаржы құралдарының инвестициялық портфельінің құрылымы 1-кестеде көрсетілген.

1-кесте. Қаржы құралдарының бөлігінде Halyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфельінің құрылымы

Атауы	01.01.2022 жылға ағымдағы құны	01.01.2022 жылға үлесі	01.02.2022 жылға ағымдағы құны	01.02.2022 жылға үлесі	млн. теңге 01.01.2022 ж. бастап өсуі/төмендеуі
Кері Репо (90 күнтізбелік күннен артық емес)	892,98	43,33%	908,5	42,35%	1,74%
КРҰБ ноталары	0	0,00%	0	0,00%	-
ҚР екінші деңгейдегі банктердің облигациялары	155,3	7,54%	154,24	7,19%	-0,68%
ХҚҰ	120,2	5,83%	121,25	5,65%	0,87%
Шетелдік эмитенттердің үлестік құралдары (ETF пайлары)	288,4	13,99%	354,82	16,54%	23,03%
Шетелдік эмитенттердің акциялары және депозитарлық қолхаттары	180,38	8,75%	179,3	8,36%	-0,60%
Шоттардағы ақшалай қаражат	1,02	0,05%	43,11	2,01%	4108,21%
ҚР ұйымдарының корпоративтік облигациялары	125,67	6,10%	126,77	5,91%	0,88%
Басқа активтер (дебиторлық берешек, мерзімі өткен берешек, провизиялар)	0,38	0,02	0,38	0,02	0,55
ҚР квазимемлекеттік ұйымдардың облигациялары	296,51	14,39%	298,89	13,93%	0,80%
Halyk Global Markets басқаруындағы ЗА жиынтығы	2 060,84	100,00%	2 145,35	100,00%	4,10%
Жасалған мәмілелер бойынша төлеуге міндеттемелер	0	0,00%	41,90	1,95%	-
Зейнетақы активтерінің жиынтығы	2 060,84		2 187,26		6,13%

01.02.2022 ж. жағдай бойынша теңгеге номинирленген Halyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфельіндегі борыштық қаржы құралдарының және кері Репо операцияларының орташа алынған кірістілігі жылдық 10,64% - ды құрады.

Кері Репо операциялары (90 күнтізбелік күннен артық емес)

Halyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфельіндегі негізгі үлесті кері Репо операциялары алады, олардың ағымдағы құны есепті айда 15,52 млн.теңгеге өсіп, 908,50 млн. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 42,35%-ды құрады. Теңгеге номинирленген Halyk Global Markets сенімгерлік

басқаруындағы БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфеліндегі кері Репо операцияларының орташа алынған кірістілігі есепті күнге жылдық 10,91% -ды құрады.

Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банктерінің облигациялары

Бұған қосымша, Halyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфелінде борыштық бағалы қағаздар, Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банктерінің облигациялары бар, олардың ағымдағы құны есепті айда 1,06 млн теңгеге азайып, 154,24 млн теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 7,19% -ды құрады.

Halyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфеліндегі Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банктерінің теңгеге номинирленген борыштық бағалы қағаздарын өтеуге орташа алынған кірістілігі есепті күнге жылдық 9,77% -ды құрады.

Халықаралық қаржы ұйымдарының облигациялары

Есепті айда халықаралық қаржы ұйымдары облигацияларының ағымдағы құны 1,05 млн теңгеге өсті және 121,25 млн. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 5,65% құрады.

Халықаралық қаржы ұйымдарының облигацияларын өтеуге теңгеге номинирленген орташа алынған кірістілік белгіленген сыйақы мөлшерлемесімен жылдық 11,70% құрады.

Шетелдік эмитенттердің үлестік құралдары (ETF пайлары)

Сондай-ақ, Halyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфелінде шетелдік эмитенттердің (ETF пайлары) үлестік құралдары бар, олардың ағымдағы құны есепті айда 66,43 млн.теңгеге артып, 354,82 млн.теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 16,54%-ды құрады.

Есепті кезеңде 41,11 млн.теңге көлемінде ETF Vanguard S&P 500 ETF және 40,84 млн. теңге көлемінде SPDR S&P 500 ETF TRUST эмитенттерінің пайларын сатып алу жүргізілді.

Қазақстан Республикасы эмитенттерінің корпоративтік облигациялары

Осыған қосымша, Halyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфелінде ҚР эмитенттердің корпоративтік облигациялары бар, олардың ағымдағы құны есепті айда 1,10 млн.теңгеге артып, 126,77 млн.теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 5,91%-ды құрады.

Halyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфеліндегі ҚР эмитенттердің корпоративтік облигацияларын өтеуге орташа алынған кірістілігі есепті күнге жылдық 11,02% -ды құрады.

Шетелдік эмитенттердің акциялары мен депозитарлық қолхаттары

Сондай-ақ, Halyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфелінде шетелдік эмитенттердің акциялары бар, олардың ағымдағы құны есепті айда 1,09 млн теңгеге азайды және 179,30 млн. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 8,36% -ды құрады.

