

**Halyk Global Markets» АҚ сенімгерлік басқаруындағы
«БЖЗҚ» АҚ зейнетақы активтерін
инвестициялық басқару бойынша ақпарат**

2023 жылғы 1 қыркүйектегі жағдай бойынша «Halyk Global Markets» АҚ сенімгерлік басқаруындағы (бұдан әрі – Halyk Global Markets) «БЖЗҚ» АҚ (бұдан әрі – БЖЗҚ) зейнетақы активтері (бұдан әрі – ЗА) **2 483,41** млн. теңгені құрады.

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

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

млн. теңге

Атауы	01.01.2023 жылға ағымдағы құны	01.01.2023 жылға үлесі	01.09.2023 жылға ағымдағы құны	01.09.2023 жылға үлесі	01.01.2023 ж. бастап өсуі/төмендеуі
ҚР екінші деңгейдегі банктерінің облигациялары	49,39	1,88%	49,60	2,00%	0,42%
ХҚҰ облигациялары	115,27	4,38%	286,81	11,55%	148,82%
ҚР ұйымдарының корпоративтік облигациялары	121,62	4,62%	121,59	4,90%	-0,03%
ҚР квазимемлекеттік ұйымдарының облигациялары	330,81	12,57%	519,06	20,90%	56,90%
Шетелдік эмитенттердің үлестік құралдары (ETF пайлары)	334,78	12,72%	411,58	16,57%	22,94%
ҚРҰБ ноталары	0,00	0,00%	214,16	8,62%	0,00%
Қазақстан Республикасының ұйымдары шығарған акциялар және депозитарлық қолхаттар	130,00	4,94%	0,00	0,00%	0,00%
Шет мемлекеттердің орталық үкіметтері шығарған, мемлекеттік мәртебесі бар бағалы қағаздар	178,74	6,79%	182,77	7,36%	2,26%
Кері РЕПО (90 күнтізбелік күннен артық емес)	1 307,42	49,69%	663,37	26,71%	-49,26%
Басқа активтер (дебиторлық берешек, мерзімі өткен берешек, провизиялар)	0,66	0,03%	0,00	0,00%	0,00%
Шоттардағы ақшалай қаражат	62,51	2,38%	34,46	1,39%	-44,87%
Halyk Global Markets басқаруындағы ЗА жиынтығы	2 631,21	100,00%	2 483,41	100,00%	-5,62%
Жасалған мәмілелер бойынша төлеуге міндеттемелер	-	-	-	-	-
Зейнетақы активтерінің жиынтығы	2 631,21	100,00%	2 483,41	100,00%	-5,62%

01.09.2023 ж. жағдай бойынша теңгемен номиналданған борыштық қаржы құралдарының орташа алынған кірістілігі жылдық 13,84%-ды құрады. АҚШ долларымен номиналданған қарыздық қаржы құралдарының орташа алынған кірістілігі 6,32% 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 663,37 млн теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 26,71%-ды құрды. Кері Репо операцияларының орташа алынған кірістілігі есепті күнге жылдық 17,00%-ды құрады.

Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банктерінің облигациялары

Қазақстан Республикасының (бұдан әрі – ҚР) екінші деңгейдегі банктері облигацияларының ағымдағы құны есепті айда 1,16 млн. теңгеге ұлғайып, 49,60 млн. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 2,00% құрайды.

Есепті күнге ҚР екінші деңгейдегі банктерінің облигацияларын өтеуге орташа алынған кірістілік жылдық 11,10%-ды құрады.

Халықаралық қаржы ұйымдарының облигациялары

Есепті айда халықаралық қаржы ұйымдары облигацияларының ағымдағы құны 10,36 млн теңгеге өсіп, 286,81 млн теңгені құрады. Халықаралық қаржы ұйымдарының портфельдегі үлесі 11,55%-ды құрайды.

Халықаралық қаржы ұйымдарының облигациялары бойынша өтеуге, теңгеде номиналданған, орташа алынған кірістілік, белгіленген сыйақы мөлшерлемесімен жылдық 8,49%-ды құрады.

ҚР эмитенттерінің корпоративтік облигациялары

ҚР эмитенттерінің корпоративтік облигацияларының ағымдағы құны есепті айда 2,71 млн теңгеге ұлғайып, 121,59 млн теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 4,90%-ды құрады.

Теңгемен номиналданған ҚР эмитенттерінің корпоративтік облигацияларын өтеуге орташа алынған кірістілік есепті күнге жылдық 10,91%-ды құрайды.

Шетелдік эмитенттердің үлестік құралдары (ETF пайлары)

Halyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфелінде шетелдік эмитенттердің үлестік құралдары (ETF пайлары) бар, есепті айда олардың ағымдағы құны 0,72 млн. теңгеге ұлғайып, 411,58 млн. теңгені құрады. Портфельдегі шетелдік эмитенттердің үлестік құралдарының үлесі (ETF пайлары) 16,57% құрады.

Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкінің Ноталары

Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкі ноталарының ағымдағы құны 214,16 млн теңгені құрайды. Олардың портфельдегі үлесі 8,62% құрады.

