

**«Сентрас Секьюритиз» АҚ сенімгерлік басқаруындағы
«БЖЗҚ» АҚ зейнетақы активтерін
инвестициялық басқару бойынша ақпарат**

2022 жылғы 1 тамыздағы жағдай бойынша «Сентрас Секьюритиз» АҚ (бұдан әрі - Сентрас Секьюритиз) сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ зейнетақы активтері (бұдан әрі – ЗА) 952,87 млн. теңгені құрап отыр.

Сентрас Секьюритиз сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ зейнетақы активтері есебінен құралған қаржы құралдарының инвестициялық портфелінің құрылымы 1-кестеде берілді.

1-кесте. Қаржы құралдарының бөлігінде Сентрас Секьюритиз сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфелінің құрылымы

Атауы	01.01.2022 жылға ағымдағы құны	01.01.2022 жылға үлесі	01.08.2022 жылға ағымдағы құны	01.08.2022 жылға үлесі	Жыл басынан бергі өсу/төмендеу
ҚР ҚМ МБҚ	560,90	69,29%	516,53	54,21%	-7,91%
ҚР эмитенттерінің акциялары мен депозитарлық қолхаттары	119,26	14,73%	87,84	9,22%	-26,35%
Шетелдік эмитенттердің үлестік құралдары (ETF пайлары)	0,00	0,00%	17,69	1,86%	0,00%
Репо	127,09	15,70%	152,23	15,98%	19,78%
Басқа активтер (дебиторлық берешек, мерзімі өткен берешек, провизиялар)	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00%
Инвестициялық шоттардағы ақшалай қаражат	2,20	0,27%	178,58	18,74%	8022,06%
ИПБ басқаруындағы ЗА жиынтығы	809,46	100,00%	952,87	100,00%	17,72%
Жасалған мәмілелер бойынша төлемге міндеттемелер	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00%
Зейнетақы активтерінің жиынтығы	809,46		952,87		17,72%

01.08.2022 жылғы жағдай бойынша теңгемен номиналданған борыштық қаржы құралдарын және РЕПО өтеуге орташа алынған кірістілік (ҮТМ) – жылына 11,99%.

Ақшалай қаражат және кері РЕПО операциялары

Есепті айдағы кері Repo операцияларының ағымдағы құны – 152,23 млн. теңге. Олардың портфельдегі үлесі – 15,98%. Есепті кезең соңындағы инвестициялық шоттардағы ақшалай қаражат қалдығы – 178,58 млн. теңге. Есепті ай соңындағы ақшалай қаражат пен кері Repo операциялары бойынша талаптардың жиынтық үлесі – 34,72%.

Қазақстан Республикасы Қаржы министрлігінің мемлекеттік бағалы қағаздары

Портфельдің негізгі үлесін алып тұрған Қазақстан Республикасы Қаржы министрлігінің мемлекеттік бағалы қағаздарының ағымдағы құны есепті ай соңында 516,53 млн. теңге болды. Олардың портфельдегі үлесі – 54,21%.

Есепті күндегі теңгемен номиналданған ҚР Қаржы министрлігінің МБҚ бойынша өтеуге орташа алынған кірістілік – жылына 11,54%.

Қазақстан Республикасы эмитенттерінің акциялары мен депозитарлық қолхаттары

Қазақстан Республикасы эмитенттерінің акциялары мен депозитарлық қолхаттарының ағымдағы құны есепті ай соңында 87,84 млн. теңге болды. Олардың портфельдегі үлесі – 9,22%.

Шетелдік эмитенттердің үлестік құралдары (ETF пайлары)

Шетелдік эмитенттердің үлестік құралдарының (ETF пайлары) ағымдағы құны есепті ай соңында 17,69 млн. теңге болды. Олардың портфельдегі үлесі – 1,86%. Есепті кезеңде Сентрас Секьюритиз сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА портфелінің құрамына ETF сатып алынған жоқ.

Валюталық құрылым

Сентрас Секьюритиз сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ зейнетақы активтерінің есебінен сатып алынған қаржы құралдары номиналданған валюталар бөлігінде қаржы құралдарының инвестициялық портфелі 2-кестеде берілді.

Есепті кезеңде Қазақстанның қор биржасында шетелдік валютамен сатып алу-сату мәмілелері жасалған жоқ.

