

## «БЖЗҚ» АҚ зейнетақы активтерін инвестициялық басқару бойынша ақпарат

2023 жылғы 1 қаңтадағы жағдай бойынша «Halyk Global Markets» АҚ сенімгерлік басқаруындағы (бұдан әрі – Halyk Global Markets) БЖЗҚ зейнетақы активтері (бұдан әрі – ЗА) **2 631,21** млн. теңгені құрады.

Halyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы зейнетақы активтері есебінен қалыптастырылған қаржы құралдары портфелінің құрылымы 1-кестеде көрсетілген.

**1-кесте. Қаржы құралдарының бөлігіндегі, Halyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы, БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфелінің құрылымы**

Атауы	01.01.2022 жылға ағымдағы құны	01.01.2022 жылға үлесі	01.01.2023 жылға ағымдағы құны	01.01.2023 жылға үлесі	01.01.2022 ж. бастап өсуі/төмендеуі
ҚР екінші деңгейдегі банктерінің облигациялары	155,30	7,54%	49,39	1,88%	-68,20%
ХҚҰ	120,20	5,83%	115,27	4,38%	-4,10%
ҚР ұйымдарының корпоративтік облигациялары	125,67	6,10%	121,62	4,62%	-3,22%
ҚР квазимемлекеттік ұйымдарының облигациялары	296,51	14,39%	330,81	12,57%	11,57%
Шетелдік эмитенттердің үлестік құралдары (ETF пайлары)	288,40	13,99%	334,78	12,72%	16,08%
ҚРҰБ ноталары	-	-	-	-	-
Шетелдік эмитенттердің акциялары және депозитарлық қолхаттары	180,38	8,75%	-	-	-
Қазақстан Республикасының ұйымдары шығарған акциялар және депозитарлық қолхаттар			130,00	4,94%	-
Шет мемлекеттердің орталық үкіметтері шығарған, мемлекеттік мәртебесі бар бағалы қағаздар	-	-	178,74	6,79%	-
Кері Repo (90 күнтізбелік күннен артық емес)	892,98	43,33%	1 307,42	49,69%	46,41%
Басқа активтер (дебиторлық берешек, мерзімі өткен берешек, провизиялар)	0,38	0,02%	0,66	0,03%	
Шоттардағы ақшалай қаражат	1,02	0,05%	62,51	2,38%	6002,91%
<b>Halyk Global Markets басқаруындағы ЗА жиынтығы</b>	<b>2 060,84</b>	<b>100,00%</b>	<b>2 631,21</b>	<b>100,00%</b>	<b>27,68%</b>
Жасалған мәмілелер бойынша төлеуге міндеттемелер	0	-	0	-	-
<b>Зейнетақы активтерінің жиынтығы</b>	<b>2 060,84</b>	<b>100,00%</b>	<b>2 631,21</b>	<b>100,00%</b>	<b>27,68%</b>

*млн. теңге*

01.01.2023 ж. жағдай бойынша теңгемен номиналданған борыштық қаржы құралдарының орташа алынған кірістілігі жылдық 13,24%-ды құрады. АҚШ долларымен номиналданған қарыздық қаржы құралдарының орташа алынған кірістілігі 4,62% құрады.

### **Кері Репо операциялары (90 күнтізбелік күннен артық емес)**

Halyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ инвестициялық портфелінде кері Репо операциялары бар, олардың ағымдағы құны есепті айда 1307,42 млн теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 49,69%-ды құрды. Кері Репо операцияларының орташа алынған кірістілігі есепті күнге жылдық 16,38%-ды құрады.

### **Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банктерінің облигациялары**

Қазақстан Республикасының (бұдан әрі – ҚР) екінші деңгейдегі банктері облигацияларының ағымдағы құны есепті айда 103,96 млн.теңгеге төмендеп, 49,39 млн. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 1,88% құрайды. Есепті кезеңде 100 млн. теңге сомасына "Хоум Кредит энд Финанс Банк" АҚ ЕБ облигациялары өтелді.

