

## БЖЗҚ» АҚ Зейнетақы активтерін инвестициялық басқару бойынша ақпарат

2022 жылғы 1 наурыздағы жағдай бойынша «Halyk Global Markets» АҚ басқаруындағы (бұдан әрі – Halyk Global Markets) БЖЗҚ зейнетақы активтері (бұдан әрі – ЗА) **2 272,54** 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   | <i>млн. теңге</i>                 |                           |                                   |                           | 01.01.2022 ж.<br>бастап<br>өсуі/төмендеуі |
|---|-----------------------------------|---------------------------|-----------------------------------|---------------------------|---|
|   | 01.01.2022 жылға<br>ағымдағы құны | 01.01.2022 жылға<br>үлесі | 01.03.2022 жылға<br>ағымдағы құны | 01.03.2022 жылға<br>үлесі |   |
| Кері Репо (90 күнтізбелік күннен артық емес)                            | 892,98                            | 43,33%                    | 925,86                            | 40,74%                    | 3,68%                                     |
| ҚРҰБ ноталары   | 0                                 | 0,00%                     | 0                                 | 0,00%                     | 0,00%                                     |
| ҚР екінші деңгейдегі банктерінің облигациялары                          | 155,3                             | 7,54%                     | 155,75                            | 6,85%                     | 0,29%                                     |
| ХҚҰ   | 120,2                             | 5,83%                     | 122,30                            | 5,38%                     | 1,75%                                     |
| Шетелдік эмитенттердің үлестік құралдары (ETF пайлары)                  | 288,4                             | 13,99%                    | 449,63                            | 19,79%                    | 55,91%                                    |
| Шетелдік эмитенттердің акциялары және депозитарлық қолхаттары           | 180,38                            | 8,75%                     | 193,0                             | 8,49%                     | 6,99%                                     |
| Шоттардағы ақшалай қаражат  | 1,02                              | 0,05%                     | 9,68                              | 0,43%                     | 845,17%                                   |
| ҚР ұйымдарының корпоративтік облигациялары                              | 125,67                            | 6,10%                     | 121,27                            | 5,34%                     | -3,50%                                    |
| Басқа активтер (дебиторлық берешек, мерзімі өткен берешек, провизиялар) | 0,38                              | 0,02                      | 0,91                              | 0,04%                     | 142,57%                                   |
| ҚР квазимемлекеттік ұйымдарының облигациялары                           | 296,51                            | 14,39%                    | 294,13                            | 12,94%                    | -0,80%                                    |
| <b>Halyk Global Markets басқаруындағы ЗА жиынтығы</b>                   | <b>2 060,84</b>                   |                           | <b>2 272,54</b>                   |                           | <b>10,27%</b>                             |
| Жасалған мәмілелер бойынша төлеуге міндеттемелер                        | 0                                 |                           | 0                                 |                           |   |
| <b>Зейнетақы активтерінің жиынтығы</b>                                  | <b>2 060,84</b>                   | <b>100,00%</b>            | <b>2 272,54</b>                   | <b>100,00%</b>            | <b>10,27%</b>                             |

01.03.2022 ж. жағдай бойынша теңгеде номиналданған Halyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфеліндегі борыштық қаржы құралдарының және кері Репо операцияларының орташа алынған кірістілігі жылдық 10,85%-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 17,36 млн теңгеге өсіп, 925,86 млн теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 40,74%-ды құрады. Halyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы, теңгеде номиналданған БЖЗҚ ЗА

инвестициялық портфельіндегі кері Репо операцияларының орташа алынған кірістілігі есепті күнге жылдық 11,29%-ды құрады.

#### **Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банктерінің облигациялары**

Сонымен қатар, Halyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфельінде Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банктерінің облигациялары бар, олардың ағымдағы құны есепті айда 1,51 млн теңгеге артып, 155,75 млн теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 6,85%-ды құрады.

Halyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфельіндегі Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банктерінің теңгеде номиналданған борыштық бағалы қағаздарын өтеуге орташа алынған кірістілігі есепті күнге жылдық 9,93% - ды құрады.

#### **Халықаралық қаржы ұйымдарының облигациялары**

Есепті айда халықаралық қаржы ұйымдары облигацияларының ағымдағы құны 1,05 млн теңгеге артып, 122,30 млн теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 5,38%-ды құрады.