2-кесте. Валюталар бөлігінде Сентрас Секьюритиз сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфелінің құрылымы

млн теңге

Валюта	01.01.2022 жылғы ағымдағы құны	01.01.2022 жылғы үлесі	01.08.2022 жылғы ағымдағы құны	01.08.2022 жылғы үлесі	Жыл басынан бергі өсу/төмендеу
Ұлттық валюта	809,46	100%	785,28	82,41%	-2,99%
АҚШ доллары	0,00	0,00	167,60	17,59%	-
Ресей рублі	0,00	0,00	0,00	0,00%	-
Басқа валюталар	0,00	0,00	0,00	0,00%	-
Жиыны:	809,46	100%	952,87	100%	17,72%

Инвестициялық қызмет нәтижесі

Инвестициялық қызметтің және қаржы құралдарының нарықтық құнының өзгеруі нәтижесінде 2022 жыл басынан бері есептелген инвестициялық табыс мөлшері 7,15 млн. теңге болды. 2022 жыл басынан бергі зейнетақы активтерінің кірістілігі 0,34% болып отыр.

Көрсетілген кезеңдегі есептелген инвестициялық табыс құрылымы 3-кестеде берілді.

3-кесте. Сентрас Секьюритиз сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА бойынша алған инвестициялық табыс құрылымы

млн теңге

Атауы	2022 жылғы инвестициялық табыс
Бағалы қағаздар бойынша, оның ішінде орналастырылған салымдар және «кері РЕПО» операциялары бойынша сыйақы түріндегі табыс	49,46
Бағалы қағаздарды нарықтық қайта бағалаудан, шетелдік валютаны қайта бағалаудан түскен табыс (шығын) және басқа табыс (шығын)	-42,31
Жиыны:	7,15

Шартты бірлік құны туралы ақпарат

Сентрас Секьюритиз сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА шартты зейнетақы бірлігі құнының динамикасы 4-кестеде берілді.

4-кесте. Сентрас Секьюритиз сенімгерлік басқаруындағы бір шартты бірлік құны

№	Күні	Шартты бірлік құны
1	01.07.2022	971,9377627
2	02.07.2022	971,9377627
3	03.07.2022	971,9377627
4	04.07.2022	978,3976472
5	05.07.2022	978,3976472
6	06.07.2022	978,3976472
7	07.07.2022	978,3976472
8	08.07.2022	978,3976472
9	09.07.2022	978,3976472
10	10.07.2022	978,3976472
11	11.07.2022	979,9556119
12	12.07.2022	979,9556119
13	13.07.2022	979,9556119
14	14.07.2022	979,9556119
15	15.07.2022	979,9556119
16	16.07.2022	979,9556119
17	17.07.2022	979,9556119
18	18.07.2022	984,7137721
19	19.07.2022	984,7137721
20	20.07.2022	984,7137721
21	21.07.2022	984,7137721
22	22.07.2022	984,7137721
23	23.07.2022	984,7137721
24	24.07.2022	984,7137721
25	25.07.2022	994,1342176
26	26.07.2022	994,1342176
27	27.07.2022	994,1342176
28	28.07.2022	994,1342176
29	29.07.2022	994,1342176
30	30.07.2022	994,1342176
31	31.07.2022	995,5037751

Инвестициялық декларация өлшемдерін сақтау туралы ақпарат

Сентрас Секьюритиз сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА құрылымдық бөлу Инвестициялық декларация талаптарына сәйкес. Валюталық позициялар үлесі рұқсат етілген деңгей шегінде қалады және Инвестициялық декларацияның талаптарын бұзбайды. 2022 жылғы 1 тамыздағы жағдай бойынша Сентрас Секьюритиз сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА бойынша инвестициялау шектерін сақтау туралы мәлімет 5-кестеде берілді.

5-кесте. Сентрас Секьюритиз сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА бойынша инвестициялау шектері

№	Қаржы құралының түрі	Нақты мәні (ЗА жалпы көлемінен пайызбен)	Орындалуы (иә/жоқ)
1	Ұлттық валютадағы ақшалай қаражат – теңге (KZT)	3,01%	иә