Есепті күнге ҚР екінші деңгейдегі банктерінің облигацияларын өтеуге орташа алынған кірістілік жылдық 12.36%-ды құрады.

### **Халықаралық қаржы ұйымдарының облигациялары**

Есепті айда халықаралық қаржы ұйымдары облигацияларының ағымдағы құны 1,05 млн теңгеге өсіп, 115,27 млн теңгені құрады. Халықаралық қаржы ұйымдарының портфельдегі үлесі 4,38%-ды құрайды.

Халықаралық қаржы ұйымдарының облигациялары бойынша өтеуге, теңгеде номиналданған, орташа алынған кірістілік, белгіленген сыйақы мөлшерлемесімен жылдық 15,19%-ды құрады.

### **Шетелдік эмитенттердің үлестік құралдары (ETF пайлары)**

Halyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфелінде шетелдік эмитенттердің үлестік құралдары (ETF пайлары) бар, есепті айда олардың ағымдағы құны 22,25 млн. теңгеге төмендеп, 334,78 млн. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 12,72%-ды құрады.

### **ҚР эмитенттерінің корпоративтік облигациялары**

ҚР эмитенттерінің корпоративтік облигацияларының ағымдағы құны есепті айда 1,10 млн теңгеге ұлғайып, 121,62 млн теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 4,62%-ды құрады.

Теңгемен номиналданған ҚР эмитенттерінің корпоративтік облигацияларын өтеуге орташа алынған кірістілік есепті күнге жылдық 12,21%-ды құрайды.

### **Шет мемлекеттердің орталық үкіметтері шығарған, мемлекеттік мәртебесі бар бағалы қағаздар**

Шет мемлекеттердің орталық үкіметтері шығарған, мемлекеттік мәртебесі бар бағалы қағаздардың ағымдағы құны есепті айда 1,61 млн.теңгеге төмендеп, 178,74 млн. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 6,79% құрайды.

Шет мемлекеттердің орталық үкіметтері шығарған, мемлекеттік мәртебесі бар бағалы қағаздарды өтеуге орташа алынған кірістілік есепті күнге жылдық 4,62 -ды. құрады.

### **Шетелдік эмитенттердің акциялары мен депозитарлық қолхаттары**

01.01.2023 ж. жағдай бойынша Halyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфелінде шетелдік эмитенттердің акциялары мен депозитарлық қолхаттары болған жоқ.

### **ҚР эмитенттерінің акциялары мен депозитарлық қолхаттары**

01.01.2023 ж. жағдай бойынша Halyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфелінде ҚР эмитенттерінің акциялары мен депозитарлық қолхаттары болды, олардың ағымдағы құны 130,00 млн.теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 4,94% құрады.

Есепті кезеңде жалпы сомасы 130,00 млн. Теңгеге «ҚазМұнайГаз ҰК» АҚ-ның 15 465 жай акциясын сатып алу бойынша мәміле жасалды.

### ҚР квазимемлекеттік ұйымдарының облигациялары

ҚР квазимемлекеттік ұйымдары облигацияларының ағымдағы құны есепті айда 24,19 млн. теңгеге төмендеп, 330,81 млн. теңгені құрады. Портфельдегі ҚР квазимемлекеттік ұйымдары облигацияларының үлесі 12,57% құрады. Есепті кезеңде «Қазақстанның орнықтылық қоры» АҚ облигациялары 25 млн.теңге сомасына өтелді.

Теңгемен номиналданған ҚР квазимемлекеттік ұйымдарының облигацияларын өтеуге орташа алынған кірістілік есепті күнге жылдық 13,06% құрады.

