

«БЖЗҚ» АҚ ЗЕЙНЕТАҚЫ АКТИВТЕРІН ИНВЕСТИЦИЯЛЫҚ БАСҚАРУ БОЙЫНША АҚПАРАТ

2021 жылғы 01 қазандағы жағдай бойынша «Halyk Global Markets» АҚ басқаруындағы (бұдан әрі – Halyk Global Markets) БЖЗҚ зейнетақы активтері (бұдан әрі – ЗА) 1 526, 54 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

Наименование	<i>млн. теңге</i>				
	01.04.2021 жылға ағымдағы құны	01.04.2021 жылға үлесі	01.10.2021 жылға ағымдағы құны	01.10.2021 жылға үлесі	01.04.2021 ж. бастап өсуі/төмендеуі
Кері Репо (90 күнтізбелік күннен артық емес)	500,46	99,50%	142,03	9,30%	-71,62%
ҚР ноттары	0	0,00%	318,39	20,86%	-
ҚР екінші деңгейдегі банктердің облигациялары	0	0,00%	154,06	10,09%	-
МФО	0	0,00%	120,32	7,88%	-
Шетелдік эмитенттердің үлестік құралдары (ETF пайлары және акциялары)	0	0,00%	274,67	17,99%	-
Шетелдік эмитенттердің акциялары мен депозитарлық қолхаттары	0	0,00%	130,35	8,54%	-
Шоттардағы ақшалай қаражат	2,51	0,50%	15,99	1,05%	537,05%
ҚР эмитенттерінің корпоративтік облигациялары	0	0,00%	122,46	8,02%	-
ҚР квазимемлекеттік ұйымдарының облигациялары	0	0,00%	248,28	16,26%	-
Halyk Global Markets басқаруындағы ЗА жиынтығы	502,97	100,00%	1 526,54	100,00%	203,50%
Жасалған мәмілелер бойынша төлемге міндеттемелер	0	0,00%	0	0,00%	-
Зейнетақы активтерінің жиынтығы	502,97		1 526,54		203,50%

01.10.2021 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 10,39% - 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 128,02 млн.теңгеге өсіп, 142,03 млн. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 9,30%-ды құрады. Теңгеге номинирленген Halyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфеліндегі кері Репо операцияларының орташа алынған кірістілігі есепті күнге жылдық 9,45% -ды құрады.

Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкі ноттары

Halyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфеліндегі негізгі үлесті ағымдағы құны есепті айда 318,39 млн.теңгені құраған Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкінің ноттарын алады. Олардың портфельдегі үлесі 20,86%-ды құрады.

Қарастырылып отырған кезеңде 480,00 млн. теңге сомасына Қазақстан Республикасы Ұлттық банкінің ноттары өтелді.

Есепті кезеңде жылдық 9,33% мөлшеріндегі кірістілігімен 324,00 млн. теңге көлемінде Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкінің ноттары 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 9,33% -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 0,56 млн теңгеге артып, 154,06 млн теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 10,09% -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 11,99%-ды құрады.

Халықаралық қаржы ұйымдарының облигациялар

Есепті айда халықаралық қаржы ұйымдарының облигацияларының ағымдағы құны 120,32 млрд. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 7,88%-ды құрады.

Есепті кезеңде кірістілігі жылдық 10,50% мөлшерінде 120,00 млн теңге көлемінде Еуразиялық даму банкінің облигациялары сатып алынды.

Теңгемен номиналданған халықаралық қаржы ұйымдарының облигациялары бойынша өтеуге орташа алынған кірістілік сыйақының белгіленген ставкасымен жылдық 10,49%-ды құрады.

Шетелдік эмитенттердің үлестік құралдары (ETF пайлары)

Сондай-ақ, Halyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфелінде шетелдік эмитенттердің (ETF пайлары) үлестік құралдары бар, олардың ағымдағы құны есепті айда 2,63 млн.теңгеге кеміп, 274,67 млн.теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 17,99%-ды құрады.

ҚР эмитенттерінің корпоративтік облигациялары

Бұған қосымша, Halyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфелінде ҚР эмитенттерінің корпоративтік облигациялары бар, олардың ағымдағы құны есепті айда 1,10 млн теңгеге артып, 122,46 млн. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 8,02%-ды құрады.

Halyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфеліндегі теңгемен номиналданған ҚР эмитенттерінің корпоративтік облигацияларын өтеуге орташа алынған кірістілік есепті күнге жылдық 10,99%-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 2,19 млн теңгеге кеміп, 130,35 млн. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 8,54% -ды құрады.

