

БЖЗҚ» АҚ Зейнетақы активтерін инвестициялық басқару бойынша ақпарат

2022 жылғы 1 сәуірдегі жағдай бойынша «Halyk Global Markets» АҚ басқаруындағы (бұдан әрі – Halyk Global Markets) БЖЗҚ зейнетақы активтері (бұдан әрі – ЗА) **2 423,96** млн. теңгені құрады.

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

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

Атауы	01.01.2022 жылға ағымдағы құны	01.01.2022 жылға үлесі	01.04.2022 жылға ағымдағы құны	01.04.2022 жылға үлесі	01.01.2022 ж. бастап өсуі/төмендеуі
Кері Репо (90 күнтізбелік күннен артық емес)	892,98	43,33%	1 083,08	44,68%	21,29%
ҚРҰБ ноталары	0	0,00%	0	0,00%	
ҚР екінші денгейдегі банктерінің облигациялары	155,3	7,54%	157,26	6,49%	1,27%
ХҚҰ	120,2	5,83%	123,35	5,09%	2,62%
Шетелдік эмитенттердің үлестік құралдары (ETF пайлары)	288,4	13,99%	454,22	18,74%	57,50%
Шетелдік эмитенттердің акциялары және депозитарлық қолхаттары	180,38	8,75%	184,78	7,62%	2,44%
Шоттардағы ақшалай қаражат	1,02	0,05%	1,32	0,05%	28,89%
ҚР ұйымдарының корпоративтік облигациялары	125,67	6,10%	122,37	5,05%	-2,63%
Басқа активтер (дебиторлық берешек, мерзімі өткен берешек, провизиялар)	0,38	0,02%	1,08	0,04%	185,14%
ҚР квазимемлекеттік ұйымдарының облигациялары	296,51	14,39%	296,51	12,23%	0,00%
<i>Halyk Global Markets басқаруындағы ЗА жиынтығы</i>	2 060,84		2 423,96		17,62%
Жасалған мәмілелер	0		0		

млн. теңге

бойынша төлеуге міндеттемелер					
Зейнетақы активтерінің жиынтығы	2 060,84	100,00%	2 423,96	100,00%	17,62%

01.04.2022 ж. жағдай бойынша теңгеде номиналданған Halyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфеліндегі борыштық қаржы құралдарының және кері Repo операцияларының орташа алынған кірістілігі жылдық 12,48%-ды құрады.

Кері Repo операциялары (90 күнтізбелік күннен артық емес)

Halyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ за инвестициялық портфелінде кері Repo операциялары бар, олардың ағымдағы құны есепті айда 157,21 млн теңгеге өсіп, 1 083,08 млн теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 44,68%-ды құрады. Halyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы, теңгеде номиналданған БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфеліндегі кері Repo операцияларының орташа алынған кірістілігі есепті күнге жылдық 13,96%-ды құрады.

Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банктерінің облигациялары

Сонымен қатар, Halyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфелінде Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банктерінің облигациялары бар, олардың ағымдағы құны есепті айда 1,51 млн теңгеге артып, 157,26 млн теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 6,49%-ды құрады.

Halyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфеліндегі Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банктерінің теңгеде номиналданған борыштық бағалы қағаздарын өтеуге орташа алынған кірістілігі есепті күнге жылдық 9,70% - ды құрады.

Халықаралық қаржы ұйымдарының облигациялары

Есепті айда халықаралық қаржы ұйымдары облигацияларының ағымдағы құны 1,05 млн теңгеге артып, 123,35 млн теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 5,09%-ды құрады.

Халықаралық қаржы ұйымдарының облигациялары бойынша өтеуге, теңгеде номиналданған, орташа алынған кірістілік, белгіленген сыйақы мөлшерлемесімен жылдық 11,70%-ды құрады.

Шетелдік эмитенттердің үлестік құралдары (ETF пайлары)

Сондай-ақ, Halyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфелінде шетелдік эмитенттердің үлестік құралдары (ETF пайлары) бар, олардың ағымдағы құны есепті айда 4,59 млн. теңгеге артып, 454,22 млн. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 18,74%-ды құрады.

Қазақстан Республикасы эмитенттерінің корпоративтік облигациялары

Бұған қоса, Halyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфелінде ҚР эмитенттерінің корпоративтік облигациялары бар, олардың ағымдағы құны есепті айда 1,10 млн теңгеге артып, 122,37 млн теңгені құраған. Олардың портфельдегі үлесі 5,05%-ды құрады.

Halyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы ҚР эмитенттерінің БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфеліндегі теңгеде номиналданған, корпоративтік облигацияларын өтеуге орташа алынған кірістілік есепті күнге жылдық 11,01%-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 8,22 млн теңгеге азайып, 184,78 млн теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 7,62%-ды құрады.

Қазақстан Республикасының квазимемлекеттік ұйымдарының облигациялары

Сонымен қатар, Halyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфелінде ҚР квазимемлекеттік ұйымдарының облигациялары бар, олардың ағымдағы құны есепті айда 2,38 млн теңгеге артып, 296,51 млн теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 12,23%-ды құрады.

