

## «БЖЗҚ» АҚ зейнетақы активтерін инвестициялық басқару бойынша ақпарат

2022 жылғы 1 қазандағы жағдай бойынша «Halyk Global Markets» АҚ сенімгерлік басқаруындағы (бұдан әрі – Halyk Global Markets) БЖЗҚ зейнетақы активтері (бұдан әрі – 3А) **2 578,13** млн. теңгені құрады.

Halyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы зейнетақы активтері есебінен қалыптастырылған қаржы құралдары портфелінің құрылымы 1-кестеде көрсетілген.

**1-кесте. Қаржы құралдарының бөлігіндегі, Halyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы, БЖЗҚ 3А инвестициялық портфелінің құрылымы**

Атауы	01.01.2022 жылға ағымдағы құны	01.01.2022 жылға үлесі	01.10.2022 жылға ағымдағы құны	01.10.2022 жылға үлесі	млн. теңге 01.10.2022 ж. бастап өсуі/төмендеуі
Кері Репо (90 күнтізбелік күннен артық емес)	155,3	7,54%	147,69	5,73%	-4,90%
ҚРҰБ ноталары	120,2	5,83%	122,35	4,75%	1,79%
ҚР екінші деңгейдегі банктерінің облигациялары	125,67	6,10%	115,72	4,49%	-7,92%
ХҚҰ	296,51	14,39%	342,65	13,29%	15,56%
Шетелдік эмитенттердің үлестік құралдары (ETF пайлары)	288,4	13,99%	333,78	12,95%	15,74%
Шетелдік эмитенттердің акциялары және депозитарлық қолхаттары	0	0,00%	0	0,00%	-
Шоттардағы ақшалай қаражат	180,38	8,75%	0	0,00%	-100%
ҚР ұйымдарының корпоративтік облигациялары	892,98	43,33%	1 292,01	50,11%	44,68%
Басқа активтер (дебиторлық берешек, мерзімі өткен берешек, провизиялар)	0,38	0,02%	30,42	1,18%	7965,23%
ҚР квазимемлекеттік ұйымдарының облигациялары	1,02	0,05%	193,51	7,51%	18791,26%
<b>Halyk Global Markets басқаруындағы 3А жиынтығы</b>	<b>2 060,84</b>		<b>2 578,13</b>	<b>100,00%</b>	<b>25,10%</b>
Жасалған мәмілелер бойынша төлеуге міндеттемелер	0		0		
<b>Зейнетақы активтерінің жиынтығы</b>	<b>2 060,84</b>	<b>100,00%</b>	<b>2 578,13</b>	<b>100,00%</b>	<b>25,10%</b>

01.10.2022 ж. жағдай бойынша теңгеде номиналданған қаржы құралдарының орташа алынған кірістілігі жылдық 16,56%-ды құрады.

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

Halyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ инвестициялық портфелінде кері Репо операциялары бар, олардың ағымдағы құны есепті айда 1292,01 млн теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 50,11%-ды құрды. Кері Репо операцияларының орташа алынған кірістілігі есепті күнге жылдық 14,50%-ды құрады.

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

Қазақстан Республикасының (бұдан әрі – ҚР) екінші деңгейдегі банктері облигацияларының ағымдағы құны есепті айда 1,51 млн. теңгеге ұлғайып, 147,69 млн. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 5,73% құрайды.

Есепті күнге ҚР екінші деңгейдегі банктерінің облигацияларын өтеуге орташа алынған кірістілік жылдық 24,25%-ды құрады.

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

Есепті айда халықаралық қаржы ұйымдары облигацияларының ағымдағы құны 1,05 млн теңгеге ұлғайып, 122,35 млн теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 4,75%-ды құрайды.

Халықаралық қаржы ұйымдарының облигациялары бойынша өтеуге, теңгеде номиналданған, орташа алынған кірістілік, белгіленген сыйақы мөлшерлемесімен жылдық 16,03%-ды құрады.

#### **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 54,28 млн. теңгеге төмендеп, 333,78 млн. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 12,95%-ды құрады.

Есепті айда шетелдік эмитенттердің үлестік құралдары (ETF пайлары) 29,22 млн.теңгеге сатылды.

#### **ҚР эмитенттерінің корпоративтік облигациялары**

ҚР эмитенттерінің корпоративтік облигацияларының ағымдағы құны есепті айда 1,10 млн теңгеге ұлғайып, 115,72 млн теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 4,49%-ды құрады.

Теңгемен номиналданған ҚР эмитенттерінің корпоративтік облигацияларын өтеуге орташа алынған кірістілік есепті күнге жылдық 12,90%-ды құрайды.

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

01.10.2022 ж жағдай бойынша Halyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфелінде шетелдік эмитенттердің акциялары мен депозитарлық қолхаттары болған жоқ.