Қарастырылып отырған кезеңде 16,61% кірістілікпен, номиналды құны бойынша 215 млн теңге көлемінде ҚРҰБ-ның 28 күндік ноталары сатып алынды.

Шет мемлекеттердің орталық үкіметтері шығарған, мемлекеттік мәртебесі бар бағалы қағаздар

Шет мемлекеттердің орталық үкіметтері шығарған, мемлекеттік мәртебесі бар бағалы қағаздардың ағымдағы құны есепті айда 6,14 млн. теңгеге өсіп, 182,77 млн. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 7,36% құрайды.

Шет мемлекеттердің орталық үкіметтері шығарған, мемлекеттік мәртебесі бар бағалы қағаздарды өтеуге орташа алынған кірістілік есепті күнге жылдық 6,32%-ды құрады.

ҚР квазимемлекеттік ұйымдарының облигациялары

ҚР квазимемлекеттік ұйымдары облигацияларының ағымдағы құны есепті айда 0,98 млн. теңгеге ұлғайып, 519,06 млн. теңгені құрады. Портфельдегі ҚР квазимемлекеттік ұйымдары облигацияларының үлесі 20,90% құрайды.

Теңгемен номиналданған ҚР квазимемлекеттік ұйымдарының облигацияларын өтеуге орташа алынған кірістілік есепті күнге жылдық 17,75% құрады.

Валюталық құрылым

Nalyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы, зейнетақы активтері есебінен сатып алынған, қаржы құралдары номиналданған валюталар бөлінісіндегі қаржы құралдарының инвестициялық портфелі 2-кестеде келтірілген.

Есепті кезеңде Қазақстан қор биржасында шетел валютасын сатып алу-сату мәмілелері жүзеге асырылмады.

2-кесте. Валюталар бөлігінде, Nalyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы, БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфелінің құрылымы

млн. теңге

Валюта	01.01.2023 жылға ағымдағы құны	01.01.2023 жылға үлесі	01.09.2023 ж. ағымдағы құны	01.09.2023 жылға үлесі	01.01.2023 ж. бастап өсуі/төмендеуі
Ұлттық валюта	2 095,80	79,65%	1 874,74	75,49%	-10,55%
АҚШ доллары	535,40	20,35%	608,65	24,51%	13,68%
Евро	0	0,00%	0,01	0,001%	0,00%
Жиыны:	2 631,21	100,00%	2 483,41	100,00%	-5,62%

Инвестициялық қызмет нәтижелері

Инвестициялық қызмет нәтижесінде, есептелген инвестициялық кіріс мөлшері (2021 ж. 15 наурыздан бастап 2023 жылғы 1 қыркүйектегі жағдай бойынша) 524,86 млн теңгені және есептелген инвестициялық кіріс мөлшері (2023 жылғы 1 қаңтардан бастап 2023 жылғы 1 қыркүйектегі жағдай бойынша) 301,46 млн теңгені құрады. Зейнетақы активтерінің кірістілігі қызмет басынан бері 26,11%-ды және 2023 жылдың басынан бастап 11,65%-ды құрды.

Есептелген инвестициялық табыстың құрылымы 3-кестеде көрсетілген.

3-кесте. Nalyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА бойынша алынған инвестициялық кіріс құрылымы

млн. теңге

Атауы	2023 жыдың басынан бастап инвестициялық табыс
Бағалы қағаздар бойынша, оның ішінде орналастырылған салымдар және «кері РЕПО» операциялары бойынша сыйақы түріндегі кірістер	200,94
Бағалы қағаздарды нарықтық қайта бағалаудан түскен кірістер (шығындар)	99,77
Шетел валюталарын қайта бағалаудан түскен кірістер (шығындар)	1,87
Басқа кірістер (шығындар)	- 1,12
Жиыны:	301,46

Шартты бірліктің құны туралы ақпарат

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

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

№	Күні	Бір шартты бірліктің құны
1	01.08.2023	1 116,8541046
2	02.08.2023	1 116,8541046
3	03.08.2023	1 116,8541046
4	04.08.2023	1 116,8541046
5	05.08.2023	1 116,8541046

6	06.08.2023	1 116,8541046
7	07.08.2023	1 115,8016228
8	08.08.2023	1 115,8016228
9	09.08.2023	1 115,8016228
10	10.08.2023	1 115,8016228
11	11.08.2023	1 115,8016228
12	12.08.2023	1 115,8016228
13	13.08.2023	1 115,8016228
14	14.08.2023	1 118,7396251
15	15.08.2023	1 118,7396251
16	16.08.2023	1 118,7396251
17	17.08.2023	1 118,7396251
18	18.08.2023	1 118,7396251
19	19.08.2023	1 118,7396251
20	20.08.2023	1 118,7396251
21	21.08.2023	1 124,5602151
22	22.08.2023	1 124,5602151
23	23.08.2023	1 124,5602151
24	24.08.2023	1 124,5602151
25	25.08.2023	1 124,5602151
26	26.08.2023	1 124,5602151
27	27.08.2023	1 124,5602151
28	28.08.2023	1 134,5014545
29	29.08.2023	1 134,5014545
30	30.08.2023	1 134,5014545
31	31.08.2023	1 134,3484941