Halyk Global Markets-тің сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфеліндегі ҚР квазимемлекеттік ұйымдарының облигацияларын, теңгеде номиналданған, өтеуге орташа алынған кірістілік есепті күнге жылдық 9,72%-ды құрады.

Валюталық құрылым

Halyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы зейнетақы активтері есебінен сатып алынған қаржы құралдары номиналданған валюталар бөлінісінде 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

Валюта	01.01.2022 жылға ағымдағы құны	01.01.2022 жылға үлесі	01.04.2022 ж. ағымдағы құны	01.04.2022 жылға үлесі	01.01.2022 ж. бастап өсуі/төмендеуі
Ұлттық валюта	1 591,16	77,21%	1 783,79	73,59%	12,11%
АҚШ доллары	469,68	22,79%	640,17	26,41%	36,30%
Жиынтығы:	2 060,84	100,00%	2 423,96	100,00%	17,62%

млн. теңге

Инвестициялық қызмет нәтижелері

Инвестициялық қызметтің нәтижесінде, есептелген инвестициялық табыс мөлшері (активтерді берген сәттен бастап 2022 жылғы 01 сәуірдегі жағдай бойынша) 206,77 млн теңгені және есептелген инвестициялық табыс мөлшері (2022 жылғы 01 қаңтардан бастап 2022 жылғы 01 сәуірдегі жағдай бойынша) 93,98 млн теңгені құрады. Зейнетақы активтерінің кірістілігі қызмет басынан бері 12,79%-ды және 2022 жылдың басынан 4,04%-ды құрады.

Есептелген инвестициялық табыстың құрылымы 3-кестеде көрсетілген.

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

Атауы	2022 жыдың басынан бастап инвестициялық табыс
Бағалы қағаздар бойынша, оның ішінде орналастырылған салымдар және «кері РЕПО» операциялары бойынша сыйақы түріндегі табыстар	47,15
Бағалы қағаздарды нарықтық қайта бағалаудан түскен кірістер (шығындар)	46,73
Шетел валюталарын қайта бағалаудан түскен кірістер (шығындар)	1,50
Басқа кірістер (шығындар)	-1,40

млн. теңге

Шартты бірліктің құны туралы ақпарат

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

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

№	Күні	Бір шартты бірліктің құны
1	01.03.2022	1 008,8010325
2	02.03.2022	1 008,8010325
3	03.03.2022	1 008,8010325
4	04.03.2022	1 008,8010325
5	05.03.2022	1 008,8010325
6	06.03.2022	1 008,8010325
7	07.03.2022	1 008,8010325
8	08.03.2022	1 008,8010325
9	09.03.2022	1 000,2979092
10	10.03.2022	1 000,2979092
11	11.03.2022	1 000,2979092
12	12.03.2022	1 000,2979092
13	13.03.2022	1 000,2979092
14	14.03.2022	1 003,7380346
15	15.03.2022	1 003,7380346
16	16.03.2022	1 003,7380346
17	17.03.2022	1 003,7380346
18	18.03.2022	1 003,7380346
19	19.03.2022	1 003,7380346
20	20.03.2022	1 003,7380346
21	21.03.2022	1 003,7380346
22	22.03.2022	1 003,7380346
23	23.03.2022	1 003,7380346
24	24.03.2022	1 013,1179087
25	25.03.2022	1 013,1179087
26	26.03.2022	1 013,1179087
27	27.03.2022	1 013,1179087
28	28.03.2022	1 013,8980680
29	29.03.2022	1 013,8980680
30	30.03.2022	1 013,8980680
31	31.03.2022	1 014,5264910

Инвестициялық декларация параметрлерін сақтау туралы ақпарат

Сенімгерлік басқарудағы БЖЗҚ ЗА құрылымдық үлестіруі Налык Global Markets сенімгерлік басқаруындағы зейнетақы активтері есебінен қалыптастырылған қаржы құралдарының портфеліне қойылатын Инвестициялық декларация талаптарына сәйкес келеді¹. Валюталық позициялар үлесі рұқсат етілген деңгей шегінде қалады және Налык Global Markets сенімгерлік басқаруындағы зейнетақы активтері есебінен қалыптастырылған қаржы құралдарының портфеліне қойылатын Инвестициялық декларация талаптарын бұзбайды. 2022 жылғы 01 сәуірдегі жағдай бойынша инвестициялау лимиттерін сақтау туралы деректер 5-кестеде көрсетілген.

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

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	0,10%	иә
	Кері РЕПО	44,68%	иә
1	ҚР Қаржы министрлігі және ҚР ҰБ шығарған Қазақстан Республикасының мемлекеттік бағалы қағаздары, ҚР жергілікті атқарушы органдары 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	0,00%	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	5,09%	иә
7	Шет мемлекеттердің орталық үкіметтері шығарған, мемлекеттік 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	26,36%	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	0,00%	иә
11	ҚР мемлекеттік емес эмитенттерінің борыштық бағалы қағаздары	23,77%	иә

№	Қаржы құралының түрі	Нақты мәні (зейнетақы активтерінен 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	Күймадағы және металл шоттардағы алтын	0,00%	иә
-----	--	-------	----