Халықаралық қаржы ұйымдарының облигациялары бойынша өтеуге теңгеде номиналданған, орташа алынған кірістілік, белгіленген сыйақы мөлшерлемесімен жылдық 11,71%-ды құрады.

#### **Шетелдік эмитенттердің үлестік құралдары (ETF пайлары)**

Сондай-ақ, Halyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфельінде шетелдік эмитенттердің үлестік құралдары (ETF пайлары) бар, олардың ағымдағы құны есепті айда 94,81 млн. теңгеге артып, 449,63 млн. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 19,79%-ды құрады.

Есепті кезеңде 20,96 млн теңге көлемінде ETF Vanguard S&P 500 ETF және 20,89 млн теңге көлемінде SPDR S&P 500 ETF TRUST эмитенттерінің пайларын сатып алу жүргізілді.

#### **Қазақстан Республикасы эмитенттерінің корпоративтік облигациялары**

Бұған қоса, Halyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфельінде ҚР эмитенттерінің корпоративтік облигациялары бар, олардың ағымдағы құны есепті айда 5,50 млн теңгеге азайып, 121,27 млн теңгені құраған. Олардың портфельдегі үлесі 5,34%-ды құрады.

Halyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы ҚР эмитенттерінің БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфельіндегі теңгеде номиналданған, корпоративтік облигацияларын өтеуге орташа алынған кірістілік есепті күнге жылдық 11,02%-ды құрады.

#### **Шетелдік эмитенттердің акциялары мен депозитарлық қолхаттары**

Сондай-ақ, Halyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфельінде шетелдік эмитенттердің акциялары бар, олардың ағымдағы құны есепті айда 13,70 млн теңгеге артып, 193,00 млн теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 8,49%-ды құрады.

Есепті кезеңде 5,34 млн теңге көлемінде Meta Platforms, Inc. акцияларын және 0,24 млн теңге көлемінде «Сбербанк» ҚАҚ жаһандық депозитарлық қолхаттарын сату жүзеге асырылды.

#### **Қазақстан Республикасының квазимемлекеттік ұйымдарының облигациялары**

Сонымен қатар, Halyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфельінде ҚР квазимемлекеттік ұйымдарының облигациялары бар, олардың ағымдағы құны есепті айда 4,76 млн теңгеге азайып, 294,13 млн теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 12,94%-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 9,73%-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           | млн. теңге                     |                        |                             |                        |                                     |
|------------------|--------------------------------|------------------------|-----------------------------|------------------------|-------------------------------------|
|                  | 01.01.2022 жылға ағымдағы құны | 01.01.2022 жылға үлесі | 01.03.2022 ж. ағымдағы құны | 01.03.2022 жылға үлесі | 01.01.2022 ж. бастап осуі/төмендеуі |
| Ұлттық валюта    | 1 591,16                       | 77,21%                 | 1 622,03                    | 71,38%                 | 1,94%                               |
| АҚШ доллары      | 469,68                         | 22,79%                 | 650,51                      | 28,62%                 | 38,50%                              |
| <b>Жиынтығы:</b> | <b>2 060,84</b>                | <b>100,00%</b>         | <b>2 272,54</b>             | <b>100,00%</b>         | <b>10,27%</b>                       |

### Инвестициялық қызмет нәтижелері

Инвестициялық қызметтің нәтижесінде, есептелген инвестициялық табыс мөлшері (активтерді берген сәттен бастап 2022 жылғы 01 наурыздағы жағдай бойынша) 191,53 млн теңгені және есептелген инвестициялық табыс мөлшері (2022 жылғы 01 қаңтардан бастап 2022 жылғы 01 наурыздағы жағдай бойынша) 78,73 млн теңгені құрады. Зейнетақы активтерінің кірістілігі қызмет басынан бері 12,15%-ды және 2022 жылдың басынан 3,45%-ды құрады.

Есептелген инвестициялық табыстың құрылымы 3-кестеде көрсетілген.