### Валюталық құрылым

Halyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы, зейнетақы активтері есебінен сатып алынған, қаржы құралдары номиналданған валюталар бөлінісіндегі 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 портфелінің құрылымы

млн. теңге

Валюта	01.01.2022 жылға ағымдағы құны	01.01.2022 жылға үлесі	01.01.2023 ж. ағымдағы құны	01.01.2023 жылға үлесі	01.01.2022 ж. бастап өсуі/төмендеуі
Ұлттық валюта	1 591,16	77,21%	2 095,80	79,65%	31,72%
АҚШ доллары	469,68	22,79%	535,40	20,35%	13,99%
<b>Жиыны:</b>	<b>2 060,84</b>	<b>100,00%</b>	<b>2 631,21</b>	<b>100,00%</b>	<b>27,68%</b>

### Инвестициялық қызмет нәтижелері

Инвестициялық қызмет нәтижесінде, есептелген инвестициялық табыс мөлшері (активтерді берген сәттен бастап 2023 жылғы 01 қаңтардағы жағдай бойынша) 223,40 млн теңгені және есептелген инвестициялық кіріс мөлшері (2022 жылғы 01 қаңтардан бастап 2023 жылғы 01 қаңтардағы жағдай бойынша) 110,61 млн теңгені құрады. Зейнетақы активтерінің кірістілігі қызмет басынан бері 12,95%-ды және 2022 жылдың басынан бастап 4,19%-ды құрды.

Есептелген инвестициялық табыстың құрылымы 3-кестеде көрсетілген.

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

млн. теңге

Атауы	2022 жыдың басынан бастап инвестициялық табыс
Бағалы қағаздар бойынша, оның ішінде орналастырылған салымдар және «кері РЕПО» операциялары бойынша сыйақы түріндегі кірістер	203,85
Бағалы қағаздарды нарықтық қайта бағалаудан түскен кірістер (шығындар)	- 100,09
Шетел валюталарын қайта бағалаудан түскен кірістер (шығындар)	- 4,15
Басқа кірістер (шығындар)	11,00
<b>Жиыны:</b>	<b>110,61</b>

### 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	01.12.2022	1 015,5889819
2	02.12.2022	1 015,5889819
3	03.12.2022	1 015,5889819
4	04.12.2022	1 015,5889819
5	05.12.2022	1 019,0252385
6	06.12.2022	1 019,0252385
7	07.12.2022	1 019,0252385
8	08.12.2022	1 019,0252385
9	09.12.2022	1 019,0252385
10	10.12.2022	1 019,0252385
11	11.12.2022	1 019,0252385
12	12.12.2022	1 017,4345353
13	13.12.2022	1 017,4345353
14	14.12.2022	1 017,4345353
15	15.12.2022	1 017,4345353
16	16.12.2022	1 017,4345353
17	17.12.2022	1 017,4345353
18	18.12.2022	1 017,4345353
19	19.12.2022	1 015,8299324
20	20.12.2022	1 015,8299324
21	21.12.2022	1 015,8299324
22	22.12.2022	1 015,8299324
23	23.12.2022	1 015,8299324
24	24.12.2022	1 015,8299324
25	25.12.2022	1 015,8299324
26	26.12.2022	1 014,4286646
27	27.12.2022	1 014,4286646
28	28.12.2022	1 014,4286646
29	29.12.2022	1 014,4286646
30	30.12.2022	1 014,4286646
31	31.12.2022	1 015,9992123

**Инвестициялық декларация параметрлерін сақтау туралы ақпарат**

Сенімгерлік басқарудағы БЖЗҚ ЗА құрылымдық үлестіруі Halyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы зейнетақы активтері есебінен қалыптастырылған қаржы құралдарының портфеліне қойылатын Инвестициялық декларация талаптарына сәйкес келеді<sup>1</sup>. Валюталық позициялар үлесі рұқсат етілген деңгей шегінде қалады және Halyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы зейнетақы активтері есебінен қалыптастырылған қаржы құралдарының портфеліне қойылатын Инвестициялық декларация талаптарын бұзбайды. 2023 жылғы 01 қаңтардағы 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	2,40%	иә
	Кері РЕПО	49,69%	иә
1	ҚР Қаржы министрлігі және ҚР ҰБ шығарған Қазақстан Республикасының мемлекеттік бағалы қағаздары, ҚР жергілікті	0,00%	иә