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 келеді¹. 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. 2023 жылғы 1 қыркүйектегі 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)
1	Банктік шоттардағы қалдықтарды қосқандағы ақшалай қаражат	1,39%	иә
2	Кері РЕПО	26,71%	иә
3	ҚР Қаржы министрлігі және ҚР ҰБ шығарған Қазақстан Республикасының мемлекеттік бағалы қағаздары, ҚР жергілікті атқарушы органдары шығарған борыштық бағалы қағаздар	8,62%	иә
4	Жүз пайыз акциясы ҚР ҰБ тиесілі заңды тұлға шығарған борыштық бағалы қағаздар	8,30%	
5	Қазақстан Республикасының және басқа мемлекеттердің заңнамасына сәйкес «Қазақстанның Даму Банкі», «Самұрық-Қазына» ұлттық әл-ауқат	7,52%	иә

¹ 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

№	Қаржы құралының түрі	Нақты мәні (зейнетақы активтерінің жалпы көлемінен пайызбен)	Орында луы (иә/жоқ)
	қоры», «Бәйтерек» ұлттық басқару холдингі», «Проблемалы кредиттер қоры» акционерлік қорлары шығарған борыштық бағалы қағаздар		
6	Қазақстан Республикасының екінші деңгейлі банктеріндегі салымдар		иә
7	Резидент емес банктердегі салымдар		иә
8	Халықаралық қаржы ұйымдары шығарған борыштық бағалы қағаздар	11,55%	иә
9	Шет мемлекеттердің орталық үкіметтері шығарған, мемлекеттік мәртебесі бар бағалы қағаздар	7,36%	иә
10	Шетелдік эмитенттердің акциялары және депозитарлық қолхаттары		
11	Активтерінің құрылымы акциялардың қор индекстерінің бірінің құрылымын қайталайтын немесе баға белгіленімі акциялар индекстеріне байланысты болатын Exchange Traded Funds (ETF) пайлары	16,57%	иә
12	Активтерінің құрылымы облигациялар индекстерінің бірінің құрылымын қайталайтын немесе баға белгіленімі облигациялар мен ақша нарығы құралдарының индекстеріне байланысты болатын Exchange Traded Funds (ETF) пайлары		иә
13	Баға белгіленімі валюталарға, бағалы металдарға, тауар-шикізат нарықтарына (commodities) немесе жылжымайтын мүлік нарығына (соның ішінде ETF немесе ETN түріндегі REIT) байланысты болатын Exchange Traded Funds (ETF), Exchange Traded Commodities (ETC), Exchange Traded Notes (ETN) пайлары		иә
14	Шетелдік мемлекеттік емес эмитенттердің борыштық бағалы қағаздары		иә
15	ҚР эмитенттерінің акциялары мен депозитарлық қолхаттары, басқарушы компаниясы Қазақстан Республикасының заңнамасына сәйкес құрылған заңды тұлғаның интервалды пайлық инвестициялық қорлардың пайлары		иә
16	ҚР мемлекеттік емес эмитенттерінің борыштық бағалы қағаздары	11,97%	иә
17	Туынды қаржы құралдары		иә
18	10, 11,12,13 және 15-жолдарда көрсетілген қаржы құралдарының түрлері	16,57%	иә

№	Қаржы құралының түрі	Нақты мәні (зейнетақы активтерінен пайызбен)	Орында луы (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 жөніндегі ақпарат

6-кесте. Есепті айда қаржы құралдарын сатып алу бойынша мәліметтер

Құрал түрі	Валюта	Бағалы қағаз эмитенті	Мәміле құны, теңгемен
ҚР ҰБ Ноталары (NTK028_2834)	KZT	"Қазақстан Республикасының Ұлттық Банкі" ММ	212 486 005,00
Жиыны			212 486 005,00

7-кесте. Есепті айда қаржы құралдарын сату бойынша мәліметтер

Құрал түрі	Валюта	Бағалы қағаз эмитенті	Мәміле құны, теңгемен
Есепті айда қаржы құралдарын сату жүзеге асырылмады			
Жиыны			

8-кесте. Есепті айда бағалы қағаздар бойынша негізгі борышты өтеу жөніндегі мәліметтер

Құрал түрі	Валюта	Бағалы қағаз эмитенті	Мәміле сомасы, теңгемен
Есепті айда бағалы қағаздар бойынша өтеу жүзеге асырылмады			
Жиыны			

9-кесте. Есепті айда шетелдік банктердің салымдарына орналастыру жөніндегі мәліметтер

Құрал түрі	Валюта	Банк атауы	Мәміле сомасы, теңгемен
Есепті айда шетелдік банктердің салымдарына орналастыру жүзеге асырылмады			
Жиыны			

10-кесте. Есепті айда салымдар бойынша негізгі борышты өтеу жөніндегі мәліметтер

Құрал түрі	Валюта	Банк атауы	Өтеу сомасы, теңгемен
Есепті айда салымдар бойынша негізгі борышты өтеу жүзеге асырылмады			
Жиыны			