

**«Сентрас Секьюритиз» АҚ сенімгерлік басқаруындағы
«БЖЗҚ» АҚ зейнетақы активтерін
инвестициялық басқару бойынша ақпарат**

2022 жылғы 1 желтоқсандағы жағдай бойынша «Сентрас Секьюритиз» АҚ (бұдан әрі - Сентрас Секьюритиз) сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ зейнетақы активтері (бұдан әрі – ЗА) 971,11 млн. теңгені құрап отыр.

Сентрас Секьюритиз сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ зейнетақы активтері есебінен құралған қаржы құралдарының инвестициялық портфелінің құрылымы 1-кестеде берілді.

1-кесте. Қаржы құралдарының бөлігінде Сентрас Секьюритиз сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфелінің құрылымы

Атауы	01.01.2022 жылға ағымдағы құны	01.01.2022 жылға үлесі	01.12.2022 жылға ағымдағы құны	01.12.2022 жылға үлесі	Жыл басынан бергі өсу/төмендеу
ҚР ҚМ МБҚ	560,90	69,29%	528,39	54,41%	-5,80%
ҚР квазимемлекеттік ұйымдарының облигациялары	0,00	0,00%	86,46	8,90%	0,00%
ҚР эмитенттерінің акциялары мен депозитарлық колхаттары	119,26	14,73%	70,73	7,28%	-40,69%
Шетелдік эмитенттердің үлестік құралдары (ETF пайлары)	0,00	0,00%	28,77	2,96%	0,00%
Репо	127,09	15,70%	154,24	15,88%	21,36%
Инвестициялық шоттардағы ақшалай қаражат	2,20	0,27%	102,52	10,56%	4562,55%
ИПБ басқаруындағы ЗА жиынтығы	809,46	100,00%	971,11	100,00%	19,97%
Жасалған мәмілелер бойынша төлемге міндеттемелер	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00%
Зейнетақы активтерінің жиынтығы	809,46		971,11		19,97%

01.12.2022 жылғы жағдай бойынша теңгемен номиналданған борыштық қаржы құралдарын және РЕПО өтеуге орташа алынған кірістілік (ҮТМ) – жылына 11,96%.

Ақшалай қаражат және кері РЕПО операциялары

Есепті айдағы кері РЕПО операцияларының ағымдағы құны – 154,24 млн. теңге. Олардың портфельдегі үлесі – 15,88%. Есепті кезең соңындағы инвестициялық шоттардағы ақшалай қаражат қалдығы – 102,52 млн. теңге. Есепті ай соңындағы ақшалай қаражат пен кері РЕПО операциялары бойынша талаптардың жиынтық үлесі – 26,44%.

Қазақстан Республикасы Қаржы министрлігінің мемлекеттік бағалы қағаздары

Портфельдің негізгі үлесін алып тұрған Қазақстан Республикасы Қаржы министрлігінің мемлекеттік бағалы қағаздарының ағымдағы құны есепті ай соңында 528,39 млн. теңге болды. Олардың портфельдегі үлесі – 54,41%.

Есепті күндегі теңгемен номиналданған ҚР Қаржы министрлігінің МБҚ бойынша өтеуге орташа алынған кірістілік – жылына 11,61%.

ҚР квазимемлекеттік ұйымдарының облигациялары

Есепті күндегі Қазақстан Республикасының квазимемлекеттік ұйымдарының облигациялары бойынша өтелуі тиіс орташа өлшенген кірістілік – жылына 6,99%. Қазақстан Республикасының квазимемлекеттік ұйымдары облигацияларының ағымдағы құны есепті ай соңында 86,46 млн. теңге болып отыр. Олардың портфельдегі үлесі – 8,90%.

Есепті кезеңде ҚР квазимемлекеттік ұйымдарының облигациялары сатып алынған жоқ.

Қазақстан Республикасы эмитенттерінің акциялары мен депозитарлық қолхаттары

Қазақстан Республикасы эмитенттерінің акциялары мен депозитарлық қолхаттарының ағымдағы құны есепті ай соңында 70,73 млн. теңге болды. Олардың портфельдегі үлесі – 7,28%.

Шетелдік эмитенттердің үлестік құралдары (ETF пайлары)

Шетелдік эмитенттердің үлестік құралдарының (ETF пайлары) ағымдағы құны есепті ай соңында 28,77 млн. теңге болды. Олардың портфельдегі үлесі – 2,96%. Есепті кезеңде SPDR PORTFOLIO S&P 500 ETF эмитенттерінің ETF пайлары сатып алынды.

Валюталық құрылым

Сентрас Секьюритиз сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ зейнетақы активтерінің есебінен сатып алынған қаржы құралдары номиналданған валюталар бөлігінде қаржы құралдарының инвестициялық портфелі 2-кестеде берілді.

Есепті кезеңде Қазақстанның қор биржасында шетелдік валютамен сатып алу-сату мәмілелері жасалған жоқ.