<sup>1</sup> Halyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы зейнетақы активтері есебінен қалыптастырылған қаржы құралдарының портфеліне Инвестициялық декларация «Halyk Global Markets» АҚ Директорлар кеңесінің шешімімен бекітілді. 2021 жылғы 18 ақпандағы №4 сырттай дауыс беру қорытындылары туралы хаттама

	атқарушы органдары шығарған борыштық бағалы қағаздар, жүз пайыз акциясы ҚР ҰБ тиесілі заңды тұлға шығарған борыштық бағалы қағаздар		
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 & Poor '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	4,38%	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
7	Шет мемлекеттердің орталық үкіметтері шығарған, мемлекеттік мәртебесі бар бағалы қағаздар	6,79%	иә
8	Шетелдік эмитенттердің акциялары және депозитарлық қолхаттары, Exchange Traded Funds (ETF), Exchange Traded Commodities (ETC), Exchange Traded Notes (ETN) пайлары	12,72%	иә
9	Шетелдік мемлекеттік емес эмитенттердің борыштық бағалы қағаздары	0,00%	иә
10	ҚР эмитенттерінің акциялары мен депозитарлық қолхаттары, басқарушы компаниясы Қазақстан Республикасының заңнамасына сәйкес құрылған заңды тұлғаның интервалды пайлық инвестициялық қорлардың пайлары	4,94%	иә
11	ҚР мемлекеттік емес эмитенттерінің борыштық бағалы қағаздары	19,07%	иә

№	Қаржы құралының түрі	Нақты мәні (зейнетақы активтеріне пайызбен)	Орындалуы (иә/жоқ)
1	Туынды қаржы құралдары, оның ішінде:	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 жөніндегі ақпарат**

**6-кесте. Есепті айда қаржы құралдарын сатып алу бойынша мәліметтер**

Құрал түрі	Валюта	Бағалы қағаз эмитенті	Мәміле құны, теңгемен
Жай акциядар	KZT	«ҚазМұнайГаз ҰК» АҚ	129 998 790
<b>Жиыны</b>			<b>129 998 790</b>

**7-кесте. Есепті айда қаржы құралдарын сату бойынша мәліметтер**

Құрал түрі	Валюта	Бағалы қағаз эмитенті	Мәміле құны, теңгемен
Есепті айда қаржы құралдарын сату жүзеге асырылмады			
<b>Жиыны</b>			

**8-кесте. Есепті айда бағалы қағаздар бойынша негізгі борышты өтеу жөніндегі мәліметтер**

Құрал түрі	Валюта	Бағалы қағаз эмитенті	Мәміле сомасы, теңгемен
Купондық Облигациялар (KFUSb33)		«Қазақстанның орнықтылық қоры» АҚ	25 000 000
Дисконттық облигациялар (НСВ№5)		"Хоум Кредит энд Финанс Банк" АҚ еншісілес банкі	100 000 000
<b>Жиыны</b>			<b>125 000 000</b>

**9-кесте. Есепті айда шетелдік банктердің салымдарына орналастыру жөніндегі мәліметтер**

Құрал түрі	Валюта	Банк атауы	Мәміле сомасы, теңгемен
Есепті айда шетелдік банктердің салымдарына орналастыру жүзеге асырылған жоқ			
<b>Жиыны</b>			

**10-кесте. Есепті айда салымдар бойынша негізгі борышты өтеу жөніндегі мәліметтер**

Құрал түрі	Валюта	Банк атауы	Өтеу сомасы, теңгемен
Есепті айда салымдар бойынша негізгі борышты өтеу жүзеге асырылған жоқ			
<b>Жиыны</b>			