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

| Атауы   | млн. теңге   |
|---|--------------|
| 2022 жыдың басынан бастап инвестициялық табыс   |              |
| Бағалы қағаздар бойынша, оның ішінде орналастырылған салымдар және «кері РЕПО» операциялары бойынша сыйақы түріндегі табыстар | 28.29        |
| Бағалы қағаздарды нарықтық қайта бағалаудан түскен кірістер (шығындар)  | 50.48        |
| Шетел валюталарын қайта бағалаудан түскен кірістер (шығындар)   | 1.22         |
| Басқа кірістер (шығындар)   | -1.26        |
| <b>Жиынтығы:</b>  | <b>78.73</b> |

### 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

| №  | Күні       | Бір шартты бірліктің құны |
|----|------------|---------------------------|
| 1  | 01.02.2022 | 971,4357628               |
| 2  | 02.02.2022 | 971,4357628               |
| 3  | 03.02.2022 | 971,4357628               |
| 4  | 04.02.2022 | 971,4357628               |
| 5  | 05.02.2022 | 971,4357628               |
| 6  | 06.02.2022 | 971,4357628               |
| 7  | 07.02.2022 | 975,5302935               |
| 8  | 08.02.2022 | 975,5302935               |
| 9  | 09.02.2022 | 975,5302935               |
| 10 | 10.02.2022 | 975,5302935               |

|    |            |               |
|----|------------|---------------|
| 11 | 11.02.2022 | 975,5302935   |
| 12 | 12.02.2022 | 975,5302935   |
| 13 | 13.02.2022 | 975,5302935   |
| 14 | 14.02.2022 | 973,9527023   |
| 15 | 15.02.2022 | 973,9527023   |
| 16 | 16.02.2022 | 973,9527023   |
| 17 | 17.02.2022 | 973,9527023   |
| 18 | 18.02.2022 | 973,9527023   |
| 19 | 19.02.2022 | 973,9527023   |
| 20 | 20.02.2022 | 973,9527023   |
| 21 | 21.02.2022 | 969,0605946   |
| 22 | 22.02.2022 | 969,0605946   |
| 23 | 23.02.2022 | 969,0605946   |
| 24 | 24.02.2022 | 969,0605946   |
| 25 | 25.02.2022 | 969,0605946   |
| 26 | 26.02.2022 | 969,0605946   |
| 27 | 27.02.2022 | 969,0605946   |
| 28 | 28.02.2022 | 1 008,8010325 |

### Инвестициялық декларация параметрлерін сақтау туралы ақпарат

Сенімгерлік басқарудағы БЖЗҚ ЗА құрылымдық үлестіруі Halyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы зейнетақы активтері есебінен қалыптастырылған қаржы құралдарының портфеліне қойылатын Инвестициялық декларация талаптарына сәйкес келеді<sup>1</sup>. Валюталық позициялар үлесі рұқсат етілген деңгей шегінде қалады және Halyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы зейнетақы активтері есебінен қалыптастырылған қаржы құралдарының портфеліне қойылатын Инвестициялық декларация талаптарын бұзбайды. 2022 жылғы 01 ақпандағы 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  | 0,43%  | иә                 |
|   | Кері РЕПО  | 40,74%   | 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 & 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 | 5,38%  | 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 | 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   | 28,28%   | иә                 |
| 9 | Шетелдік мемлекеттік емес эмитенттердің борыштық бағалы қағаздары  | 0,00%  | иә                 |

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

|    |  |        |    |
|----|--|--------|----|
| 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   | 25,17% | 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 | 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  | Мәміле құны теңгемен |
|-----------------|--------|------------------------|----------------------|
| ETF             | USD    | Vanguard S&P 500 ETF   | 20 960 164,80        |
| ETF             | USD    | SPDR S&P 500 ETF TRUST | 20 887 785,60        |
| <b>Жиынтығы</b> |        |                        | <b>41 847 950,40</b> |

**7-кесте. Есептік айда қаржы құралдарын сату бойынша мәліметтер**

| Құрал түрі                      | Валюта | Бағалы қағаз эмитенті | Мәміле құны теңгемен |
|---------------------------------|--------|-----------------------|----------------------|
| Акциялар                        | USD    | Meta Platforms, Inc.  | 5 340 733,44         |
| Жаһандық депозитарлық қолхаттар | USD    | ПАО «Сбербанк»        | 240 298,94           |
| <b>Жиынтығы</b>                 |        |                       | <b>5 581 032,38</b>  |