

«БЖЗҚ» АҚ Зейнетақы активтерінің инвестициялық басқару бойынша ақпарат

2021 жылғы 01 желтоқсандағы жағдай бойынша «Halyk Global Markets» АҚ басқаруындағы (бұдан әрі – Halyk Global Markets) БЖЗҚ зейнетақы активтері (бұдан әрі – ЗА) 1 671,32 млн. теңгені құрады.

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

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

млн. теңге

Атауы	01.04.2021 жылға ағымдағы құны	01.04.2021 жылға үлесі	01.12.2021 жылға ағымдағы құны	01.12.2021 жылға үлесі	01.04.2021 ж. бастап өсуі/төмендеуі
Кері Репо (90 күнтізбелік күннен артық емес)	500,46	99,50%	220,00	13,16%	-56,04%
ҚРҰБ ноталары	0	0,00%	323,07	19,33%	-
ҚР екінші деңгейдегі банктердің облигациялары	0	0,00%	157,09	9,40%	-
ХҚҰ	0	0,00%	122,42	7,32%	-
Шетелдік эмитенттердің үлестік құралдары (ETF пайлары)	0	0,00%	283,52	16,96%	-
Шетелдік эмитенттердің акциялары және депозитарлық қолхаттары	0	0,00%	186,75	11,17%	-
Шоттардағы ақшалай қаражат	2,51	0,50%	1,00	0,06%	-60,21%
ҚР ұйымдарының корпоративтік облигациялары	0	0,00%	124,66	7,46%	-
ҚР квазимемлекеттік ұйымдардың облигациялары	0	0,00%	252,64	15,12%	-
Басқа активтер (дебиторлық берешек, мерзімі өткен берешек, провизиялар)	0	0,00%	0,17	0,01%	
Halyk Global Markets басқаруындағы ЗА жиынтығы	502,97	100,00%	1 671,32	100,00%	232,29%
Жасалған мәмілелер бойынша төлеуге міндеттемелер	0	0,00%	0	0,00%	-
Зейнетақы активтерінің жиынтығы	502,97		1 671,32		232,29%

01.12.2021 ж. жағдай бойынша теңгеге номинирленген Halyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфеліндегі борыштық қаржы құралдарының және кері Репо операцияларының орташа алынған кірістілігі жылдық 10,56% - ды құрады.

Кері Репо операциялары (90 күнтізбелік күннен артық емес)

Halyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфеліндегі негізгі үлесті кері Репо операциялары алады, олардың ағымдағы құны есепті айда 74,89 млн.теңгеге өсіп, 220,00 млн. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 13,16%-ды құрады. Теңгеге номинирленген Halyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфеліндегі кері Репо операцияларының орташа алынған кірістілігі есепті күнге жылдық 10,75% -ды құрады.

Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкі ноталары

Бұдан басқа, Halyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфелінде ағымдағы құны есепті айда 2,70 млн теңгеге өсіп, 323,07 млн.теңгені құраған Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкінің ноталары бар. Олардың портфельдегі үлесі 19,33%-ды құрады.

Halyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы, БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфеліндегі Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкінің ноттарын өтеуге орташа алынған кірістілік есепті күнге теңгеге номинирленген жылдық 9,33% -ды құрады.

Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банктерінің облигациялары

Бұған қосымша, Halyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфелінде борыштық бағалы қағаздар, Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банктерінің облигациялары бар, олардың ағымдағы құны есепті айда 1,51 млн теңгеге артып, 157,09 млн теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 9,40 % -ды құрады.

Halyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфеліндегі Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банктерінің теңгеге номинирленген борыштық бағалы қағаздарын өтеуге орташа алынған кірістілігі есепті күнге жылдық 11,96% -ды құрады.

Халықаралық қаржы ұйымдарының облигациялары

Есепті айда халықаралық қаржы ұйымдары облигацияларының ағымдағы құны 1,05 млн теңгеге өсті және 122,42 млн. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 7,32% құрады.

Халықаралық қаржы ұйымдарының облигацияларын өтеуге теңгеге номинирленген орташа алынған кірістілік белгіленген сыйақы мөлшерлемесімен жылдық 10,47% құрады.

Шетелдік эмитенттердің үлестік құралдары (ETF пайлары)

Сондай-ақ, Halyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфелінде шетелдік эмитенттердің үлестік құралдары бар, олардың ағымдағы құны есепті айда 6,89 млн.теңгеге артып, 283,52 млн.теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 16,96%-ды құрады.

Қазақстан Республикасы эмитенттерінің корпоративтік облигациялары

Осыған қосымша, Halyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфелінде ҚР эмитенттердің корпоративтік облигациялары бар, олардың ағымдағы құны есепті айда 1,10 млн.теңгеге артып, 124,66 млн.теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 7,46-ды құрады.

Halyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфеліндегі ҚР эмитенттердің корпоративтік облигацияларын өтеуге орташа алынған кірістілігі есепті күнге жылдық 10,99% -ды құрады.

Шетелдік эмитенттердің акциялары мен депозитарлық қолхаттары

Сондай-ақ, Halyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфелінде шетелдік эмитенттердің акциялары бар, олардың ағымдағы құны есепті айда 33,47 млн теңгеге өсті және 186,75 млн. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 11,17% -ды құрады.

Есепті кезеңде жалпы сомасы 39,98 млн теңгеге ASML Holding N. V. компаниясының депозитарлық қолхаттары мен "Сбербанк" ҚАҚ ғаламдық депозитарлық қолхаттарын сатып алу жүзеге асырылды.

Қазақстан Республикасының квазимемлекеттік ұйымдарының облигациялары

Бұған қоса, Halyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфелінде ҚР квазимемлекеттік ұйымдарының облигациялары бар, олардың ағымдағы құны есепті айда 2,18 млн.теңгеге артып, 252,64 млн.теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 15,12%-ды құрады.

Halyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфеліндегі ҚР квазимемлекеттік ұйымдарының облигацияларын өтеуге орташа алынған кірістілігі есепті күнге жылдық 10,93% -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	01.04.2021 жылға ағымдағы құны	01.04.2021 жылға үлесі	01.12.2021 ж. ағымдағы құны	01.12.2021 ж. үлесі	01.04.2021 ж. бастап өсуі/төмендеуі
Ұлттық валюта	502,97	100%	1 200,88	71,85%	138,76%
АҚШ доллары	0	0,00%	470,44	28,15%	-
Жиынтығы:	502,97	100,00%	1 671,32	100,00%	232,29%

Инвестициялық қызметтің нәтижелері

Инвестициялық қызметтің нәтижесінде, есептелген инвестициялық табыс мөлшері (қызмет басталғаннан бастап 2021 жылғы 01 желтоқсандағы жағдай бойынша) 86,15 млн. теңгені құрады. Зейнетақы активтерінің табыстылығы 6,87%-ды құрады.

Есептелген инвестициялық табыстың құрылымы 3-кестеде көрсетілген.

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

Атауы	Есептік кезең үшін инвестициялық табыс
Бағалы қағаздар бойынша, оның ішінде орналастырылған салымдар және «кері РЕПО» операциялары бойынша сыйақы түріндегі табыстар	62,90
Бағалы қағаздарды нарықтық қайта бағалаудан түскен кірістер (шығындар)	24,06
Шетел валюталарын қайта бағалаудан түскен кірістер (шығындар)	0,23
Басқа кірістер (шығындар)	-1,04
Жиынтығы:	86,15

млн. теңге

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	01.11.2021.	956,3423434
2	02.11.2021.	956,3423434
3	03.11.2021.	956,3423434
4	04.11.2021.	956,3423434
5	05.11.2021.	956,3423434
6	06.11.2021.	956,3423434
7	07.11.2021.	956,3423434
8	08.11.2021.	960,0933364
9	09.11.2021.	960,0933364
10	10.11.2021.	960,0933364
11	11.11.2021.	960,0933364
12	12.11.2021.	960,0933364
13	13.11.2021.	960,0933364
14	14.11.2021.	960,0933364
15	15.11.2021.	963,3845769
16	16.11.2021.	963,3845769
17	17.11.2021.	963,3845769
18	18.11.2021.	963,3845769
19	19.11.2021.	963,3845769
20	20.11.2021.	963,3845769

21	21.11.2021.	963,3845769
22	22.11.2021.	963,5965409
23	23.11.2021.	963,5965409
24	24.11.2021.	963,5965409
25	25.11.2021.	963,5965409
26	26.11.2021.	963,5965409
27	27.11.2021.	963,5965409
28	28.11.2021.	963,5965409
29	29.11.2021.	961,0236983
30	30.11.2021.	961,2556845

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. 2021 жылғы 01 желтоқсандағы 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	0,06%	иә
	Кері РЕПО	13,16%	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	27,02%	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 & Poog '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	7,33%	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	28,14%	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	24,29%	иә

№	Қаржы құралының түрі	Нақты мәні (зейнетақы активтерінен пайызбен)	Орындалуы (иә/жоқ)
1	Туынды қаржы құралдары, олардың:	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

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

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
Депозитарлық қолхаттар	USD	«Сбербанк» ҚАҚ	20 307 160,65
Депозитарлық қолхаттар	USD	ASML Holding N.V.	19 673 140,42
Жиынтығы	USD		39 980 301,07