

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

2021 жылғы 1 маусымдағы жағдай бойынша «Сентрас Секьюритиз» АҚ (бұдан әрі - Сентрас Секьюритиз) сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ зейнетақы активтері (бұдан әрі – ЗА) 396,99 млн.теңгені құрады.

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

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

Атауы	01.05.2021 жылғы ағымдағы құны	01.05.2021 жылғы үлесі	01.06.2021 жылғы ағымдағы құны	01.06.2021 жылғы үлесі	01.05.2021 жылдан бастап өсуі/төмендеуі
ҚР ҚМ МБҚ	267,54	79,31%	370,97	93,45%	38,66%
Инвестициялық шоттардағы ақшалай қаражат	0,74	0,22%	26,02	6,55%	
Репо	69,06	20,47%	0,00	0,00%	-100,00%
ИИБ басқаруындағы ЗА жиынтығы	337,35	100%	396,99	100%	17,68%
Жасалған мәмілелер бойынша төлемге міндеттемелер	0,00	0,00%	0,00	0,00%	
Барлығы зейнетақы активтері	337,35		396,99		17,68%

01.06.2021 жылғы жағдай бойынша теңгеге номиналданған борыштық қаржы құралдарын өтеуге орташа алынған кірістілік (YTM) жылына 10,11% құрайды.

Инвестициялық шоттардағы ақшалай қаражат

Инвестициялық шоттардағы ақшалай қаражат қалдығы есепті кезең соңында 26,02 млн. теңгені құрады. Ақшалай қаражат үлесі есепті кезең соңында 6,55% құрады.

Қазақстан Республикасы Қаржы министрлігінің мемлекеттік бағалы қағаздары

Есепті кезеңде ҚР Қаржы министрлігінің МБҚ сатып алынды, олар 106,99 млн. теңге номинал көлемінде портфелде негізгі үлесті алып отыр.

Есепті күндегі теңгемен номиналданған ҚР Қаржы министрлігінің МБҚ бойынша өтеуге орташа алынған кірістілік жылына 10,1% құрады.

Валюталық құрылым

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

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

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

Валюта	01.05.2021 жылғы ағымдағы құны	01.05.2021 жылғы үлесі	01.06.2021 жылғы ағымдағы құны	01.06.2021 жылғы үлесі	01.05.2021 жылғы өсуі/төмендеуі
Ұлттық валюта	337,35	100%	396,99	100%	17,68%
АҚШ доллары	0,00	0,00	0,00	0,00	-
Ресей рублі	0,00	0,00	0,00	0,00	-
Басқа валюталар	0,00	0,00	0,00	0,00	-
Жиыны:	337,35	100%	396,99	100%	17,68%

млн теңге

Инвестициялық қызметтің нәтижелері

Инвестициялық қызметтің және қаржы құралдарының нарықтық құнының өзгеруі нәтижесінде есептелген инвестициялық табыс көлемі 9,35 млн. теңгені құрады. Зейнетақы активтерінің кірістілігі 2,54% құрады.

Көрсетілген кезең үшін есептелген инвестициялық кіріс құрылымы 3-кестеде берілген.

3-кесте. Сентрас Секьюритиз сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА бойынша алынған инвестициялық кіріс құрылымы

<i>млн теңге</i>	
Атауы	2021 жылға инвестициялық кіріс
Бағалы қағаздар бойынша, оның ішінде орналастырылған салымдар және «кері РЕПО» операциялары бойынша сыйақы түріндегі кірістер	4,50
Бағалы қағаздарды нарықтық қайта бағалаудан кірістер (шығындар)	4,85
Шетелдік валютаны қайта бағалаудан кірістер (шығындар)	0,00
Басқа активтерді қайта бағалаудан кірістер (шығындар) (БҚК)	0,00
Сыртқы басқарудағы активтер бойынша кірістер (шығындар)	0,00
Басқа кірістер (шығындар)	0,00
Жиыны:	9,35

