

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

2024 жылғы 1 тамыздағы жағдай бойынша «Сентрас Секьюритиз» АҚ (бұдан әрі – Сентрас Секьюритиз) сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ зейнетақы активтері (бұдан әрі – ЗА) 1 363,33 млн. теңгені құрап отыр.

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

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

Атауы	01.01.2024 жылға ағымдағы құны	01.01.2024 жылға үлесі	01.08.2024 жылға ағымдағы құны	01.08.2024 жылға үлесі	Жыл басынан бергі өсу/төмендеу
ҚР ҚМ МБҚ	346,86	33,89%	342,93	25,15%	-1,13%
ҚР квазимемлекеттік ұйымдарының облигациялары	197,07	19,25%	191,53	14,05%	-2,81%
ҚР ЕДБ облигациялары	168,85	16,50%	121,66	8,92%	-27,95%
ҚР эмитенттерінің корпоративтік облигациялары	-	-	103,40	7,58%	-
ҚР эмитенттерінің акциялары мен депозитарлық қолхаттары	83,98	8,21%	147,30	10,80%	75,39%
Шетелдік эмитенттердің үлестік құралдары (ETF пайлары)	9,48	0,93%	9,84	0,72%	3,84%
Шетелдік эмитенттердің акциялары мен депозитарлық қолхаттары	21,86	2,14%	45,25	3,32%	107,03%
АҚШ мемлекеттік облигациялары	81,04	7,92%	108,13	7,93%	33,43%
Кері Репо	88,07	8,60%	237,03	17,39%	169,13%
Басқа активтер (дебиторлық берешек, мерзімі өткен берешек, провизиялар)	-	-	0,31	0,02%	-
Инвестициялық шоттардағы ақшалай қаражат	26,33	2,57%	55,94	4,10%	112,43%
ИПБ басқаруындағы ЗА жиынтығы	1 023,54	100,00%	1 363,33	100,00%	33,20%
Жасалған мәмілелер бойынша төлемге міндеттемелер	-	-	0,00	0,00%	-
Зейнетақы активтерінің жиынтығы	1 023,54	-	1 363,33	-	33,20%

01.08.2024 жылғы жағдай бойынша борыштық қаржы құралдарын өтеуге орташа алынған кірістілік (ҮТМ) – жылына 11,65%.

Инвестициялық шоттардағы ақшалай қаражат және кері РЕПО операциялары

Есепті кезең соңындағы инвестициялық шоттардағы ақшалай қаражат қалдығы – 55,94 млн. теңге. Олардың портфельдегі үлесі – 4,10%. Есепті кезең соңындағы РЕПО операциялары бойынша ақшалай қаражат қалдығы – 237,03 млн. теңге. Олардың портфельдегі үлесі – 17,39%. Есепті кезеңдегі кері РЕПО операцияларының орташа өлшенген кірістілігі – жылына 14,36%.

Қазақстан Республикасы Қаржы министрлігінің мемлекеттік бағалы қағаздары

Портфельдің негізгі үлесін алып тұрған Қазақстан Республикасы Қаржы министрлігінің мемлекеттік бағалы қағаздарының ағымдағы құны есепті ай соңында 342,93 млн. теңге болды. Олардың портфельдегі үлесі – 25,15%. Есепті күндегі теңгемен номиналданған ҚР Қаржы министрлігінің МБҚ бойынша өтеуге орташа алынған кірістілік – жылына 12,94%.

Қазақстан Республикасының квазимемлекеттік ұйымдарының облигациялары

Есепті күндегі Қазақстан Республикасының квазимемлекеттік ұйымдарының облигациялары бойынша өтелуі тиіс орташа өлшенген кірістілік – АҚШ долларымен жылына 5,89% және теңгемен жылына 14,10%. Қазақстан Республикасының квазимемлекеттік ұйымдары облигацияларының ағымдағы құны есепті ай соңында 191,53 млн. теңге болып отыр. Олардың портфельдегі үлесі – 14,05%.

ҚР ЕДБ облигациялары

Есепті күндегі облигациялар бойынша өтелуі тиіс орташа өлшенген кірістілік – жылына 11,32%. Есепті ай соңында облигациялардың ағымдағы құны 90,08 млн. теңге болды. Олардың портфельдегі үлесі – 8,92%.

Есепті кезеңде АО «Home Credit Bank» АҚ купондық облигацияларын сатып алу бойынша мәміле жасалды.

ҚР эмитенттерінің корпоративтік облигациялары

Есепті күндегі облигациялар бойынша өтелуі тиіс орташа алынған кірістілік – жылына 17,17%. Облигациялардың ағымдағы құны есепті ай соңында 103,40 млн. теңге болды. Олардың портфельдегі үлесі – 7,58%.

Қазақстан Республикасы эмитенттерінің акциялары мен депозитарлық қолхаттары

Қазақстан Республикасы эмитенттерінің акциялары мен депозитарлық қолхаттарының ағымдағы құны есепті ай соңында 147,30 млн. теңге болды. Олардың портфельдегі үлесі – 10,80%.

Есепті кезеңде «KEGOC» АҚ акцияларын сатып алу бойынша мәміле жасалды.

АҚШ мемлекеттік облигациялары

Есепті кезеңде US Treasury қазынашылық міндеттемелерін сатып алу жүзеге асырылды. Есепті айдың соңындағы ағымдағы құн – 108,13 млн. теңге. Олардың портфельдегі үлесі – 7,93%. Есепті күндегі АҚШ мемлекеттік облигациялары бойынша өтелуі тиіс орташа өлшенген кірістілік – АҚШ долларымен жылына 5,41%.

