

«БЖЗҚ» АҚ ЗЕЙНЕТАҚЫ АКТИВТЕРІН ИНВЕСТИЦИЯЛЫҚ БАСҚАРУ БОЙЫНША АҚПАРАТ

2021 жылғы 01 тамыздағы жағдай бойынша «Halyk Global Markets» АҚ басқаруындағы (бұдан әрі – Halyk Global Markets) БЖЗҚ зейнетақы активтері (бұдан әрі – ЗА) 1 335,80 млн. теңгені құрады.

Halyk Global Markets басқаруындағы зейнетақы активтерінің есебінен құрылған қаржы құралдарының инвестициялық портфелінің құрылымы 1-кестеде көрсетілген.

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

| Атауы | 01.04.2021 жылға ағымдағы құны | 01.04.2021 жылға үлесі | 01.08.2021 жылға ағымдағы құны | 01.08.2021 жылға үлесі | 01.04.2021 ж. бастап өсуі/төмендеуі |
|--|--------------------------------|------------------------|--------------------------------|------------------------|-------------------------------------|
| Кері Репо (90 күнтізбелік күннен артық емес) | 500,46 | 99,50% | 179,05 | 13,40% | -64,22% |
| ҚР ноталары | 0 | 0,00% | 477,53 | 35,75% | - |
| ҚР екінші деңгейдегі банктердің облигациялары | 0 | 0,00% | 49,69 | 3,72% | - |
| Шетелдік эмитенттердің үлестік құралдары (ETF пайлары) | 0 | 0,00% | 259,02 | 19,39% | - |
| Шоттардағы ақшалай қаражат | 2,51 | 0,50% | 51,48 | 3,85% | 1947,72% |
| ҚР эмитенттерінің корпоративтік облигациялары | 0 | 0,00% | 120,26 | 9,00% | - |
| Шетелдік эмитенттердің акциялары мен депозитарлық қолхаттары | 0 | 0 | 99,18 | 7,42% | |
| ҚР квазимемлекеттік ұйымдарының облигациялары | 0 | 0,00% | 99,59 | 7,46% | - |
| Halyk Global Markets басқаруындағы ЗА жиынтығы | 502,97 | 100,00% | 1 335,80 | 100,00% | 165,58% |
| Жасалған мәмілелер бойынша төлемге міндеттемелер | 0,00 | 0,00% | 0 | 0,00% | |
| Зейнетақы активтерінің жиынтығы | 502,97 | | 1 335,80 | | 165,58% |

01.08.2021 ж. жағдай бойынша теңгеге номинирленген Halyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфеліндегі борыштық қаржы құралдарының және кері Репо операцияларының орташа алынған кірістілігі жылдық 9,41 % - ды құрады.

Кері Репо операциялары (90 күнтізбелік күннен артық емес)

Halyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфелінде кері Репо операциялары бар, олардың ағымдағы құны есепті айда 570,24 млн.теңгеге азайып, 179,05 млн. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 13,40 %-ды құрады. Теңгеге номинирленген Halyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфеліндегі кері Репо операцияларының орташа алынған кірістілігі есепті күнге жылдық 8,80% -ды құрады.

Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкі ноталары

Halyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфеліндегі негізгі үлесті ағымдағы құны есепті айда 477,53 млн.теңгені құраған Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкінің ноталары алады. Олардың портфельдегі үлесі 35,75 %-ды құрады.

Есепті кезеңде жылдық 8,90% мөлшеріндегі табыстылығымен 300,00 млн. теңге көлемінде Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкінің ноталары сатып алынды. Halyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы, БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфеліндегі Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкінің ноттарын өтеуге орташа алынған кірістілік есепті күнге теңгеге номинирленген жылдық 8,98% -ды құрады.

Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банктерінің облигациялары

Бұған қосымша, Halyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфелінде борыштық бағалы қағаздар, Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банктерінің облигациялары бар, олардың ағымдағы құны есепті айда 2,14 млн теңгеге азайып, 49,69 млн теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 3,72 % -ды құрады.

Halyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфеліндегі Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банктерінің теңгеге номинирленген борыштық бағалы қағаздарын өтеуге орташа алынған кірістілігі есепті күнге жылдық 10,52%-ды құрады.

Шетелдік эмитенттердің үлестік құралдары (ETF пайлары)

Сондай-ақ, Halyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфелінде шетелдік эмитенттердің үлестік құралдары бар, олардың ағымдағы құны есепті айда 107,52 млн.теңгеге артып, 259,02 млн.теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 19.39%-ды құрады.

Есепті кезеңде жалпы сомасы 64,89 млн. теңгеге Vanguard S&P 500 ETF, жалпы сомасы 24,63 млн. теңгеге Energy Select Sector SPDR Fund, жалпы сомасы 64,62 млн. теңгеге SPDR S&P 500 ETF биржалық инвестициялық қорларының акцияларын сатып алу жүзеге асырылды.

Сондай-ақ есепті кезеңде iShares 3-7 Year Treasury Bond ETF биржалық инвестициялық қорының акцияларын жалпы сомасы 49,35 млн.теңгеге сату жүзеге асырылды.

