

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

2023 жылғы 1 мамырдағы жағдай бойынша «Налык Global Markets» АҚ сенімгерлік басқаруындағы (бұдан әрі – Налык Global Markets) «БЖЗҚ» АҚ (бұдан әрі - БЖЗҚ) зейнетақы активтері (бұдан әрі – ЗА) **2 555,45** млн. теңгені құрады.

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

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

*млн. теңге*

| Атауы  | 01.01.2023<br>жылға<br>ағымдағы<br>құны | 01.01.2023<br>жылға үлесі | 01.05.2023<br>жылға<br>ағымдағы<br>құны | 01.05.2023<br>жылға<br>үлесі | 01.01.2023 ж.<br>бастап<br>өсуі/төмендеуі |
|--|---|---------------------------|---|------------------------------|---|
| ҚР екінші деңгейдегі банктердің облигациялары  | 49,39                                   | 1,88%                     | 47,13                                   | 1,84%                        | -4,57%                                    |
| ХҚҰ облигациялары  | 115,27                                  | 4,38%                     | 253,54                                  | 9,92%                        | 119,96%                                   |
| ҚР ұйымдарының корпоративтік облигациялары   | 121,62                                  | 4,62%                     | 115,19                                  | 4,51%                        | -5,29%                                    |
| ҚР квазимемлекеттік ұйымдардың облигациялары   | 330,81                                  | 12,57%                    | 502,08                                  | 19,65%                       | 51,77%                                    |
| Шетелдік эмитенттердің үлестік құралдары (ETF пайлары)   | 334,78                                  | 12,72%                    | 379,15                                  | 14,84%                       | 13,25%                                    |
| ҚР ҰБ ноталары   | 0,00                                    | 0,00%                     | 235,83                                  | 9,23%                        | 0,00%                                     |
| Шетелдік эмитенттердің акциялары және депозитарлық қолхаттары  | 130,00                                  | 4,94%                     | 0,00                                    | 0,00%                        | 0,00%                                     |
| Шетелдік мемлекеттердің орталық орталық үкіметтері шығарған мемлекеттік мәртебесі бар бағалы қағаздары | 178,74                                  | 6,79%                     | 177,38                                  | 6,94%                        | -0,76%                                    |
| Кері Репо (90 күнтізбелік күннен артық емес)   | 1 307,42                                | 49,69%                    | 834,29                                  | 32,65%                       | -36,19%                                   |
| Басқа активтер (дебиторлық берешек, мерзімі өткен берешек, провизиялар)                                | 0,66                                    | 0,03%                     | 0,59                                    | 0,02%                        | -11,90%                                   |
| Шоттардағы ақшалай қаражат   | 62,51                                   | 2,38%                     | 10,28                                   | 0,40%                        | -83,55%                                   |
| <b>Налык Global Markets басқаруындағы ЗА жиынтығы</b>  | <b>2 631,21</b>                         | <b>100,00%</b>            | <b>2 555,45</b>                         | <b>100,00%</b>               | <b>-2,88%</b>                             |
| Жасалған мәмілелер бойынша төлеуге міндеттемелер   | -                                       | -                         | -                                       | -                            | -   |
| <b>Зейнетақы активтерінің жиынтығы</b>   | <b>2 631,21</b>                         | <b>100,00%</b>            | <b>2 555,45</b>                         | <b>100,00%</b>               | <b>-2,88%</b>                             |

01.05.2023 ж. жағдай бойынша теңгемен номинирленген борыштық қаржы құралдарының орташа алынған кірістілігі жылдық 16,34%-ды құрады. АҚШ долларына номинирленген борыштық қаржы құралдарының орташа кірістілігі жылдық 5,18%-ды құрады.

**Кері Репо операциялары (90 күнтізбелік күннен артық емес)**

Налык Global Markets сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфелінде кері Репо операциялары бар, олардың ағымдағы құны есепті айда 834,29 млн. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 32,65%-ды құрады. Кері Репо операцияларының орташа алынған кірістілігі есепті күнге жылдық 16,60% -ды құрады.

### **Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкі ноталары**

Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкінің ноталарының ағымдағы құны 235,83 млн теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 9,23%-ды құрады.

Қарастырылып отырған кезеңде жылдық 16,60% кірістілікпен 242,5 млн. теңге көлемінде ҚРҰБ-тың 27-күндік ноталары өтелді және жылдық 16,61% кірістілікпен 234 млн. теңге көлемінде ҚРҰБ-тың 28-күндік ноталары сатып алынды.

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

Қазақстан Республикасының (бұдан әрі – ҚР) екінші деңгейдегі банктерінің облигацияларының ағымдағы құны есепті айда 0,43 млн теңгеге артып, 47,13 млн теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 1,84% -ды құрады.

ҚР екінші деңгейдегі банктерінің облигацияларын өтеуге орташа алынған кірістілігі есепті күнге жылдық 13,68%-ды құрады.

### **Халықаралық қаржы ұйымдарының облигациялары**

Есептік айда халықаралық қаржы ұйымдары облигацияларының ағымдағы құны 2,77 млн теңгеге артып 253,54 млн теңгені құрады. Халықаралық қаржы ұйымдары облигацияларының портфельдегі үлесі 9,92% құрады.