Есепті кезеңде 20,79 млн теңге көлемінде ASML Holding N. V. американдық депозитарлық қолхаттарды сатып алу және 15,54 млн теңге көлемінде «Сбербанк» ҚАҚ жаһандық депозитарлық қолхаттарын сату жүргізілді.

Қазақстан Республикасының квазимемлекеттік ұйымдарының облигациялары

Бұған қоса, Halyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфелінде ҚР квазимемлекеттік ұйымдарының облигациялары бар, олардың ағымдағы

құны есепті айда 2,38 млн.теңгеге артып, 298,89 млн.теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 13,93%-ды құрады.

Halyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфельіндегі ҚР квазимемлекеттік ұйымдарының облигацияларын өтеуге орташа алынған кірістілігі есепті күнге жылдық 10,60% -ды құрады.

Валюталық құрылым

Halyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы зейнетақы активтерінің есебінен сатып алынған қаржы құралдары номиналданған валюталар бөлігінде қаржы құралдарының инвестициялық портфелі 2-кестеде келтірілген.

Есепті кезеңде Қазақстан қор биржасында шетел валютасын сатып алу-сату мәмілелері жүзеге асырылмады.

2-кесте. Валюталар бөлігінде Halyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфельінің құрылымы

Валюта	<i>млн. теңге</i>				
	01.01.2022 жылға ағымдағы құны	01.01.2022 жылға үлесі	01.02.2022 ж. ағымдағы құны	01.02.2022 жылға үлесі	01.01.2022 ж. бастап осуі/төмендеуі
Ұлттық валюта	1 591,16	77,21%	1 610,67	75,08%	1,23%
АҚШ доллары	469,68	22,79%	534,68	24,92%	13,84%
Жиынтығы:	2 060,84	100,00%	2 145,35	100,00%	4,10%

Инвестициялық қызметтің нәтижелері

Инвестициялық қызметтің нәтижесінде, есептелген инвестициялық табыс мөлшері (активтерді берген сәттен бастап 2022 жылғы 01 ақпандағы жағдай бойынша) 104,24 млн. теңгені құрады және есептелген инвестициялық шығын мөлшері (2022 жылғы 01 қаңтардан бастап 2022 жылғы 01 ақпандағы жағдай бойынша) 8,55 млн теңгені құрады. Зейнетақы активтерінің табыстылығы қызметтің басында 8,00%-ды және 2022 жылдың басынан -0,38 %-ды құрады.

Есептелген инвестициялық табыстың құрылымы 3-кестеде көрсетілген.

3-кесте. Halyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА бойынша алынған инвестициялық табыс құрылымы

Атауы	<i>млн. теңге</i>	
	Активтерді берген сәттен бастап инвестициялық табыс	2022 жылдың басынан бастап инвестициялық табыс
Бағалы қағаздар бойынша, оның ішінде орналастырылған салымдар және «кері РЕПО» операциялары бойынша сыйақы түріндегі табыстар	88,49	14,01
Бағалы қағаздарды нарықтық қайта бағалаудан түскен кірістер (шығындар)	17,33	-21,83
Шетел валюталарын қайта бағалаудан түскен кірістер (шығындар)	0,18	-0,05
Басқа кірістер (шығындар)	-1,76	-0,68
Жиынтығы:	104,24	-8,55

Шартты бірліктің құны туралы ақпарат

Halyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА шартты зейнетақы бірлігі құнының динамикасы 4-кестеде көрсетілген.

4-кесте. Halyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА бір шартты бірлігінің құны

№	Күні	Бір шартты бірліктің құны
1	01.01.2022	975,1635583
2	02.01.2022	975,1635583
3	03.01.2022	975,1635583

4	04.01.2022	975,1635583
5	05.01.2022	981,2521215
6	06.01.2022	981,2521215
7	07.01.2022	981,2521215
8	08.01.2022	981,2521215
9	09.01.2022	981,2521215
10	10.01.2022	980,4317037
11	11.01.2022	980,4317037
12	12.01.2022	980,4317037
13	13.01.2022	980,4317037
14	14.01.2022	980,4317037
15	15.01.2022	980,4317037
16	16.01.2022	980,4317037
17	17.01.2022	982,5095637
18	18.01.2022	982,5095637
19	19.01.2022	982,5095637
20	20.01.2022	982,5095637
21	21.01.2022	982,5095637
22	22.01.2022	982,5095637
23	23.01.2022	982,5095637
24	24.01.2022	970,1067126
25	25.01.2022	970,1067126
26	26.01.2022	970,1067126
27	27.01.2022	970,1067126
28	28.01.2022	970,1067126
29	29.01.2022	970,1067126
30	30.01.2022	970,1067126
31	31.01.2022	971,4357628

Инвестициялық декларация параметрлерін сақтау туралы ақпарат

Сенімгерлік басқарудағы БЖЗҚ ЗА құрылымдық үлестіруі Halyk Global Markets¹ сенімгерлік басқаруындағы зейнетақы активтері есебінен қалыптастырылған қаржы құралдарының портфеліне Инвестициялық декларацияның талаптарына сәйкес келеді. Валюталық позициялар үлесі рұқсат етілген деңгей шегінде қалады және Halyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы зейнетақы активтері есебінен қалыптастырылған қаржы құралдарының портфеліне Инвестициялық декларацияның талаптарын бұзбайды. 2022 жылғы 01 ақпандағы жағдай бойынша инвестициялау лимиттерін сақтау туралы деректер 5-кестеде көрсетілген.