ҚР эмитенттерінің корпоративтік облигациялары

Сонымен қатар, Halyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфелінде ҚР эмитенттерінің корпоративтік облигациялары бар, олардың ағымдағы құны есепті айда 120,26 млн теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 9,00% -ды құрады.

Есепті кезеңде жылдық 11,00% мөлшеріндегі табыстылығымен 120,00 млн. теңге көлемінде "Тойота Файнэншл Сервисез Қазақстан "МҚҰ" ЖШС облигацияларын сатып алу жүзеге асырылды.

Halyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы ҚР эмитенттерінің БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфеліндегі теңгемен номиналданған корпоративтік облигацияларын өтеуге орташа алынған кірістілік есепті күнге жылдық 11,00%-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 99,18 млн. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 7,42% -ды құрады.

Есепті кезеңде жалпы сомасы 101,06 млн теңгеге CITIGROUP INC. шетелдік эмитенттерінің акцияларын сатып алу жүзеге асырылды.

ҚР квазимемлекеттік ұйымдарының облигациялары

Сонымен қатар, Halyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфелінде ҚР квазимемлекеттік ұйымдарының облигациялары бар, олардың ағымдағы құны есепті айда 99,59 млн теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 7,46% -ды құрады.

Есепті кезеңде жылдық 10,09% мөлшеріндегі табыстылығымен 100,32 млн. теңге көлемінде "Қазақстанның орнықтылық қоры" АҚ облигацияларын сатып алу жүзеге асырылды. Halyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы ҚР квазимемлекеттік ұйымдарының БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфеліндегі теңгемен номиналданған облигацияларын өтеуге орташа алынған кірістілік есепті күнге жылдық 10,09%-ды құрады.

Валюталық құрылым

Halyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы зейнетақы активтерінің есебінен сатып алынған қаржы құралдары номиналданған валюталар бөлігінде 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 | <i>млн. теңге</i> | | | | |
|------------------|--------------------------------|------------------------|-----------------------------|---------------------|-------------------------------------|
| | 01.04.2021 жылға ағымдағы құны | 01.04.2021 жылға үлесі | 01.08.2021 ж. ағымдағы құны | 01.08.2021 ж. үлесі | 01.04.2021 ж. бастап өсуі/төмендеуі |
| Ұлттық валюта | 502,97 | 100% | 928,09 | 69,48% | 84,52% |
| АҚШ доллары | 0 | 0,00% | 407,71 | 30,52% | - |
| Жиынтығы: | 502,97 | 100,00% | 1 335,80 | 100,00% | 165,58% |

Инвестициялық қызметтің нәтижелері

Инвестициялық қызметтің нәтижесінде, есептелген инвестициялық табыс мөлшері (қызмет басталғаннан бастап 2021 жылғы 01 тамыздағы жағдай бойынша) 28,54 млн. теңгені құрады. Зейнетақы активтерінің табыстылығы 2,96 %-ды құрады.

Есептелген инвестициялық табыстың құрылымы 3-кестеде көрсетілген.

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

| Атауы | <i>млн. теңге</i> |
|---|--|
| | Есептік кезең үшін инвестициялық табыс |
| Бағалы қағаздар бойынша, оның ішінде орналастырылған салымдар және «кері РЕПО» операциялары бойынша сыйақы түріндегі табыстар | 25,07 |
| Бағалы қағаздарды нарықтық қайта бағалаудан түскен кірістер (шығындар) | 4,65 |
| Шетел валюталарын қайта бағалаудан түскен кірістер (шығындар) | -0,01 |
| Басқа кірістер (шығындар) | -1,17 |
| Жиынтығы: | 28,54 |

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

| № | датасы | Бір шартты бірліктің құны |
|----|------------|---------------------------|
| 1 | 01.07.2021 | 920,3713341 |
| 2 | 02.07.2021 | 920,3713341 |
| 3 | 03.07.2021 | 920,3713341 |
| 4 | 04.07.2021 | 920,3713341 |
| 5 | 05.07.2021 | 920,3713341 |
| 6 | 06.07.2021 | 920,3713341 |
| 7 | 07.07.2021 | 922,8344461 |
| 8 | 08.07.2021 | 922,8344461 |
| 9 | 09.07.2021 | 922,8344461 |
| 10 | 10.07.2021 | 922,8344461 |
| 11 | 11.07.2021 | 922,8344461 |
| 12 | 12.07.2021 | 924,6363986 |
| 13 | 13.07.2021 | 924,6363986 |
| 14 | 14.07.2021 | 924,6363986 |
| 15 | 15.07.2021 | 924,6363986 |
| 16 | 16.07.2021 | 924,6363986 |
| 17 | 17.07.2021 | 924,6363986 |
| 18 | 18.07.2021 | 924,6363986 |
| 19 | 19.07.2021 | 922,9391767 |

| | | |
|----|------------|-------------|
| 20 | 20.07.2021 | 922,9391767 |
| 21 | 21.07.2021 | 922,9391767 |
| 22 | 22.07.2021 | 922,9391767 |
| 23 | 23.07.2021 | 922,9391767 |
| 24 | 24.07.2021 | 922,9391767 |
| 25 | 25.07.2021 | 922,9391767 |
| 26 | 26.07.2021 | 925,8644655 |
| 27 | 27.07.2021 | 925,8644655 |
| 28 | 28.07.2021 | 925,8644655 |
| 29 | 29.07.2021 | 925,8644655 |
| 30 | 30.07.2021 | 925,8644655 |
| 31 | 31.07.2021 | 926,1378106 |