ҚР квазимемлекеттік ұйымдарының облигациялары

Бұған қосымша, Halyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфелінде ҚР квазимемлекеттік ұйымдарының облигациялары бар, олардың ағымдағы құны есепті айда 122,74 млн теңгеге өсті және 248,28 млн теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 16,26%-ды құрады.

Есепті кезеңде жылдық 11,87% мөлшеріндегі кірістілікпен 120,00 млн. теңге көлемінде "ҚазАгроФинанс" АҚ облигацияларын сатып алынды. Halyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы ҚР квазимемлекеттік ұйымдарының БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфеліндегі теңгемен номиналданған облигацияларын өтеуге орташа алынған кірістілік есепті күнге жылдық 10,93%-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	млн. теңге				
	01.04.2021 жылға ағымдағы құны	01.04.2021 жылға үлесі	01.10.2021 ж. ағымдағы құны	01.10.2021 ж. үлесі	01.04.2021 ж. бастап өсуі/төмендеуі
Ұлттық валюта	502,97	100%	1 106,66	72,49%	120,02%
АҚШ доллары	0	0,00%	419,88	27,51%	-
Жиынтығы:	502,97	100,00%	1 526,54	100,00%	203,50%

Инвестициялық қызметтің нәтижелері

Инвестициялық қызметтің нәтижесінде, есептелген инвестициялық табыс мөлшері (қызмет басталғаннан бастап 2021 жылғы 01 қазандағы жағдай бойынша) 56,61 млн. теңгені құрады. Зейнетақы активтерінің табыстылығы 4,94 %-ды құрады.

Есептелген инвестициялық табыстың құрылымы 3-кестеде көрсетілген.

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

млн. теңге	
Атауы	Есептік кезең үшін инвестициялық табыс
Бағалы қағаздар бойынша, оның ішінде орналастырылған салымдар және «кері РЕПО» операциялары бойынша сыйақы түріндегі табыстар	42,69
Бағалы қағаздарды нарықтық қайта бағалаудан түскен кірістер (шығындар)	15,03
Шетел валюталарын қайта бағалаудан түскен кірістер (шығындар)	0,08
Басқа кірістер (шығындар)	-1,19
Жиынтығы:	56,61

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

№	Дата	Бір шартты бірліктің құны
1	01.09.2021	942.0439024
2	02.09.2021	942.0439024
3	03.09.2021	942.0439024
4	04.09.2021	942.0439024
5	05.09.2021	942.0439024
6	06.09.2021	943.4272542
7	07.09.2021	943.4272542
8	08.09.2021	943.4272542
9	09.09.2021	943.4272542
10	10.09.2021	943.4272542
11	11.09.2021	943.4272542
12	12.09.2021	943.4272542
13	13.09.2021	940.0269315
14	14.09.2021	940.0269315
15	15.09.2021	940.0269315
16	16.09.2021	940.0269315
17	17.09.2021	940.0269315

18	18.09.2021	940.0269315
19	19.09.2021	940.0269315
20	20.09.2021	941.2150226
21	21.09.2021	941.2150226
22	22.09.2021	941.2150226
23	23.09.2021	941.2150226
24	24.09.2021	941.2150226
25	25.09.2021	941.2150226
26	26.09.2021	941.2150226
27	27.09.2021	943.2971878
28	28.09.2021	943.2971878
29	29.09.2021	943.2971878
30	30.09.2021	943.9517117

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 қазандағы 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	1,10%	иә
	Кері РЕПО	9,30%	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	29,15%	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 & 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	7,88%	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	Шетелдік мемлекеттердің орталық үкіметтері шығарған, мемлекеттік деген 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	26,48%	иә
9	Шетелдік мемлекеттік емес эмитенттердің борыштық бағалы қағаздары	0,00%	иә
10	ҚР эмитенттерінің акциялары және 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	26,09%	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

№	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
1.3	Құймадағы және металл шоттардағы алтын	0,00%	иә

Налык 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	Мәміленің құны, теңгемен
Облигациялар	KZT	Еуразиялық Даму Банкі	120 000 000,00
ҚРҰБ ноттары	KZT	Қазақстан Республикасының Ұлттық Банкі	316 634 832,00
Облигациялар	KZT	«ҚазАгроФинанс» АҚ	120 592 093,33
Жиынтығы			557 226 925,33

7-кесте. Есепті айда бағалы қағаздар бойынша негізгі борышты өтеу бойынша мәлімет

Құрал түрі	Валюта	Бағалы қағаз эмитенті	Номиналды құны теңгемен
ҚРҰБ ноттары	KZT	Қазақстан Республикасының Ұлттық Банкі	300 000 000,00
ҚРҰБ ноттары	KZT	Қазақстан Республикасының Ұлттық Банкі	180 000 000,00
Жиынтығы			480 000 000,00