2-кесте. Валюталар бөлігінде Сентрас Секьюритиз сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфелінің құрылымы

млн теңге

Валюта	01.01.2022 жылғы ағымдағы құны	01.01.2022 жылғы үлесі	01.12.2022 жылғы ағымдағы құны	01.12.2022 жылғы үлесі	Жыл басынан бергі өсу/төмендеу
Ұлттық валюта	809,46	100%	777,05	80,02%	-4,00%
АҚШ доллары	0,00	0,00	194,06	19,98%	0,00%
Ресей рублі	0,00	0,00	0,00	0,00%	-
Басқа валюталар	0,00	0,00	0,00	0,00%	-
Жиыны:	809,46	100%	971,11	100%	19,97%

Инвестициялық қызмет нәтижесі

Инвестициялық қызметтің және қаржы құралдарының нарықтық құнының өзгеруі нәтижесінде 2022 жыл басынан бері есептелген инвестициялық табыс мөлшері 26,44 млн. теңге болды. 2022 жыл басынан бергі зейнетақы активтерінің кірістілігі 2,18% болып отыр.

Көрсетілген кезеңдегі есептелген инвестициялық табыс құрылымы 3-кестеде берілді.

3-кесте. Сентрас Секьюритиз сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА бойынша алған инвестициялық табыс құрылымы

млн теңге

Атауы	2022 жылғы инвестициялық кіріс
Бағалы қағаздар, орналастырылған салымдар және «кері РЕПО» операциялары бойынша сыйақы түріндегі табыстар	81,25
Бағалы қағаздарды нарықтық қайта бағалаудан кірістер (шығындар)	-76,20
Шетелдік валютаны қайта бағалаудан кірістер (шығындар)	2,55
Басқа активтерді қайта бағалаудан кірістер (шығындар) (БҚК)	0,00
Сыртқы басқарудағы активтер бойынша кірістер (шығындар)	0,00
Басқа табыстар (шығындар)	18,84
Жиыны:	26,44

Шартты бірлік құны туралы ақпарат

Сентрас Секьюритиз сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА шартты зейнетақы бірлігі құнының динамикасы 4-кестеде берілді.

4-кесте. Сентрас Секьюритиз сенімгерлік басқаруындағы бір шартты бірлік құны

№	Күні	Шартты бірлік құны
1	01.11.2022	1 016,7461923
2	02.11.2022	1 016,7461923
3	03.11.2022	1 016,7461923
4	04.11.2022	1 016,7461923
5	05.11.2022	1 016,7461923
6	06.11.2022	1 016,7461923
7	07.11.2022	1 017,6623954
8	08.11.2022	1 017,6623954
9	09.11.2022	1 017,6623954
10	10.11.2022	1 017,6623954
11	11.11.2022	1 017,6623954
12	12.11.2022	1 017,6623954
13	13.11.2022	1 017,6623954
14	14.11.2022	1 017,7854187
15	15.11.2022	1 017,7854187
16	16.11.2022	1 017,7854187
17	17.11.2022	1 017,7854187
18	18.11.2022	1 017,7854187
19	19.11.2022	1 017,7854187
20	20.11.2022	1 017,7854187
21	21.11.2022	1 005,1467172
22	22.11.2022	1 005,1467172
23	23.11.2022	1 005,1467172
24	24.11.2022	1 005,1467172
25	25.11.2022	1 005,1467172
26	26.11.2022	1 005,1467172
27	27.11.2022	1 005,1467172
28	28.11.2022	1 013,0243562
29	29.11.2022	1 013,0243562
30	30.11.2022	1 013,7635860

Инвестициялық декларация өлшемдерін сақтау туралы ақпарат

Сентрас Секьюритиз сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА құрылымдық бөлу Инвестициялық декларация талаптарына сәйкес. Валюталық позициялар үлесі рұқсат етілген деңгей шегінде қалады және Инвестициялық декларацияның талаптарын бұзбайды. 2022 жылғы 1 желтоқсандағы жағдай бойынша Сентрас Секьюритиз сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА бойынша инвестициялау шектерін сақтау туралы мәлімет 5-кестеде берілді.

5-кесте. Сентрас Секьюритиз сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА бойынша инвестициялау шектері

