

БЖЗҚ» АҚ Зейнетақы активтерін инвестициялық басқару бойынша ақпарат

2022 жылғы 1 қаңтардағы жағдай бойынша «Halyk Global Markets» АҚ басқаруындағы (бұдан әрі – Halyk Global Markets) БЖЗҚ зейнетақы активтері (бұдан әрі – ЗА) 2 060,84 млн. теңгені құрады.

Halyk Global Markets басқаруындағы зейнетақы активтерінің есебінен құрылған қаржы құралдарының инвестициялық портфельінің құрылымы 1-кестеде көрсетілген.

1-кесте. Қаржы құралдарының бөлігінде Halyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфельінің құрылымы

млн. теңге

Атауы	01.04.2021 жылға ағымдағы құны	01.04.2021 жылға үлесі	01.01.2022 жылға ағымдағы құны	01.01.2022 жылға үлесі	01.04.2021 ж. бастап өсуі/төмендеуі
Кері Репо (90 күнтізбелік күннен артық емес)	500,46	99,50%	892,98	43,33%	78,43%
ҚРҰБ ноталары	0	0,00%	0,00	0,00%	-
ҚР екінші деңгейдегі банктердің облигациялары	0	0,00%	155,30	7,54%	-
ХҚҰ	0	0,00%	120,20	5,83%	-
Шетелдік эмитенттердің үлестік құралдары (ETF пайлары)	0	0,00%	288,40	13,99%	-
Шетелдік эмитенттердің акциялары және депозитарлық қолхаттары	0	0,00%	180,38	8,75%	-
Шоттардағы ақшалай қаражат	2,51	0,50%	1,02	0,05%	-59,25%
ҚР ұйымдарының корпоративтік облигациялары	0	0,00%	125,67	6,10%	-
ҚР квазимемлекеттік ұйымдардың облигациялары	0	0,00%	296,51	14,39%	-
Басқа активтер (дебиторлық берешек, мерзімі өткен берешек, провизиялар)	0	0,00%	0,38	0,02%	-
Halyk Global Markets басқаруындағы ЗА жиынтығы	502,97	100,00%	2 060,84	100,00%	309,73%
Жасалған мәмілелер бойынша төлеуге міндеттемелер	0	0,00%	0	0,00%	-
Зейнетақы активтерінің жиынтығы	502,97		2 060,84		309,73%

01.01.2022 ж. жағдай бойынша теңгеге номинирленген Halyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфельіндегі борыштық қаржы құралдарының және кері Репо операцияларының орташа алынған кірістілігі жылдық 10,32% - ды құрады.

Кері Репо операциялары (90 күнтізбелік күннен артық емес)

Halyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфельіндегі негізгі үлесті кері Репо операциялары алады, олардың ағымдағы құны есепті айда 672,98 млн.теңгеге өсіп, 892,98 млн. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 43,33%-ды құрады. Теңгеге номинирленген Halyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфельіндегі кері Репо операцияларының орташа алынған кірістілігі есепті күнге жылдық 10,29% -ды құрады.

Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкі ноталары

Қаралып отырған кезеңде Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкінің 324 млн. теңге сомасына ноталары өтелді.

Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банктерінің облигациялары

Бұған қосымша, Halyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфельінде борыштық бағалы қағаздар, Қазақстан Республикасының екінші

деңгейдегі банктерінің облигациялары бар, олардың ағымдағы құны есепті айда 1,79 млн теңгеге төмендеді, 155,3 млн теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 7,54% -ды құрады.

Halyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфельіндегі Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банктерінің теңгеге номинирленген борыштық бағалы қағаздарын өтеуге орташа алынған кірістілігі есепті күнге жылдық 9,99% -ды құрады.

Халықаралық қаржы ұйымдарының облигациялары

Есепті айда халықаралық қаржы ұйымдары облигацияларының ағымдағы құны 2,22 млн теңгеге төмендеді және 120,20 млн. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 5,83% құрады.

Халықаралық қаржы ұйымдарының облигацияларын өтеуге теңгеге номинирленген орташа алынған кірістілік белгіленген сыйақы мөлшерлемесімен жылдық 11,67% құрады.

Шетелдік эмитенттердің үлестік құралдары (ETF пайлары)

Сондай-ақ, Halyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфельінде шетелдік эмитенттердің (ETF пайлары) үлестік құралдары бар, олардың ағымдағы құны есепті айда 4,88 млн.теңгеге артып, 288,4 млн.теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 13,99%-ды құрады.

Қазақстан Республикасы эмитенттерінің корпоративтік облигациялары

Осыған қосымша, Halyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфельінде ҚР эмитенттердің корпоративтік облигациялары бар, олардың ағымдағы құны есепті айда 1,01 млн.теңгеге артып, 125,67 млн.теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 6,10%-ды құрады.

Halyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфельіндегі ҚР эмитенттердің корпоративтік облигацияларын өтеуге орташа алынған кірістілігі 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 6,37 млн теңгеге азайды және 180,38 млн. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 8,75% -ды құрады.

Қазақстан Республикасының квазимемлекеттік ұйымдарының облигациялары

Бұған қоса, Halyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфельінде ҚР квазимемлекеттік ұйымдарының облигациялары бар, олардың ағымдағы құны есепті айда 43,87 млн.теңгеге артып, 296,51 млн.теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 14,39%-ды құрады.

Есепті кезеңде жылдық 10,15% мөлшеріндегі табыстылығымен 25,00 млн теңге көлемінде "Қазақстандық орнықтылық қоры" АҚ облигацияларын сатып алу жүзеге асырылды. Halyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфельіндегі ҚР квазимемлекеттік ұйымдарының облигацияларын өтеуге орташа алынған кірістілігі есепті күнге жылдық 9,71% -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	<i>млн. теңге</i>				
	01.04.2021 жылға ағымдағы құны	01.04.2021 жылға үлесі	01.01.2022 ж. ағымдағы құны	01.01.2022 ж. үлесі	01.04.2021 ж. бастап өсуі/төмендеуі
Ұлттық валюта	502,97	100%	1 591,16	77,21%	216,35%
АҚШ доллары	0,00	0,00%	469,68	22,79%	-
Жиынтығы:	502,97	100,00%	2 060,84	100,00%	309,73%

Инвестициялық қызметтің нәтижелері

Инвестициялық қызметтің нәтижесінде, есептелген инвестициялық табыс мөлшері (қызмет басталғаннан бастап 2022 жылғы 01 қаңтардағы жағдай бойынша) 112,79 млн. теңгені құрады. Зейнетақы активтерінің табыстылығы 8,41%-ды құрады.

Есептелген инвестициялық табыстың құрылымы 3-кестеде көрсетілген.

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

Атауы	<i>млн. теңге</i>	
	Есептік кезең үшін инвестициялық табыс	
Бағалы қағаздар бойынша, оның ішінде орналастырылған салымдар және «кері РЕПО» операциялары бойынша сыйақы түріндегі табыстар	74,47	
Бағалы қағаздарды нарықтық қайта бағалаудан түскен кірістер (шығындар)	39,16	
Шетел валюталарын қайта бағалаудан түскен кірістер (шығындар)	0,23	
Басқа кірістер (шығындар)	-1,07	
Жиынтығы:	112,79	

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	01.12.2021	961,2556845
2	02.12.2021	961,2556845
3	03.12.2021	961,2556845
4	04.12.2021	961,2556845
5	05.12.2021	961,2556845
6	06.12.2021	959,6965639
7	07.12.2021	959,6965639
8	08.12.2021	959,6965639
9	09.12.2021	959,6965639
10	10.12.2021	959,6965639
11	11.12.2021	959,6965639
12	12.12.2021	959,6965639
13	13.12.2021	973,1645027
14	14.12.2021	973,1645027
15	15.12.2021	973,1645027
16	16.12.2021	973,1645027
17	17.12.2021	973,1645027
18	18.12.2021	973,1645027
19	19.12.2021	973,1645027
20	20.12.2021	971,0686307
21	21.12.2021	971,0686307
22	22.12.2021	971,0686307
23	23.12.2021	971,0686307
24	24.12.2021	971,0686307
25	25.12.2021	971,0686307
26	26.12.2021	971,0686307
27	27.12.2021	974,4683098
28	28.12.2021	974,4683098

29	29.12.2021	974,4683098
30	30.12.2021	974,4683098
31	31.12.2021	975,1635583

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. 2022 жылғы 01 қаңтардағы 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	0,05%	иә
	Кері РЕПО	43,34%	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	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	11,93%	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	Халықаралық қаржы ұйымдары 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	22,75%	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 эмитенттерінің борыштық бағалы қағаздары	21,93%	иә

№	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

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

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	Мәміле құны теңгемен
Облигациялар	KZT	"Қазақстандық орнықтылық қоры" АҚ	25 000 000,00
Жиынтығы			25 000 000,00

7-кесте. Есептік айдағы бағалы қағаздардың негізгі борышын өтеу жөніндегі мәлімет

Құрал түрі	Валюта	Бағалы қағаз эмитенті	Мәміле құны теңгемен
ҚРҰБ ноталары	KZT	Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкі	324 000 000,00
Жиынтығы			324 000 000,00