5-кесте. Halyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА бойынша инвестициялау лимиттері

№	Қаржы құралының түрі	Нақты мәні (зейнетақы активтерінің жалпы көлемінен пайызбен)	Орындалуы (иә/жоқ)
	Банктік шоттардағы қалдықтарды қосқандағы ақшалай қаражат	1,98%	иә
	Кері РЕПО	41,67%	иә
1	ҚР Қаржы министрлігі және ҚР ҰБ шығарған Қазақстан Республикасының мемлекеттік бағалы қағаздары, ҚР жергілікті атқарушы органдар шығарған борыштық бағалы қағаздар, жүз пайыз акциясы ҚР ҰБ тиесілі заңды тұлға шығарған борыштық бағалы қағаздар	0,00%	иә
2	Қазақстан Республикасының және басқа мемлекеттердің заңнамасына сәйкес «Қазақстанның Даму Банкі», «Самұрық-Қазына» ұлттық әл-ауқат қоры», «Бәйтерек» ұлттық басқару холдингі», «Проблемалы кредиттер қоры» акционерлік қорлары шығарған борыштық бағалы қағаздар	0,00%	иә
3	Standard & Poog 's агенттігінің халықаралық шәкілі бойынша бағалы қағаздың және/немесе эмитенттің "BB+" - тен төмен емес рейтингтік бағасы немесе басқа рейтингтік агенттіктердің бірінің осыған ұқсас деңгейдегі рейтингтік бағасы бар халықаралық қаржы ұйымдарының мемлекеттік, агенттік және бағалы қағаздары	7,04%	иә
4	Қазақстан Республикасының екінші деңгейлі банктеріндегі салымдар	0,00%	иә
5	Резидент емес банктердегі салымдар	0,00%	иә
6	Халықаралық қаржы ұйымдары шығарған борыштық бағалы қағаздар	0,00%	иә

¹ «Halyk Global Markets» АҚ Директорлар кеңесінің 2021 жылғы 18 ақпандағы №4 сырттай дауыс берудің қорытындылары туралы хаттамамен бекітілген Halyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы зейнетақы активтері есебінен қалыптастырылған қаржы құралдарының портфеліне Инвестициялық декларация

7	Халықаралық қаржы ұйымдары шығарған мемлекеттік деген мәртебесі бар бағалы қағаздар	0,00%	иә
8	Шетелдік эмитенттердің акциялары және депозитарлық қолхаттары, Exchange Traded Funds (ETF), Exchange Traded Commodities (ETC), Exchange Traded Notes (ETN) пайлары	24,50%	иә
9	Шетелдік мемлекеттік емес эмитенттердің борыштық бағалы қағаздары	0,00%	иә
10	ҚР эмитенттерінің акциялары және депозитарлық қолхаттары, басқарушы компаниясы Қазақстан Республикасының заңнамасына сәйкес құрылған заңды тұлғаның интервалды пайлық инвестициялық қорлардың пайлары	0,00%	иә
11	ҚР мемлекеттік эмитенттерінің борыштық бағалы қағаздары	24,81%	иә

№	Қаржы құралының түрі	Нақты мәні (зейнетақы активтерінен пайызбен)	Орындалуы (иә/жоқ)
1	Туынды қаржы құралдары, олардың:	0,00%	иә
1.1	Инвестициялық тәуекелді хеджирлеу мақсатында пайдаланылатын туынды қаржы құралдары	0,00%	иә
1.2	Инвестициялау мақсатында пайдаланылатын туынды қаржы құралдары	0,00%	иә
1.3	Құймадағы және металл шоттардағы алтын	0,00%	иә

Налық Global Markets сенімгерлік басқаруындағы зейнетақы активтері есебінен қалыптастырылған қаржы құралдары портфеліндегі қаржы құралдарын сатып алу, сату және өтеу бойынша ақпарат

6-кесте. Есептік айда қаржы құралдарын сатып алу бойынша мәлімет

Құрал түрі	Валюта	Бағалы қағаз эмитенті	Мәміле құны теңгемен
ETF	USD	Vanguard S&P 500 ETF	41 106 652,33
ETF	USD	SPDR S&P 500 ETF TRUST	40 840 880,50
Америклық депозитарлық қолхаттар	USD	ASML Holding N.V.	20 785 523,20
Жиынтығы			102 733 056,03

7-кесте. Есептік айдағы бағалы қағаздардың негізгі борышын өтеу жөніндегі мәлімет

Құрал түрі	Валюта	Бағалы қағаз эмитенті	Мәміле құны теңгемен
Жаһандық депозитарлық қолхаттар	USD	«Сбербанк» ҚАҚ	15 543 522,00
Жиынтығы			15 543 522,00