

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

2021 жылғы 1 қазандағы жағдай бойынша «Сентрас Секьюритиз» АҚ (бұдан әрі - Сентрас Секьюритиз) сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ зейнетақы активтері (бұдан әрі – ЗА) 540,71 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

млн. теңге

| Атауы | 01.05.2021 ж. ағымдағы құны | 01.05.2021 ж. үлесі | 01.10.2021 ж. ағымдағы құны | 01.10.2021 ж. үлесі | 01.05.2021 ж. бастап өсуі/төмендеуі |
|---|-----------------------------------|------------------------|-----------------------------------|------------------------|---|
| ҚР ҚМ МБҚ | 267,54 | 79,31% | 463,35 | 85,69% | 73,19% |
| ҚР эмитенттерінің акциялары мен депозитарлық қолхаттары | 0,00 | 0,00% | 44,45 | 8,22% | |
| Репо | 69,06 | 20,47% | 0,00 | 0,00% | -100% |
| Инвестициялық шоттардағы ақшалай қаражат | 0,74 | 0,22% | 32,91 | 6,09% | |
| ИПБ басқаруындағы ЗА жиынтығы | 337,35 | 100% | 540,71 | 100% | 60,28% |
| Жасалған мәмілелер бойынша төлемге міндеттемелер | 0,00 | 0,00% | 0,00 | 0,00% | |
| Барлығы зейнетақы активтері | 337,35 | | 540,71 | | 60,28% |

01.10.2021 жылғы жағдай бойынша теңгеге номиналданған борыштық қаржы құралдарын өтеуге орташа алынған кірістілік (YTM) жылына 10,06% құрайды.

Инвестициялық шоттардағы ақшалай қаражат

Инвестициялық шоттардағы ақшалай қаражат қалдығы есепті кезең соңында 32,91 млн. теңгені құрады. Ақшалай қаражат үлесі есепті кезең соңында 6,09% құрады.

Қазақстан Республикасы Қаржы министрлігінің мемлекеттік бағалы қағаздары

Портфельдің негізгі үлесін алып тұрған Қазақстан Республикасы Қаржы министрлігінің мемлекеттік бағалы қағаздарының ағымдағы құны есепті ай соңында 463,35 млн. теңге болды. Олардың портфельдегі үлесі – 85,69%.

Есепті күндегі теңгемен номиналданған ҚР Қаржы министрлігінің МБҚ бойынша өтеуге орташа алынған кірістілік жылына 10,06% құрады.

Қазақстан Республикасы эмитенттерінің акциялары мен депозитарлық қолхаттары

Қазақстан Республикасы эмитенттерінің акциялары мен депозитарлық қолхаттарының ағымдағы құны есепті ай соңында 44,45 млн. теңге болды. Олардың портфельдегі үлесі – 8,22%.

Есепті кезеңде инвестициялар портфеліне «Кселл» АҚ эмитентінің қарпайым акциялары 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 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

млн. теңге

| Валюта | 01.05.2021 жылға ағымдағы құны | 01.05.2021 жылға үлесі | 01.10.2021 жылға ағымдағы құны | 01.10.2021 жылға үлесі | 01.05.2021 ж. бастап өсу/төмендеу |
|-----------------|--------------------------------|------------------------|--------------------------------|------------------------|-----------------------------------|
| Ұлттық валюта | 337,35 | 100% | 540,71 | 100% | 60,28% |
| 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% | 540,71 | 100% | 60,28% |

Инвестициялық қызметтің нәтижелері

Инвестициялық қызметтің және қаржы құралдарының нарықтық құнының өзгеруі нәтижесінде есептелген инвестициялық табыс көлемі 29,92 млн. теңгені құрады. Зейнетақы активтерінің кірістілігі 6,57% құрады.

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

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

млн. теңге

| Атауы | 2021 жылға инвестициялық кіріс |
|---|--------------------------------|
| Бағалы қағаздар бойынша, оның ішінде орналастырылған салымдар және «кері РЕПО» операциялары бойынша сыйақы түріндегі кірістер | 20,30 |
| Бағалы қағаздарды нарықтық қайта бағалаудан кірістер (шығындар) | 9,62 |
| 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: | 29,92 |

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 | 01.09.2021 | 960,8764354 |
| 2 | 02.09.2021 | 960,8764354 |
| 3 | 03.09.2021 | 960,8764354 |
| 4 | 04.09.2021 | 960,8764354 |
| 5 | 05.09.2021 | 960,8764354 |
| 6 | 06.09.2021 | 966,2492381 |
| 7 | 07.09.2021 | 966,2492381 |
| 8 | 08.09.2021 | 966,2492381 |
| 9 | 09.09.2021 | 966,2492381 |
| 10 | 10.09.2021 | 966,2492381 |
| 11 | 11.09.2021 | 966,2492381 |

| | | |
|----|------------|-------------|
| 12 | 12.09.2021 | 966,2492381 |
| 13 | 13.09.2021 | 965,9288432 |
| 14 | 14.09.2021 | 965,9288432 |
| 15 | 15.09.2021 | 965,9288432 |
| 16 | 16.09.2021 | 965,9288432 |
| 17 | 17.09.2021 | 965,9288432 |
| 18 | 18.09.2021 | 965,9288432 |
| 19 | 19.09.2021 | 965,9288432 |
| 20 | 20.09.2021 | 968,1696844 |
| 21 | 21.09.2021 | 968,1696844 |
| 22 | 22.09.2021 | 968,1696844 |
| 23 | 23.09.2021 | 968,1696844 |
| 24 | 24.09.2021 | 968,1696844 |
| 25 | 25.09.2021 | 968,1696844 |
| 26 | 26.09.2021 | 968,1696844 |
| 27 | 27.09.2021 | 966,1545728 |
| 28 | 28.09.2021 | 966,1545728 |
| 29 | 29.09.2021 | 966,1545728 |
| 30 | 30.09.2021 | 966,7408498 |

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 қыркүйектегі 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 | Қаулыға сай басқа елдердің шетелдік валютасы (KZT) | 6,09% | 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 | 85,69% | 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 |

| | | | |
|----|--|-------|-----------|
| | | | иә |
| 9 | <p>Standard & Poor's (Стандард 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:</p> <p>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).</p> | 0,00% | |
| 10 | Қаулыға сай шетелдік мемлекеттердің үкіметтері шығарған мемлекеттік мәртебесі бар БҚ | 0,00% | иә |
| 11 | <p>Шетелдік ұйымдар шығарған мемлекеттік емес БҚ:</p> <p>*Standard & Poor's (Стандард 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;</p> <p>*негізгі қор индекстері құрамына кіретін шетелдік эмитенттердің акциялары және осы акциялар базалық активі болып табылатын депозитарлық қолхаттар;</p> <p>* борыштық БҚ</p> <p>Standard & Poor's (Стандард 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</p> | 0,00% | иә |
| 12 | Қаулыға сай ҚР және басқа мемлекеттердің заңнамасына сәйкес ҚР ұйымдары шығарған мемлекеттік емес БҚ | 8,22% | 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

| Құрал түрі | Валюта | Бағалы қағаз эмитенгі | Теңгемен номинал құны |
|--------------------|---------------|------------------------------|------------------------------|
| Қарапайым акциялар | KZT | "Кселл" АҚ | 9 014 562,00 |
| Жиыны | | | 9 014 562,00 |