Инвестициялық декларация параметрлерін сақтау туралы ақпарат

Сенімгерлік басқарудағы БЖЗҚ ЗА құрылымдық үлестіруі Halyk Global Markets¹ сенімгерлік басқаруындағы зейнетақы активтері есебінен қалыптастырылған қаржы құралдарының портфеліне Инвестициялық декларацияның талаптарына сәйкес келеді. Валюталық позициялар үлесі рұқсат етілген деңгей шегінде қалады және Halyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы зейнетақы активтері есебінен қалыптастырылған қаржы құралдарының портфеліне Инвестициялық декларацияның талаптарын бұзбайды. 2021 жылғы 01 маусымдағы 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 | 3,91% | иә |
| | Кері РЕПО | 13,40% | иә |
| 1 | ҚР Қаржы министрлігі және ҚР ҰБ шығарған Қазақстан Республикасының мемлекеттік бағалы қағаздары, ҚР жергілікті атқарушы органдар шығарған борыштық бағалы қағаздар, жүз пайыз акциясы ҚР ҰБ тиесілі заңды тұлға шығарған борыштық бағалы қағаздар | 43,21% | 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 | Қазақстан Республикасының екінші деңгейлі банктеріндегі салымдар | 0,00% | иә |
| 4 | Резидент емес банктердегі салымдар | 0,00% | иә |
| 5 | Халықаралық қаржы ұйымдары шығарған борыштық бағалы қағаздар | 0,00% | иә |
| 6 | Шетелдік мемлекеттердің орталық үкіметтері шығарған мемлекеттік деген мәртебесі бар бағалы қағаздар | 0,00% | иә |
| 7 | Шетелдік эмитенттердің акциялары және депозитарлық қолхаттары, Exchange Traded Funds (ETF), Exchange Traded Commodities (ETC), Exchange Traded Notes (ETN) пайлары | 26,76% | иә |
| 8 | Шетелдік мемлекеттік емес эмитенттердің борыштық бағалы қағаздары | 0,00% | иә |
| 9 | ҚР эмитенттерінің акциялары және депозитарлық қолхаттары, басқарушы компаниясы Қазақстан Республикасының заңнамасына сәйкес құрылған заңды тұлғаның интервалды пайлық инвестициялық қорлардың пайлары | 0,00% | иә |
| 10 | ҚР мемлекеттік эмитенттерінің борыштық бағалы қағаздары | 9,00% | иә |

| № | Қаржы құралының түрі | Нақты мәні (зейнетақы активтерінен пайызбен) | Орындалуы (иә/жоқ) |
|-----|--|--|--------------------|
| 1 | Туынды қаржы құралдары, олардың: | 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 «Halyk Global Markets» АҚ Директорлар кеңесінің 2021 жылғы 18 ақпандағы №4 сырттай дауыс берудің қорытындылары туралы хаттамамен бекітілген Halyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы зейнетақы активтері есебінен қалыптастырылған қаржы құралдарының портфеліне Инвестициялық декларация

| | | | |
|-----|--|-------|----|
| 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 бойынша ақпарат

6-кесте. Есептік айда қаржы құралдарын сатып алу бойынша мәлімет

| Құрал түрі | Валюта | Бағалы қағаз эмитенті | Номиналды құны теңгемен |
|--|--------|---|-------------------------|
| Ноталар | KZT | Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкі | 300 000 000,00 |
| Облигациялар | KZT | "Тойота Файнаншл Сервисез Қазақстан" МКҰ» ЖШС | 120 000 000,00 |
| Биржалық инвестициялық қорлардың акциялары (пайлары) | USD | Vanguard S&P 500 ETF | 64 892 594,30 |
| Акциялар | USD | CITIGROUP INC | 101 061 234, 90 |
| Биржалық инвестициялық қорлардың акциялары (пайлары) | USD | SPDR S&P 500 ETF TRUST | 64 622 736,94 |
| Биржалық инвестициялық қорлардың акциялары (пайлары) | USD | Energy Select Sector SPDR Fund | 24 628 567,57 |
| Облигациялар | KZT | Қазақстанның орнықтылық қоры | 100 319 000,00 |
| Жиынтығы | | | 775 524 133,71 |

7-кесте. Есепті айда қаржы құралдарын сату бойынша мәлімет

| Құрал түрі | Валюта | Бағалы қағаз эмитенті | Мәміле сомасы теңгемен |
|--|--------|---|------------------------|
| Биржалық инвестициялық қорлардың акциялары (пайлары) | USD | iShares 3-7 Year Treasury ETF (эмитент – Blackrock) | 49 350 145,01 |
| Жиынтығы | | | 49 350 145,01 |