2	Қаулыға сай басқа елдердің шетелдік валютасы	15,73%	иә
3	ҚР Қаржы министрлігі және ҚР Ұлттық Банкі шығарған ҚР мемлекеттік бағалы қағаздары (оның ішінде шетелдік мемлекеттердің заңнамасына сәйкес эмиссияланған), сондай-ақ ҚР Үкіметінің кепілімен және (немесе) кепілдігімен шығарылған БҚ	54,21%	иә
4	ҚР жергілікті атқару органдары шығарған борыштық БҚ	0,00%	иә
5	Акцияларының жүз пайызы ҚР Ұлттық Банкіне тиесілі заңды тұлға шығарған борыштық БҚ	0,00%	иә
6	ҚР және басқа мемлекеттердің заңнамасына сәйкес «Қазақстан Даму банкі», «Самұрық-Қазына» Ұлттық әл-ауқат қоры», «Бәйтерек» Ұлттық басқарушы холдингі», «Проблемалы кредиттер қоры» акционерлік қоғамдары шығарған борыштық БҚ	0,00%	иә
7	Қаулыға сай ҚР екінші деңгейдегі банктеріндегі салымдар	0,00%	иә
8	Қаулыға сай бейрезидент банктердегі салымдар	0,00%	иә
9	Standard & Poor's (Стандарт энд Пурс) агенттігінің халықаралық шәкіл бойынша «ВВ+» деңгейінен төмен емес рейтинг бағасы немесе Moody's Investors Service (Мудис Инвесторс Сервис) немесе Fitch (Фич) агенттіктерінің ұқсас деңгейдегі рейтинг бағасы бар төмендегі халықаралық қаржы ұйымдары шығарған борыштық бағалы қағаздар: Азиялық даму банкі (the Asian Development Bank); Америкалық даму банкі (the Inter-American Development Bank); Африкалық даму банкі (the African Development Bank); Еуразиялық даму банкі (Eurasian Development Bank); Еуропалық қайта құру және даму банкі (the European Bank for Reconstruction and Development); Еуропалық инвестициялық банк (the European Investment Bank); Еуропалық Кеңестің Даму банкі (the Council of Europe Development Bank); Ислам жеке секторды дамыту корпорациясы (the Islamic Corporation for the Development of the Private Sector); Ислам даму банкі (the Islamic Development Bank); Көпқырлы инвестициялар кепілі агенттігі (the Multilateral Investment Guarantee Agency); Скандинав инвестициялық банкі (the Nordic Investment Bank); Халықаралық валюта қоры (the International Monetary Fund); Халықаралық даму қауымдастығы (the International Development Association); Халықаралық инвестициялық дауларды реттеу орталығы (the International Centre for Settlement of Investment Disputes); Халықаралық қайта құру және даму банкі (the International Bank for Reconstruction and Development); Халықаралық қаржы корпорациясы (the International Finance Corporation).	0,00%	иә
10	Қаулыға сай шетелдік мемлекеттердің үкіметтері шығарған мемлекеттік мәртебесі бар БҚ	0,00%	иә
11	Шетелдік ұйымдар шығарған мемлекеттік емес БҚ: *Standard & Poor's (Стандарт энд Пурс) агенттігінің халықаралық шәкіл бойынша «ВВ» деңгейінен төмен емес рейтинг бағасы немесе Moody's Investors Service (Мудис Инвесторс Сервис) немесе Fitch (Фич) агенттіктерінің ұқсас деңгейдегі рейтинг бағасы бар шетелдік эмитенттердің акциялары; *негізгі қор индекстері құрамына кіретін шетелдік эмитенттердің акциялары және осы акциялар базалық активі болып табылатын депозитарлық қолхаттар; * борыштық БҚ Standard & Poor's (Стандарт энд Пурс) агенттігінің халықаралық шәкіл бойынша «ВВ» деңгейінен төмен емес рейтинг бағасы немесе Moody's Investors Service (Мудис Инвесторс Сервис) немесе Fitch (Фич) агенттіктерінің ұқсас деңгейдегі рейтинг бағасы бар	0,00%	иә
12	Қаулыға сай ҚР және басқа мемлекеттердің заңнамасына сәйкес ҚР ұйымдары шығарған мемлекеттік емес БҚ	9,22%	иә
13	Қаулыға сай Exchange Traded Funds (Эксчейндж Трэйдэд Фандс), Exchange, Traded Commodities (Эксчейндж Трэйдэд Коммодитис), Exchange Traded Notes (Эксчейндж Трэйдэд Ноутс) пайлары	1,86%	иә
14	Қаулыға сай қор биржасының ресми тізіміне қосылған ҚР заңнамасына сәйкес құрылған заңды тұлға басқарушы компаниясы болып табылатын интервал пайлық инвестициялық қорлардың пайлары	0,00%	иә
15	Қаулыға сай аффинирленген асыл металдар	0,00%	иә
16	Қаулыға сай хеджирлеу мақсатында жасалған туынды қаржы құралдары	0,00%	иә

Сентрас Секьюритиз сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфеліндегі қаржы құралдарын сатып алу, сату және өтеу бойынша ақпарат

6-кесте. Есепті айдағы қаржы құралдарын сатып алу бойынша мәлімет

Құрал түрі	Валюта	Бағалы қағаз эмитенті	Теңгемен мәміле сомасы
-	-	-	-
Жиыны			

7-кесте. Есепті айдағы қаржы құралдарын сату бойынша мәлімет

Құрал түрі	Валюта	Бағалы қағаз эмитенті	Теңгемен мәміле сомасы
-	-	-	-
Жиыны			