

«БЖЗҚ» АҚ ЗЕЙНЕТАҚЫ АКТИВТЕРІН ИНВЕСТИЦИЯЛЫҚ БАСҚАРУ БОЙЫНША АҚПАРАТ

2021 жылғы 01 мамырдағы жағдай бойынша «Halyk Global Markets» АҚ басқаруындағы (бұдан әрі – Halyk Global Markets) БЖЗҚ зейнетақы активтері (бұдан әрі – ЗА) 751,17 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

Атауы	01.04.2021 жылға ағымдағы құны	01.04.2021 жылға үлесі	01.05.2021 жылға ағымдағы құны	01.05.2021 жылға үлесі	млн. теңге Жыл басынан өсуі/төмендеуі
Кері Репо (90 күнтізбелік күннен артық емес)	500,46	99,50%	551,50	73,42%-	+10,20%
ҚР ЕДБ облигациялары	-	-	50,40	6,71%	-
Шетелдік эмитенттердің үлестік құралдары	-	-	148,18	19,73%	-
Шоттардағы ақшалай қаражат	2,51	0,50%	1,09	0,14%	-56,75%
Halyk Global Markets басқаруындағы ЗА жиынтығы	502,97	100,00%	751,17	100,00%	49,35%
Жасалған мәмілелер бойынша төлемге міндеттемелер	0,00	0,00%	0,00	0,00%	
Зейнетақы активтерінің жиынтығы	502,97		751,17		49,35%

01.05.2021 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 8,92% - 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 51,04 млн.теңгеге артып, 551,50 млн. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 73,42%-ды құрады. Теңгеге номинирленген Halyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфеліндегі кері Репо операцияларының орташа алынған кірістілігі есепті күнге жылдық 8,75% -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 50,40 млн теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 6,71% -ды құрады.

Есепті кезеңде жылдық 10,80% мөлшерінде кірістілігі бар 49,99 млн.теңге көлемінде «Отбасы банк» Тұрғын үй құрылыс жинақ банкі» АҚ-ның облигациялары сатып алынды. Halyk Global Markets, сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфеліндегі ҚР ЕДБ борыштық қаржы құралдарын есептік күнге теңгеге номинирленген өтеуге орташа алынған кірістілік жылдық 10,81% құрады.

Шетелдік эмитенттердің үлестік құралдары

Сондай-ақ, Halyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфелінде шетелдік эмитенттердің үлестік құралдары бар, олардың ағымдағы құны есепті айда 148,18 млн.теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 19,73% -ды құрады.

Есепті кезеңде жалпы сомасы 49,37 млн.теңгеге Vanguard S&P 500 ETF, жалпы сомасы 49,68 млн. теңгеге iShares 3-7 Year Treasury Bond ETF, жалпы сомасы 49,81 млн. теңгеге SPDR S&P 500 ETF биржалық инвестициялық қорларының акциялары сатып алынды.

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 сату мәмілесі мынадай параметрлермен жүзеге асырылды, 345,67 мың АҚШ доллары сатып алынды, мәміле бағамы бір АҚШ доллары үшін 430,65 теңгені құрады.

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	01.05.2021 ж. ағымдағы құны	01.05.2021 ж. үлесі	Жыл басынан өсуі/төмендеуі
Ұлттық валюта	502,97	100,00%	602,99	80,27%	+19,88%
АҚШ доллары	-	-	148,18	19,73%	-
Жиынтығы:	502,97	100,00%	751,17	100,00%	49,35%

Инвестициялық қызметтің нәтижелері

Инвестициялық қызметтің нәтижесінде, есептелген инвестициялық табыс мөлшері (қызмет басталғаннан бастап 2021 жылғы 01 мамырдағы жағдай бойынша) 5,01 млн. теңгені құрады. Зейнетақы активтерінің табыстылығы 0,8%-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	5,71	
Бағалы қағаздарды нарықтық қайта бағалаудан түскен кірістер (шығындар)	-0,02	
Шетел валюталарын қайта бағалаудан түскен кірістер (шығындар)	-0,23	
Басқа кірістер (шығындар)	-0,45	
Жиынтығы:	5,01	