№	Қаржы құралының түрі	Нақты мәні (ЗА жалпы көлемінен пайызбен)	Орындалуы (иә/жоқ)
1	Ұлттық валютадағы ақшалай қаражат – теңге (KZT)	2,44%	иә
2	Қаулыға сай басқа елдердің шетелдік валютасы	8,12%	иә
3	ҚР Қаржы министрлігі және ҚР Ұлттық Банкі шығарған ҚР мемлекеттік бағалы қағаздары (оның ішінде шетелдік мемлекеттердің заңнамасына сәйкес эмиссияланған), сондай-ақ ҚР Үкіметінің кепілімен және (немесе) кепілдігімен шығарылған БҚ	54,41%	иә
4	ҚР жергілікті атқару органдары шығарған борыштық БҚ	0,00%	иә
5	Акцияларының жүз пайызы ҚР Ұлттық Банкіне тиесілі заңды тұлға шығарған борыштық БҚ	0,00%	иә
6	ҚР және басқа мемлекеттердің заңнамасына сәйкес «Қазақстан Даму банкі», «Самұрық-Қазына» Ұлттық әл-ауқат қоры», «Бәйтерек» Ұлттық басқарушы холдингі», «Проблемалы кредиттер қоры» акционерлік қоғамдары шығарған борыштық БҚ	0,00%	иә
7	Қаулыға сай ҚР екінші деңгейдегі банктеріндегі салымдар	0,00%	иә
8	Қаулыға сай бейрезидент банктердегі салымдар	0,00%	иә
9	Standard & Poor's (Стандарт энд Пурс) агенттігінің халықаралық шәкіл бойынша «ВВ+» деңгейінен төмен емес рейтинг бағасы немесе Moody's Investors Service (Мудис Инвесторс Сервис) немесе Fitch (Фич) агенттіктерінің ұқсас деңгейдегі рейтинг бағасы бар төмендегі халықаралық қаржы ұйымдары шығарған борыштық бағалы қағаздар: Азиялық даму банкі (the Asian Development Bank); Америкалық даму банкі (the Inter-American Development Bank); Африкалық даму банкі (the African Development Bank); Еуразиялық даму банкі (Eurasian Development Bank); Еуропалық қайта құру және даму банкі (the European Bank for Reconstruction and Development); Еуропалық инвестициялық банк (the European Investment Bank); Еуропалық Кеңестің Даму банкі (the Council of Europe Development Bank); Ислам жеке секторды дамыту корпорациясы (the Islamic Corporation for the Development of the Private Sector); Ислам даму банкі (the Islamic Development Bank); Көпқырлы инвестициялар кепілі агенттігі (the Multilateral Investment Guarantee Agency); Скандинав инвестициялық банкі (the Nordic Investment Bank); Халықаралық валюта қоры (the International Monetary Fund); Халықаралық даму қауымдастығы (the International Development Association); Халықаралық инвестициялық дауларды реттеу орталығы (the International Centre for Settlement of Investment Disputes); Халықаралық қайта құру және даму банкі (the International Bank for Reconstruction and Development); Халықаралық қаржы корпорациясы (the International Finance Corporation).	0,00%	иә
10	Қаулыға сай шетелдік мемлекеттердің үкіметтері шығарған мемлекеттік мәртебесі бар БҚ	0,00%	иә
11	Шетелдік ұйымдар шығарған мемлекеттік емес БҚ: *Standard & Poor's (Стандарт энд Пурс) агенттігінің халықаралық шәкіл бойынша «ВВ» деңгейінен төмен емес рейтинг бағасы немесе Moody's Investors Service (Мудис Инвесторс Сервис) немесе Fitch (Фич) агенттіктерінің ұқсас деңгейдегі рейтинг бағасы бар шетелдік эмитенттердің акциялары; *негізгі қор индекстері құрамына кіретін шетелдік эмитенттердің акциялары және осы акциялар базалық активі болып табылатын депозитарлық қолхаттар; * борыштық БҚ Standard & Poor's (Стандарт энд Пурс) агенттігінің халықаралық шәкіл бойынша «ВВ» деңгейінен төмен емес рейтинг бағасы немесе Moody's Investors Service (Мудис Инвесторс Сервис) немесе Fitch (Фич) агенттіктерінің ұқсас деңгейдегі рейтинг бағасы бар	0,00%	иә
12	Қаулыға сай ҚР және басқа мемлекеттердің заңнамасына сәйкес ҚР ұйымдары шығарған мемлекеттік емес БҚ	16,19%	иә
13	Қаулыға сай Exchange Traded Funds (Эксчейндж Трэйдэд Фандс), Exchange, Traded Commodities (Эксчейндж Трэйдэд Коммодитис), Exchange Traded Notes (Эксчейндж Трэйдэд Ноутс) пайлары	2,96%	иә

14	Қаулыға сай қор биржасының ресми тізіміне қосылған ҚР заңнамасына сәйкес құрылған заңды тұлға басқарушы компаниясы болып табылатын интервал пайлық инвестициялық қорлардың пайлары	0,00%	иә
15	Қаулыға сай аффинирленген асыл металдар	0,00%	иә
16	Қаулыға сай хеджирлеу мақсатында жасалған туынды қаржы құралдары	0,00%	иә

Сентрас Секьюритиз сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфеліндегі қаржы құралдарын сатып алу, сату және өтеу бойынша ақпарат

6-кесте. Есепті айдағы қаржы құралдарын сатып алу бойынша мәлімет

Құрал түрі	Валюта	Бағалы қағаз эмитенті	Теңгемен мәміле сомасы
ETF	USD	SPDR PORTFOLIO S&P 500 ETF	10 731 950,23
Жиыны			10 731 950,23

7-кесте. Есепті айдағы қаржы құралдарын сату бойынша мәлімет

Құрал түрі	Валюта	Бағалы қағаз эмитенті	Теңгемен мәміле сомасы
-	-	-	-
Жиыны			-