Халықаралық қаржы ұйымдарының облигацияларын өтеуге теңгеге номинирленген орташа алынған кірістілік белгіленген сыйақы мөлшерлемесімен жылдық 15,61% құрады.

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

Nalyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфелінде шетелдік эмитенттердің (ETF пайлары) үлестік құралдары бар, олардың ағымдағы құны есепті айда 13,13 млн.теңгеге артып, 379,15 млн.теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 14,84%-ды құрады.

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

ҚР эмитенттердің корпоративтік облигацияларының ағымдағы құны есепті айда 1,10 млн.теңгеге артып, 115,19 млн.теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 4,51%-ды құрады.

ҚР эмитенттердің корпоративтік облигацияларын өтеуге орташа алынған кірістілігі есепті күнге жылдық 13,73% -ды құрады.

### **Шет мемлекеттердің орталық үкіметтері шығарған мемлекеттік деген мәртебесі бар бағалы қағаздар**

Шет мемлекеттердің орталық үкіметтері шығарған мемлекеттік деген мәртебесі бар бағалы қағаздардың ағымдағы құны есепті айда 0,67 млн. теңгеге артып және 177,38 млн теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 6,94%-ды құрады.

Шет мемлекеттердің орталық үкіметтері шығарған мемлекеттік деген мәртебесі бар бағалы қағаздарын өтеуге орташа алынған кірістілігі есепті күнге жылдық 5,18% -ды құрады.

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

ҚР квазимемлекеттік ұйымдарының облигациялары бар, олардың ағымдағы құны есепті айда 182,59 млн.теңгеге артып, 502,08 млн.теңгені құрады. ҚР квазимемлекеттік ұйымдарының облигацияларының үлесі 19,65%-ды құрады.

ҚР квазимемлекеттік ұйымдарының облигацияларын өтеуге теңгеге номинирленген орташа алынған кірістілігі есепті күнге жылдық 17,56% -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 асырылды. 410 321 USD мөлшерінде АҚШ доллары сатып алынды.

**2-кесте. Валюталар бөлігінде Halyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфелінің құрылымы**

млн. теңге

| Валюта        | 01.01.2023 жылға ағымдағы құны | 01.01.2023 жылға үлесі | 01.05.2023 жылға ағымдағы құны | 01.05.2023 жылға үлесі | 01.01.2023 ж. бастап өсуі/төмендеуі |
|---------------|--------------------------------|------------------------|--------------------------------|------------------------|-------------------------------------|
| Ұлттық валюта | 2 095,80                       | 79,65%                 | 1 998,08                       | 78,19%                 | -4,66%                              |
| АҚШ доллары   | 535,40                         | 20,35%                 | 557,37                         | 21,81%                 | 4,10%                               |
| <b>Жиыны:</b> | <b>2 631,21</b>                | <b>100,00%</b>         | <b>2 555,45</b>                | <b>100,00%</b>         | <b>-2,88%</b>                       |

### Инвестициялық қызметтің нәтижелері

Инвестициялық қызметтің нәтижесінде, есептелген инвестициялық табыс мөлшері (2021 жылғы 15 наурыздан бастап 2023 жылғы 01 сәуірдегі жағдай бойынша) 338,66 млн. теңгені және есептелген инвестициялық кіріс мөлшері (2023 жылғы 01 қаңтардан бастап 2023 жылғы 01 мамырдағы жағдай бойынша) 115,26 млн. теңгені құрады. Қызмет басталғаннан бастап зейнетақы активтерінің кірістілігі 17,58 %-ды және 2023 жылдың басынан бастап 4,09 %-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   | 2023 жылдың басынан бастап инвестициялық кіріс |
|---|--|
| Бағалы қағаздар бойынша, оның ішінде орналастырылған салымдар және «кері РЕПО» операциялары бойынша сыйақы түріндегі табыстар | 105,23   |
| Бағалы қағаздарды нарықтық қайта бағалаудан түскен кірістер (шығындар)  | 11,79  |
| Шетел валюталарын қайта бағалаудан түскен кірістер (шығындар)   | -0,89  |
| Басқа кірістер (шығындар)   | -0,87  |
| <b>Жиыны:</b>   | <b>115,26</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  | 01.04.2023 | 1 045,7366613             |
| 2  | 02.04.2023 | 1 045,7366613             |
| 3  | 03.04.2023 | 1 048,7055806             |
| 4  | 04.04.2023 | 1 048,7055806             |
| 5  | 05.04.2023 | 1 048,7055806             |
| 6  | 06.04.2023 | 1 048,7055806             |
| 7  | 07.04.2023 | 1 048,7055806             |
| 8  | 08.04.2023 | 1 048,7055806             |
| 9  | 09.04.2023 | 1 048,7055806             |
| 10 | 10.04.2023 | 1 044,7653848             |
| 11 | 11.04.2023 | 1 044,7653848             |

