

**«БЖЗҚ» АҚ ЗЕЙНЕТАҚЫ АКТИВТЕРІН
ИНВЕСТИЦИЯЛЫҚ БАСҚАРУ БОЙЫНША АҚПАРАТ**

2021 жылғы 01 қыркүйектегі жағдай бойынша «Halyk Global Markets» АҚ басқаруындағы (бұдан әрі – Halyk Global Markets) БЖЗҚ зейнетақы активтері (бұдан әрі – ЗА) 1 438,67 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	01.09.2021 жылға ағымдағы құны	01.09.2021 жылға үлесі	01.04.2021 ж. бастап өсуі/төмендеуі
Кері Репо (90 күнгізбелік күннен артық емес)	500,46	99,50%	14,01	0,97%	-97,20%
ҚР ноталары	0	0,00%	478,97	33,29%	-
ҚР екінші деңгейдегі банктердің облигациялары	0	0,00%	153,50	10,67%	-
Шетелдік эмитенттердің үлестік құралдары (ETF пайлары және акциялары)	0	0,00%	277,30	19,27%	-
Шетелдік эмитенттердің акциялары мен депозитарлық қолхаттары	0	0,00%	132,54	9,21%	-
Шоттардағы ақшалай қаражат	2,51	0,50%	135,45	9,41%	5296,25%
ҚР эмитенттерінің корпоративтік облигациялары	0	0,00%	121,36	8,44%	-
ҚР квазимемлекеттік ұйымдарының облигациялары	0	0,00%	125,54	8,73%	-
Halyk Global Markets басқаруындағы ЗА жиынтығы	502,97	100,00%	1 438,67	100,00%	186,03%
Жасалған мәмілелер бойынша төлемге міндеттемелер	0	0,00%	0	0,00%	-
Зейнетақы активтерінің жиынтығы	502,97		1 438,67		186,03%

01.09.2021 ж. жағдай бойынша теңгеге номинирленген Halyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфеліндегі борыштық қаржы

құралдарының және кері Repo операцияларының орташа алынған кірістілігі жылдық 9,99 % - ды құрады.

Кері Repo операциялары (90 күнтізбелік күннен артық емес)

Halyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфелінде кері Repo операциялары бар, олардың ағымдағы құны есепті айда 165,04 млн.теңгеге азайып, 14,01 млн. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 0,97%-ды құрады. Теңгеге номинирленген Halyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфеліндегі кері Repo операцияларының орташа алынған кірістілігі есепті күнге жылдық 8,89% -ды құрады.

Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкі ноталары

Halyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфеліндегі негізгі үлесті ағымдағы құны есепті айда 478,97 млн.теңгені құраған Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкінің ноталары алады. Олардың портфельдегі үлесі 33,29 %-ды құрады.

Қарастырылып отырған кезеңде 300,00 млн. теңге сомасына Қазақстан Республикасы Ұлттық банкінің 28 күндізгі ноталары өтелді.

Есепті кезеңде жылдық 9,18% мөлшеріндегі табыстылығымен 300,00 млн. теңге көлемінде Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкінің ноталары сатып алынды. Halyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы, БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфеліндегі Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкінің ноттарын өтеуге орташа алынған кірістілік есепті күнге теңгеге номинирленген жылдық 9,16% -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 103,81 млн теңгеге артып, 153,5 млн теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 10,67% -ды құрады.

Есепті кезеңде "Хоум Кредит энд Финанс Банк" АҚ ЕБ жылдық 12,49% мөлшеріндегі кірістілігімен 100,00 млн теңге көлемінде облигацияларын сатып алу жүзеге асырылды.

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 11,83%-ды құрады.

Шетелдік эмитенттердің үлестік құралдары (ETF пайлары)

Сондай-ақ, Halyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфелінде шетелдік эмитенттердің (ETF пайлары) үлестік құралдары бар, олардың ағымдағы құны есепті айда 18,27 млн.теңгеге артып, 277,30 млн.теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 19.27%-ды құрады.

Есепті кезеңде Energy Select Sector SPDR Fund биржалық инвестициялық қорының акцияларын жалпы сомасы 10,72 млн.теңгеге сатып алу жүзеге асырылды.

ҚР эмитенттерінің корпоративтік облигациялары

Сонымен қатар, Halyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфелінде ҚР эмитенттерінің корпоративтік облигациялары бар, олардың ағымдағы құны есепті айда 1,10 млн теңгеге артып, 121,36 млн. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 8,44% - ды құрады.

Halyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы ҚР эмитенттерінің БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфеліндегі теңгемен номиналданған корпоративтік облигацияларын өтеуге орташа алынған кірістілік 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 33,36 млн теңгеге артып, 132,54 млн. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 9,21% -ды құрады.

Есепті кезеңде жалпы сомасы 8,48 млн теңгеге Amazon.com, жалпы сомасы 8,33 млн теңгеге Apple Inc., жалпы сомасы 8,35 млн теңгеге Facebook шетелдік эмитенттерінің акцияларын сатып алу жүзеге асырылды.

ҚР квазимемлекеттік ұйымдарының облигациялары

Бұған қосымша, Halyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ за инвестициялық портфелінде ҚР квазимемлекеттік ұйымдарының облигациялары бар, олардың ағымдағы құны есепті айда 25,95-ке млн теңгеге өсіп, 125,54 млн теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 8,73% - ды құрады.

Есепті кезеңде жылдық 9,84% мөлшеріндегі табыстылығымен 25,08 млн. теңге көлемінде "Қазақстанның орнықтылық қоры" АҚ облигацияларын сатып алу жүзеге асырылды. Halyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы ҚР квазимемлекеттік ұйымдарының БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфеліндегі теңгемен номиналданған облигацияларын өтеуге орташа алынған кірістілік есепті күнге жылдық 10,09%-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

млн. теңге

Валюта	01.04.2021 жылға ағымдағы құны	01.04.2021 жылға үлесі	01.09.2021 ж. ағымдағы құны	01.09.2021 ж. үлесі	01.04.2021 ж. бастап өсуі/төмендеуі
Ұлттық валюта	502,97	100%	1 014,41	70,51%	101,68%
АҚШ доллары	0	0,00%	424,26	29,49%	-
Жиынтығы:	502,97	100,00%	1 438,67	100,00%	186,03%

Инвестициялық қызметтің нәтижелері

Инвестициялық қызметтің нәтижесінде, есептелген инвестициялық табыс мөлшері (қызмет басталғаннан бастап 2021 жылғы 01 тамыздағы жағдай бойынша) 53,24 млн. теңгені құрады. Зейнетақы активтерінің табыстылығы 4,73 %-ды құрады.

Есептелген инвестициялық табыстың құрылымы 3-кестеде көрсетілген.

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

млн. теңге

Атауы	Есептік кезең үшін инвестициялық табыс
Бағалы қағаздар бойынша, оның ішінде орналастырылған салымдар және «кері РЕПО» операциялары бойынша сыйақы түріндегі табыстар	32,80
Бағалы қағаздарды нарықтық қайта бағалаудан түскен кірістер	21,56

(шығындар)	
Шетел валюталарын қайта бағалаудан түскен кірістер (шығындар)	0,07
Басқа кірістер (шығындар)	-1,19
Жиынтығы:	53,24

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

№	Дата	Бір шартты бірліктің құны
1	02.08.2021	927,2149755
2	09.08.2021	934,3680826
3	16.08.2021	938,0875149
4	23.08.2021	934,6490444
5	31.08.2021	942,0439024

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 маусымдағы 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	9.41%	иә
	Кері РЕПО	0.97%	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	33.29%	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

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

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	28.49%	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 емес эмитенттерінің борыштық бағалы қағаздары	19.11%	иә

№	Қаржы құралының түрі	Нақты мәні (зейнетақы активтерінен пайызбен)	Орынд алуы (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

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	Мәміленің құны, теңгемен
ҚРҰБ ноттары	KZT	Қазақстан Республикасының Ұлттық Банкі	297 902 100,00
Облигациялар	KZT	«Хоум Кредит энд Финанс Банк» АҚ ЕБ	102 697 555,56
Облигациялар	KZT	«Қазақстандық орнықтылық қоры» АҚ	24 999 424,33
Акциялар	USD	Amazon.com	8 479 491,75
Акциялар	USD	Apple Inc	8 333 234,43
Акциялар	USD	Facebook Inc.	8 347 739,40
Биржалық инвестициялық қорлардың акциялары (пайлары)	USD	Energy Select Sector SPDR Fund	10 721 416,24
Жиынтығы			461 480 961,71

7-кесте. Есепті айда қаржы құралдары бойынша негізгі борышты өтеу бойынша мәлімет

Құрал түрі	Валюта	Бағалы қағаз эмитенті	Номиналды құны теңгемен
ҚРҰБ ноттары	KZT	Қазақстан Республикасының Ұлттық Банкі	300 000 000,00
Жиынтығы			300 000 000,00