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

№	датасы	Бір шартты бірліктің құны
1	01.04.2021	901,5723331
2	02.04.2021	901,5723331
3	03.04.2021	901,5723331
4	04.04.2021	901,5723331
5	05.04.2021	902,5908822
6	06.04.2021	902,5908822
7	07.04.2021	902,5908822
8	08.04.2021	902,5908822
9	09.04.2021	902,5908822
10	10.04.2021	902,5908822
11	11.04.2021	902,5908822
12	12.04.2021	903,9046237
13	13.04.2021	903,9046237
14	14.04.2021	903,9046237
15	15.04.2021	903,9046237
16	16.04.2021	903,9046237
17	17.04.2021	903,9046237
18	18.04.2021	903,9046237
19	19.04.2021	905,4164258
20	20.04.2021	905,4164258
21	21.04.2021	905,4164258

22	22.04.2021	905,4164258
23	23.04.2021	905,4164258
24	24.04.2021	905,4164258
25	25.04.2021	905,4164258
26	26.04.2021	906,7555185
27	27.04.2021	906,7555185
28	28.04.2021	906,7555185
29	29.04.2021	906,7555185
30	30.04.2021	906,6513847

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 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)
	Банктік шоттардағы қалдықтарды қосқандағы ақшалай қаражат	0,15%	иә
	Кері РЕПО	73,42%	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%	
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	Қазақстан Республикасының екінші деңгейлі банктеріндегі салымдар	0,00%	иә
4	Резидент емес банктердегі салымдар	0,00%	иә
5	Халықаралық қаржы ұйымдары шығарған борыштық бағалы қағаздар	0,00%	иә
6	Шетелдік мемлекеттердің орталық үкіметтері шығарған мемлекеттік деген мәртебесі бар бағалы қағаздар	0,00%	иә
7	Шетелдік эмитенттердің акциялары және депозитарлық қолхаттары, Exchange Traded Funds (ETF), Exchange Traded Commodities (ETC), Exchange Traded Notes (ETN) пайлары	19,72%	иә
8	Шетелдік мемлекеттік емес эмитенттердің борыштық бағалы қағаздары	0,00%	иә
9	ҚР эмитенттерінің акциялары және депозитарлық қолхаттары, басқарушы компаниясы Қазақстан Республикасының заңнамасына сәйкес құрылған заңды тұлғаның интервалды пайлық инвестициялық қорлардың пайлары	0,00%	иә
10	ҚР мемлекеттік эмитенттерінің борыштық бағалы қағаздары	6,71%	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

Налық 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	Номиналды құны теңгемен
Облигациялар	KZT	«Отбасы банк» Тұрғын үй жинақ банкі» АҚ	49 993 000,00
Биржалық инвестициялық қорлардың акциялары (пайлары)	USD	Vanguard S&P 500 ETF (эмитент – Vanguard)	49 374 640,20
Биржалық инвестициялық қорлардың акциялары (пайлары)	USD	iShares 3-7 Year Treasury ETF (эмитент – Blackrock)	49 683 107,49
Биржалық инвестициялық қорлардың акциялары (пайлары)	USD	SPDR S&P 500 ETF (эмитент – State Street Global Advisors)	49 807 205,11
Жиынтығы			198 857 952,80

7-кесте. Есептік айда қаржы құралдарын сату бойынша мәлімет

Құрал түрі	Валюта	Бағалы қағаз эмитенті	Мәміле сомасы теңгемен
Жиынтығы			

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

Құрал түрі	Валюта	Бағалы қағаз эмитенті	Мәміле сомасы теңгемен
Жиынтығы			

9-кесте. Есептік айдағы шетелдік банктердің салымдарына орналыстырылғандар жөніндегі мәлімет

Құрал түрі	Валюта	Банк атауы	Өтелетін сомасы теңгемен
Жиынтығы			

10-кесте. Есептік айдағы салымдар бойынша негізгі борышты өтеу бойынша мәлімет

Құрал түрі	Валюта	Банк атауы	Өтелетін сомасы теңгемен
Жиынтығы			