

«БЖЗҚ» АҚ зейнетақы активтерін инвестициялық басқару бойынша ақпарат

2022 жылғы 1 шілдедегі жағдай бойынша «Halyk Global Markets» АҚ басқаруындағы (бұдан әрі – Halyk Global Markets) БЖЗҚ зейнетақы активтері (бұдан әрі – ЗА) **2 428,19** 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 ЗА инвестициялық портфелінің құрылымы

Атауы	01.01.2022 жылға ағымдағы құны	01.01.2022 жылға үлесі	01.07.2022 жылға ағымдағы құны	01.07.2022 жылға үлесі	млн. теңге 01.01.2022 ж. бастап өсуі/төмендеуі
Кері Репо (90 күнтізбелік күннен артық емес)	892,98	43,33%	0	0,0%	
ҚРҰБ ноталары	0	0,00%	0	0,00%	
ҚР екінші деңгейдегі банктерінің облигациялары	155,3	7,54%	135,70	5,59%	-12,62%
ХҚҰ	120,2	5,83%	100,49	4,14%	-16,40%
Шетелдік эмитенттердің үлестік құралдары (ETF пайлары)	288,4	13,99%	371,52	15,30%	28,82%
Шетелдік эмитенттердің акциялары және депозитарлық қолхаттары	180,38	8,75%	140,51	5,79%	-22,11%
Шоттардағы ақшалай қаражат	1,02	0,05%	1337,00	55,06%	130424,46%
ҚР ұйымдарының корпоративтік облигациялары	125,67	6,10%	96,49	3,97%	-23,21%
Басқа активтер (дебиторлық берешек, мерзімі өткен берешек, провизиялар)	0,38	0,02%	0,98	0,04%	159,49%
ҚР квазимемлекеттік ұйымдарының облигациялары	296,51	14,39%	245,50	10,11%	-17,20%
Halyk Global Markets басқаруындағы ЗА жиынтығы	2 060,84		2 428,19	100,00%	17,83%
Жасалған мәмілелер бойынша төлеуге міндеттемелер	0		0		
Зейнетақы активтерінің жиынтығы	2 060,84	100,00%	2 428,19	100,00%	17,83%

01.07.2022 ж. жағдай бойынша теңгеде номиналданған Halyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфеліндегі борыштық қаржы құралдарының орташа алынған кірістілігі жылдық 22,17%-ды құрады.

Кері Репо операциялары (90 күнтізбелік күннен артық емес)

01.07.2022 ж. жағдай бойынша Halyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфелінде кері Репо операциялары болған жоқ.

Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банктерінің облигациялары

Halyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфелінде Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банктерінің облигациялары

бар, олардың ағымдағы құны есепті айда 5,40 млн теңгеге азайып, 135,70 млн теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 5,59%-ды құрады.

Nalyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфеліндегі Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банктерінің теңгеде номиналданған борыштық бағалы қағаздарын өтеуге орташа алынған кірістілігі есепті күнге жылдық 22,11%-ды құрады.

Халықаралық қаржы ұйымдарының облигациялары

Есепті айда халықаралық қаржы ұйымдары облигацияларының ағымдағы құны 8,07 млн теңгеге азайып, 100,49 млн теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 4,14%-ды құрады.

Халықаралық қаржы ұйымдарының облигациялары бойынша өтеуге, теңгеде номиналданған, орташа алынған кірістілік, белгіленген сыйақы мөлшерлемесімен жылдық 26,17%-ды құрады.

Шетелдік эмитенттердің үлестік құралдары (ETF пайлары)

Nalyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфелінде шетелдік эмитенттердің үлестік құралдары (ETF пайлары) бар, олардың ағымдағы құны есепті айда 4,42 млн. теңгеге ұлғайып, 371,52 млн. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 15,30%-ды құрады.

ҚР эмитенттерінің корпоративтік облигациялары

ҚР эмитенттерінің корпоративтік облигацияларының ағымдағы құны есепті айда 13,94 млн теңгеге азайып, 96,49 млн теңгені құраған. Олардың портфельдегі үлесі 3,97%-ды құрады.

Nalyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы ҚР эмитенттерінің БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфеліндегі теңгеде номиналданған, корпоративтік облигацияларын өтеуге орташа алынған кірістілік есепті күнге жылдық 20,04%-ды құрады.

Шетелдік эмитенттердің акциялары мен депозитарлық қолхаттары

Шетелдік эмитенттер акцияларының ағымдағы құны есепті айда 5,01 млн теңгеге азайып, 140,51 млн теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 5,79%-ды құрады.

Қазақстан Республикасының квазимемлекеттік ұйымдарының облигациялары

Nalyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфелінде ҚР квазимемлекеттік ұйымдарының облигациялары бар, олардың ағымдағы құны есепті айда 19,76 млн теңгеге азайып, 245,50 млн теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 10,11%-ды құрайды.

ҚР квазимемлекеттік ұйымдарының, теңгеде номиналданған, облигацияларын өтеуге орташа алынған кірістілік есепті күнге жылдық 21,40%-ды 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, Halyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы, БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфелінің құрылымы

Валюта	<i>млн. теңге</i>				
	01.01.2022 жылға ағымдағы құны	01.01.2022 жылға үлесі	01.07.2022 ж. ағымдағы құны	01.07.2022 жылға үлесі	01.01.2022 ж. бастап осуі/төмендеуі
Ұлттық валюта	1 591,16	77,21%	1 913,17	78,79%	20,24%
АҚШ доллары	469,68	22,79%	515,02	21,21%	9,65%
Жиынтығы:	2 060,84	100,00%	2 428,19	100,00%	17,83%

Инвестициялық қызмет нәтижелері

Инвестициялық қызметтің нәтижесінде, есептелген инвестициялық табыс мөлшері (активтерді берген сәттен бастап 2022 жылғы 01 шілдедегі жағдай бойынша) (-28,12) млн теңгені және есептелген инвестициялық табыс мөлшері (2022 жылғы 01 қаңтардан бастап 2022 жылғы 01 шілдедегі жағдай бойынша) (-140,91) млн теңгені құрады. Зейнетақы активтерінің кірістілігі қызмет басынан бері 2,73%-ды және 2022 жылдың басынан бастап (-5,24%) құрды.

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>
	2022 жыдың басынан бастап инвестициялық табыс
Бағалы қағаздар бойынша, оның ішінде орналастырылған салымдар және «кері РЕПО» операциялары бойынша сыйақы түріндегі табыстар	72,16
Бағалы қағаздарды нарықтық қайта бағалаудан түскен кірістер (шығындар)	-213,28
Шетел валюталарын қайта бағалаудан түскен кірістер (шығындар)	1,63
Басқа кірістер (шығындар)	-1,42
Жиынтығы:	- 140,91

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	01.06.2022	938,7493977
2	02.06.2022	938,7493977
3	03.06.2022	938,7493977
4	04.06.2022	938,7493977
5	05.06.2022	938,7493977
6	06.06.2022	937,7283655
7	07.06.2022	937,7283655
8	08.06.2022	937,7283655
9	09.06.2022	937,7283655
10	10.06.2022	937,7283655
11	11.06.2022	937,7283655
12	12.06.2022	937,7283655
13	13.06.2022	929,0563931
14	14.06.2022	929,0563931
15	15.06.2022	929,0563931
16	16.06.2022	929,0563931
17	17.06.2022	929,0563931
18	18.06.2022	929,0563931
19	19.06.2022	929,0563931
20	20.06.2022	905,5992388
21	21.06.2022	905,5992388
22	22.06.2022	905,5992388
23	23.06.2022	905,5992388
24	24.06.2022	905,5992388

25	25.06.2022	905,5992388
26	26.06.2022	905,5992388
27	27.06.2022	923,6628075
28	28.06.2022	923,6628075
29	29.06.2022	923,6628075
30	30.06.2022	924,0766321

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. 2022 жылғы 01 шілдедегі 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	55,06%	иә
	Кері РЕПО	0%	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 & 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	4,14%	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	21,09%	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	19,67%	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

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