Шетелдік эмитенттердің үлестік құралдары (ETF пайлары)

Шетелдік эмитенттердің үлестік құралдарының (ETF пайлары) ағымдағы құны есепті ай соңында 9,84 млн. теңге болды. Олардың портфельдегі үлесі – 0,72%.

Шетелдік эмитенттердің акциялары мен депозитарлық қолхаттары

Есепті айдың соңында шетелдік эмитенттердің акциялары мен депозитарлық қолхаттарының ағымдағы құны 42,25 млн. теңге болды. Олардың портфельдегі үлесі – 3,32%.

Валюталық құрылым

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

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

млн теңге

Валюта	01.01.2024 жылғы ағымдағы құны	01.01.2024 жылғы үлесі	01.08.2024 жылғы ағымдағы құны	01.08.2024 жылғы үлесі	Жыл басынан бергі өсу/төмендеу
Ұлттық валюта	759,45	74,20%	991,39	72,72%	30,54%
АҚШ доллары	242,24	23,67%	349,95	25,67%	44,47%
Канада доллары	21,86	2,14%	21,99	1,61%	0,58%
Жиыны:	1 023,54	100%	1 363,33	100%	33,20%

Инвестициялық қызмет нәтижесі

Инвестициялық қызметтің және қаржы құралдарының нарықтық құнының өзгеруі нәтижесінде 2024 жыл басынан бері есептелген инвестициялық табыс мөлшері 111,43 млн. теңге болды. 2024 жыл басынан бергі зейнетақы активтерінің кірістілігі 9,05% 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	2024 жылғы инвестициялық табыс
Бағалы қағаздар бойынша, оның ішінде орналастырылған салымдар және «кері РЕПО» операциялары бойынша сыйақы түріндегі табыс	82,10
Бағалы қағаздарды нарықтық қайта бағалаудан түскен табыс (шығын)	18,46
Шетелдік валютаны қайта бағалаудан түскен табыс (шығын)	11,44
Басқа активтерді қайта бағалаудан түскен табыс (шығын) (БҚҚ)	0,00
Сыртқы басқарудағы активтер бойынша табыс (шығын)	0,00
Басқа табыс (шығын)	-0,57
Жиыны:	111,43

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	01.07.2024	1 244,1191894
2	02.07.2024	1 244,1191894
3	03.07.2024	1 244,1191894
4	04.07.2024	1 244,1191894
5	05.07.2024	1 244,1191894
6	06.07.2024	1 244,1191894
7	07.07.2024	1 244,1191894
8	08.07.2024	1 244,1191894
9	09.07.2024	1 251,3688099
10	10.07.2024	1 251,3688099
11	11.07.2024	1 251,3688099
12	12.07.2024	1 251,3688099
13	13.07.2024	1 251,3688099

14	14.07.2024	1 251,3688099
15	15.07.2024	1 246,1946044
16	16.07.2024	1 246,1946044
17	17.07.2024	1 246,1946044
18	18.07.2024	1 246,1946044
19	19.07.2024	1 246,1946044
20	20.07.2024	1 246,1946044
21	21.07.2024	1 246,1946044
22	22.07.2024	1 244,1621768
23	23.07.2024	1 244,1621768
24	24.07.2024	1 244,1621768
25	25.07.2024	1 244,1621768
26	26.07.2024	1 244,1621768
27	27.07.2024	1 244,1621768
28	28.07.2024	1 244,1621768
29	29.07.2024	1 246,0779209
30	30.07.2024	1 246,0779209
31	31.07.2024	1 246,6969166

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. 2024 жылғы 1 тамыздағы 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)	1,17%	иә
2	Қаулыға сай басқа елдердің шетелдік валютасы	2,95%	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	25,15	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	7,17%	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 (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: Азиялық даму банкі (the Asian Development Bank); Америкалық даму банкі (the Inter-American Development Bank);	0,00%	иә

	<p>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>		
10	Қаулыға сай шетелдік мемлекеттердің үкіметтері шығарған мемлекеттік мәртебесі бар БҚ	7,93%	иә
11	<p>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; * 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 борыштық БҚ</p>	3,32%	иә
12	Қаулыға сай ҚР және басқа мемлекеттердің заңнамасына сәйкес ҚР ұйымдары шығарған мемлекеттік емес БҚ	51,58%	иә
13	Қаулыға сай Exchange Traded Funds (Эксчейндж Трэдэд Фандс), Exchange, Traded Commodities (Эксчейндж Трэдэд Коммодитис), Exchange Traded Notes (Эксчейндж Трэдэд Ноутс) пайлары	0,72%	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 құны
қазынашылық міндеттемелер	USD	US Treasury	108 090 028,05
қарапайым акциялар	KZT	«KEGOC» АҚ	22 263 917,52
купондық облигациялар	KZT	«Home Credit Bank» АҚ	30 332 760,00
Жиыны			160 686 705,57

7-кесте. Есепті айдағы қаржы құралдарын сату бойынша мәлімет

Құрал түрі	Валюта	Бағалы қағаз эмитенті	Теңгемен мәміле сомасы
Жиыны			-

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

Құрал түрі	Валюта	Бағалы қағаз эмитенті	Теңгемен мәміле сомасы
Жиыны			-

9-кесте. Есепті айдағы шетелдік банктердегі салымдарға орналастыру бойынша мәлімет

Құрал түрі	Валюта	Банк атауы	Теңгемен мәміле сомасы
Есепті айда шетелдік банктердегі салымдарға орналастыру болған жоқ			
Жиыны			-

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

Құрал түрі	Валюта	Банк атауы	Теңгемен мәміле сомасы
Есепті айда салымдар бойынша негізгі борышты өтеу болған жоқ			
Жиыны			-