Шартты бірлік құны туралы ақпарат

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

4-кесте. Сентрас Секьюритиз сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА бір шартты бірлігінің құны

№	Күні	Бір шартты бірлік құны
1	01.05.2021	915,3269954
2	02.05.2021	915,5577865
3	03.05.2021	915,7885776
4	04.05.2021	915,8490486
5	05.05.2021	916,0242994
6	06.05.2021	916,2391829
7	07.05.2021	916,4540664
8	08.05.2021	916,6689499
9	09.05.2021	916,8838334
10	10.05.2021	917,0987170
11	11.05.2021	917,6355660
12	12.05.2021	917,8504496
13	13.05.2021	918,0835179
14	14.05.2021	918,3165863
15	15.05.2021	918,5496547
16	16.05.2021	918,7827230
17	17.05.2021	928,3448528
18	18.05.2021	928,5779212
19	19.05.2021	928,8109896
20	20.05.2021	929,0440580
21	21.05.2021	929,2771263
22	22.05.2021	929,5101947
23	23.05.2021	929,7432631
24	24.05.2021	923,0868803
25	25.05.2021	923,3199487

26	26.05.2021	923,5530171
27	27.05.2021	923,7399139
28	28.05.2021	923,9575918
29	29.05.2021	924,1873956
30	30.05.2021	924,4171995
31	31.05.2021	930,1685822

Инвестициялық декларация параметрлерін сақтау туралы ақпарат

Сентрас Секьюритиз сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА құрылымдық үлестіру Инвестициялық декларация талаптарына сәйкес келеді. Валюталық позициялар үлесі рұқсат етілген деңгей шегінде қалады және Инвестициялық декларацияның талаптарын бұзбайды. 2021 жылғы 1 маусымдағы жағдай бойынша Сентрас Секьюритиз сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА бойынша инвестициялау лимиттерін сақтау туралы мәліметтер 5-кестеде берілген.

5-кесте. Сентрас Секьюритиз сенімгерлік басқаруына берілген зейнетақы активтері бойынша инвестициялау лимиттері

№	Қаржы құралының түрі	Нақты мәні (ЗА жалпы көлемінен пайызбен)	Орындалуы (иә/жоқ)
1	Ұлттық валютадағы ақшалай қаражат – теңге (KZT)	6,55%	иә
2	Қаулыға сай басқа елдердің шетелдік валютасы	0,00%	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	93,45%	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 банктерге салымдар	0,00%	иә
9	Standard & Poor's (Стандарт энд Пурс) агенттігінің халықаралық шәкіл бойынша «BB+» 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	0,00%	иә

	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).		
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 «BB» 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 «BB» 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	0,00%	иә
13	Қаулыға сай Exchange Traded Funds (Эксчейндж Трэйдэд Фандс), Exchange, Traded Commodities (Эксчейндж Трэйдэд Коммодитис), Exchange Traded Notes (Эксчейндж Трэйдэд Ноутс) пайлары	0,00%	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 мәліметтер

млн. теңге

Құрал түрі	Валюта	Бағалы қағаз эмитенті	Теңгемен номинал құны
ҚР МБҚ	KZT	ҚР Қаржы министрлігі	106 986 000
Жиыны			106 986 000

7-кесте. Есепті айдағы қаржы құралдарын сату бойынша мәліметтер

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

8-кесте. Есепті айдағы бағалы қағаздар бойынша негізгі борышты өтеу бойынша мәліметтер

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

9-кесте. Есепті айдағы шетелдік банктерге салымдарға орналастыру бойынша мәліметтер

Құрал түрі	Валюта	Банк атауы	Теңгемен мәміле сомасы
-	-	-	-
Жиыны			

10-кесте. Есепті айдағы салымдар бойынша негізгі борышты өтеу бойынша мәліметтер

Құрал түрі	Валюта	Банк атауы	Теңгемен өтеу сомасы
-	-	-	-
Жиыны			