|    |            |               |
|----|------------|---------------|
| 12 | 12.04.2023 | 1 044,7653848 |
| 13 | 13.04.2023 | 1 044,7653848 |
| 14 | 14.04.2023 | 1 044,7653848 |
| 15 | 15.04.2023 | 1 044,7653848 |
| 16 | 16.04.2023 | 1 044,7653848 |
| 17 | 17.04.2023 | 1 051,4631600 |
| 18 | 18.04.2023 | 1 051,4631600 |
| 19 | 19.04.2023 | 1 051,4631600 |
| 20 | 20.04.2023 | 1 051,4631600 |
| 21 | 21.04.2023 | 1 051,4631600 |
| 22 | 22.04.2023 | 1 051,4631600 |
| 23 | 23.04.2023 | 1 051,4631600 |
| 24 | 24.04.2023 | 1 056,4373376 |
| 25 | 25.04.2023 | 1 056,4373376 |
| 26 | 26.04.2023 | 1 056,4373376 |
| 27 | 27.04.2023 | 1 056,4373376 |
| 28 | 28.04.2023 | 1 056,4373376 |
| 29 | 29.04.2023 | 1 056,4373376 |
| 30 | 30.04.2023 | 1 057,5688102 |

### Инвестициялық декларация параметрлерін сақтау туралы ақпарат

Сенімгерлік басқарудағы БЖЗҚ ЗА құрылымдық үлестіруі Halyk Global Markets<sup>1</sup> 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. 2023 жылғы 01 мамырдағы 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   | 0,43%  | иә                 |
| 2 | Кері РЕПО   | 32,65%   | иә                 |
| 3 | ҚР Қаржы министрлігі және ҚР ҰБ шығарған Қазақстан Республикасының мемлекеттік бағалы қағаздары, ҚР жергілікті атқарушы органдар шығарған борыштық бағалы қағаздар  | 9,23%  | иә                 |
| 4 | Жүз пайыз акциясы ҚР ҰБ тиесілі заңды тұлға шығарған борыштық бағалы қағаздар   | 7,95%  | иә                 |
| 5 | Қазақстан Республикасының және басқа мемлекеттердің заңнамасына сәйкес «Қазақстанның Даму Банкі», «Самұрық-Қазына» ұлттық әлауқат қоры», «Бәйтерек» ұлттық басқару холдингі», «Проблемалы кредиттер қоры» акционерлік қорлары шығарған борыштық бағалы қағаздар | 7,04%  | иә                 |
| 6 | Қазақстан Республикасының екінші деңгейлі банктеріндегі салымдар  | 0,00%  | иә                 |
| 7 | Резидент емес банктердегі салымдар  | 0,00%  | иә                 |
| 8 | Халықаралық қаржы ұйымдары шығарған борыштық бағалы қағаздар  | 9,92%  | иә                 |
| 9 | Халықаралық қаржы ұйымдары шығарған мемлекеттік деген мәртебесі бар бағалы қағаздар   | 6,94%  | иә                 |

<sup>1</sup> «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

|    |  |        |    |
|----|--|--------|----|
| 10 | Шетелдік эмитенттердің акциялары және депозитарлық қолхаттары  | 0,00%  | иә |
| 11 | Активтерінің құрылымы акциялардың қор индекстерінің бірінің құрылымын қайталайтын немесе баға белгіленімі акциялар индекстеріне байланысты болатын Exchange Traded Funds (ETF) пайлары   | 14,84% | 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   | 0,00%  | 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 | 0,00%  | иә |
| 14 | Шетелдік мемлекеттік емес эмитенттердің борыштық бағалы қағаздары  | 0,00%  | иә |
| 15 | ҚР эмитенттерінің акциялары мен депозитарлық қолхаттары, басқарушы компаниясы Қазақстан Республикасының заңнамасына сәйкес құрылған заңды тұлғаның интервалды пайлық инвестициялық қорлардың пайлары   | 0,00%  | иә |
| 16 | ҚР мемлекеттік емес эмитенттерінің борыштық бағалы қағаздары   | 11,02% | иә |
| 17 | Туынды қаржы құралдары   | 0,00%  | иә |
| 18 | 10, 11,12,13 және 15-жолдарда көрсетілген қаржы құралдарының түрлері   | 14,84% | 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 |
|---------------------------------|--------|---|-----------------------|
| Купондық облигациялар (BRKZe11) | KZT    | Азия Даму Банкі                             | 186 315 901,24        |
| ҚР ҰБ ноталары (NTK028_2825)    | KZT    | "Қазақстан Республикасының Ұлттық Банкі" ММ | 233 999 965,93        |
| <b>Жиыны</b>                    |        |   | <b>420 315 867,17</b> |

**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 |        |                       |                       |
| <b>Жиыны</b>  |        |                       |                       |

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

| Құрал түрі                   | Валюта | Бағалы қағаз эмитенті                       | Мәміле сомасы, теңгемен |
|------------------------------|--------|---|-------------------------|
| ҚР ҰБ ноталары (NTK027_2823) | KZT    | "Қазақстан Республикасының Ұлттық Банкі" ММ | 242 510 400,00          |

|       |  |  |                |
|-------|--|--|----------------|
| Жиыны |  |  | 242 510 400,00 |
|-------|--|--|----------------|

**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   |        |            |                       |