#### **ҚР квазимемлекеттік ұйымдарының облигациялары**

ҚР квазимемлекеттік ұйымдары облигацияларының ағымдағы құны есепті айда 97,28 млн. теңгеге өсіп, 342,65 млн. теңгені құрады. Бұл өсім 2022 жылғы қыркүйекте 94,92 млн. теңге сомасына KFUSb39 облигацияларын сатып алумен байланысты. Портфельдегі ҚР квазимемлекеттік ұйымдары облигацияларының үлесі 13,29%-ды құрайды.

Теңгемен номинацияланған ҚР квазимемлекеттік ұйымдарының облигацияларын өтеуге орташа алынған кірістілік есепті күнге жылдық 14,67% құрады.

#### **Валюталық құрылым**

Halyk 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, Halyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы, БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфелінің құрылымы**

Валюта	млн. теңге				
	01.01.2022 жылға ағымдағы құны	01.01.2022 жылға үлесі	01.10.2022 ж. ағымдағы құны	01.10.2022 жылға үлесі	01.01.2022 ж. бастап өсуі/төмендеуі
Ұлттық валюта	1 591,16	77,21%	2040,16	79,13%	28,22%
АҚШ доллары	469,68	22,79%	537,97	20,87%	14,54%
<b>Жыны:</b>	<b>2 060,84</b>	<b>100,00%</b>	<b>2 578,13</b>	<b>100,00%</b>	<b>25,10%</b>

### Инвестициялық қызмет нәтижелері

Инвестициялық қызмет нәтижесінде, есептелген инвестициялық табыс мөлшері (активтерді берген сәттен бастап 2022 жылғы 01 қазандағы жағдай бойынша) 142,61 млн теңгені және есептелген инвестициялық кіріс мөлшері (2022 жылғы 01 қаңтардан бастап 2022 жылғы 01 қазандағы жағдай бойынша) 29,81 млн теңгені құрады. Зейнетақы активтерінің кірістілігі қызмет басынан бері 9,67%-ды және 2022 жылдың басынан бастап 1,16%-ды құрды.

Есептелген инвестициялық табыстың құрылымы 3-кестеде көрсетілген.

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

Атауы	млн. теңге 2022 жыдың басынан бастап инвестициялық табыс
Бағалы қағаздар бойынша, оның ішінде орналастырылған салымдар және «кері РЕПО» операциялары бойынша сыйақы түріндегі кірістер	131,81
Бағалы қағаздарды нарықтық қайта бағалаудан түскен кірістер (шығындар)	-115,02
Шетел валюталарын қайта бағалаудан түскен кірістер (шығындар)	1,76
Басқа кірістер (шығындар)	11,26
<b>Жиыны:</b>	<b>29,81</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	01.09.2022	986,8120244
2	02.09.2022	986,8120244
3	03.09.2022	986,8120244
4	04.09.2022	986,8120244
5	05.09.2022	986,1961710
6	06.09.2022	986,1961710
7	07.09.2022	986,1961710
8	08.09.2022	986,1961710
9	09.09.2022	986,1961710
10	10.09.2022	986,1961710
11	11.09.2022	986,1961710
12	12.09.2022	992,9634038
13	13.09.2022	992,9634038
14	14.09.2022	992,9634038
15	15.09.2022	992,9634038
16	16.09.2022	992,9634038
17	17.09.2022	992,9634038
18	18.09.2022	992,9634038
19	19.09.2022	990,3000622
20	20.09.2022	990,3000622
21	21.09.2022	990,3000622
22	22.09.2022	990,3000622
23	23.09.2022	990,3000622
24	24.09.2022	990,3000622
25	25.09.2022	990,3000622
26	26.09.2022	985,4220319
27	27.09.2022	985,4220319
28	28.09.2022	985,4220319
29	29.09.2022	985,4220319
30	30.09.2022	986,4505793

### 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 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	8,69%	иә
	Кері РЕПО	50,11%	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	4,75%	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	12,95%	иә
9	Шетелдік мемлекеттік емес эмитенттердің борыштық бағалы қағаздары	0,00%	иә
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	23,51%	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

**Halyk 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
KFUSb39	теңге	«Қазақстанның орнықтылық қоры» АҚ	94 918 122,22
Жиыны			

<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

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

Құрал түрі	Валюта	Бағалы қағаз эмитенті	Мәміле құны, теңгемен
XLF US	USD	Financial Select Sector SPDR Fund	29 223 562,45
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 болған жоқ			
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 асырылған жоқ			
Жиыны			

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

Құрал түрі	Валюта	Банк атауы	Өтеу сомасы, теңгемен
Есепті айда салымдар бойынша өтеу жүзеге асырылған жоқ			
Жиыны			