

**«БЖЗҚ» АҚ зейнетақы активтерін  
инвестициялық басқару бойынша ақпарат**

2022 жылғы 1 қыркүйектегі жағдай бойынша «Halyk Global Markets» АҚ сенімгерлік басқаруындағы (бұдан әрі – Halyk Global Markets) БЖЗҚ зейнетақы активтері (бұдан әрі – ЗА) **2 575,64** 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**

*млн. теңге*

<b>Атауы</b>	<b>01.01.2022 жылға ағымдағы құны</b>	<b>01.01.2022 жылға үлесі</b>	<b>01.09.2022 жылға ағымдағы құны</b>	<b>01.09.2022 жылға үлесі</b>	<b>01.01.2022 ж. бастап өсуі/төмендеуі</b>
Кері Репо (90 күнтізбелік күннен артық емес)	155,3	7,54%	146,18	5,68%	-5,87%
ҚРҰБ ноталары	120,2	5,83%	121,30	4,71%	0,92%
ҚР екінші деңгейдегі банктерінің облигациялары	125,67	6,10%	114,62	4,45%	-8,79%
ХҚҰ	296,51	14,39%	245,36	9,53%	-17,25%
Шетелдік эмитенттердің үлестік құралдары (ETF пайлары)	288,4	13,99%	388,06	15,07%	34,56%
Шетелдік эмитенттердің акциялары және депозитарлық колхаттары	0	0,00%	0	0,00%	
Шоттардағы ақшалай қаражат	180,38	8,75%	0,00	0,00%	-100,00%
ҚР ұйымдарының корпоративтік облигациялары	892,98	43,33%	1 332,30	51,73%	49,20%
Басқа активтер (дебиторлық берешек, мерзімі өткен берешек, провизиялар)	0,38	0,02%	0	0,00%	-100,00%
ҚР квазимемлекеттік ұйымдарының облигациялары	1,02	0,05%	227,82	8,85%	22141,17%
<b>Halyk Global Markets басқаруындағы ЗА жиынтығы</b>	<b>2 060,84</b>		<b>2 575,64</b>	<b>100,00%</b>	<b>24,98%</b>
Жасалған мәмілелер бойынша төлеуге міндеттемелер	0		0		
<b>Зейнетақы активтерінің жиынтығы</b>	<b>2 060,84</b>	<b>100,00%</b>	<b>2 575,64</b>	<b>100,00%</b>	<b>24,98%</b>

01.09.2022 ж. жағдай бойынша теңгеде номиналданған Halyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфеліндегі борыштық қаржы құралдарының орташа алынған кірістілігі жылдық 15,61%-ды құрады.

### **Кері Репо операциялары (90 күнтізбелік күннен артық емес)**

Nalyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ инвестициялық портфелінде кері Репо операциялары бар, олардың ағымдағы құны есепті айда 1332,30 млн теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 51,73%-ды құрды. Nalyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы, теңгемен номиналданған, БЖЗҚ за инвестициялық портфеліндегі кері Репо операцияларының орташа алынған кірістілігі есепті күнге жылдық 13,80%-ды құрады.

### **Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банктерінің облигациялары**

Nalyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфелінде Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банктерінің облигациялары бар, олардың ағымдағы құны есепті айда 8,97 млн теңгеге ұлғайып, 146,18 млн теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 5,68%-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 21,08%-ды құрады.

### **Халықаралық қаржы ұйымдарының облигациялары**

Есепті айда халықаралық қаржы ұйымдары облигацияларының ағымдағы құны 1,05 млн теңгеге ұлғайып, 121,30 млн теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 4,71%-ды құрады.

Халықаралық қаржы ұйымдарының облигациялары бойынша өтеуге, теңгеде номиналданған, орташа алынған кірістілік, белгіленген сыйақы мөлшерлемесімен жылдық 15,81%-ды құрады.

### **Шетелдік эмитенттердің үлестік құралдары (ETF пайлары)**

Nalyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфелінде шетелдік эмитенттердің үлестік құралдары (ETF пайлары) бар, есепті айда олардың ағымдағы құны 0,25 млн. теңгеге аздап ұлғайып, 388,06 млн. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 15,07%-ды құрады.

### **ҚР эмитенттерінің корпоративтік облигациялары**

Nalyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфелінде ҚР эмитенттерінің корпоративтік облигациялары бар, олардың ағымдағы құны есепті айда 1,10 млн теңгеге ұдғайып, 114,62 млн теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 4,45%-ды құрады.

Nalyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы ҚР эмитенттерінің БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфеліндегі теңгеде номиналданған, корпоративтік облигацияларын өтеуге орташа алынған кірістілік есепті күнге жылдық 12,87%-ды құрады.

### **Шетелдік эмитенттердің акциялары мен депозитарлық қолхаттары**

01.09.2022 ж. жағдай бойынша Nalyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА бойынша инвестициялық портфельде шетелдік эмитенттердің акциялары мен депозитарлық қолхаттары болған жоқ.

Есепті айда шетелдік эмитенттердің акциялары мен депозитарлық қолхаттары 155,6 млн.теңгеге сатылды.

### **Қазақстан Республикасының квазимемлекеттік ұйымдарының облигациялары**

Бұған қоса, Nalyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфелінде ҚР квазимемлекеттік ұйымдарының облигациялары бар, олардың ағымдағы құны есепті айда 32,10 млн теңгеге төмендеп, 245,36 млн теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 9,53%-ды құрайды.

ҚР квазимемлекеттік ұйымдарының, теңгеде номиналданған, облигацияларын өтеуге орташа алынған кірістілік есепті күнге жылдық 13,53%-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, Nalyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы, БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфелінің құрылымы

*млн. теңге*

Валюта	01.01.2022 жылға ағымдағы құны	01.01.2022 жылға үлесі	01.09.2022 ж. ағымдағы құны	01.09.2022 жылға үлесі	01.01.2022 ж. бастап өсуі/төмендеуі
Ұлттық валюта	1 591,16	77,21%	2015,59	78,26%	26,67%
АҚШ доллары	469,68	22,79%	560,05	21,74%	19,24%
<b>Жиынтығы:</b>	<b>2 060,84</b>	<b>100,00%</b>	<b>2 575,64</b>	<b>100,00%</b>	<b>24,98%</b>

## Инвестициялық қызмет нәтижелері

Инвестициялық қызметтің нәтижесінде, есептелген инвестициялық табыс мөлшері (активтерді берген сәттен бастап 2022 жылғы 01 қыркүйектегі жағдай бойынша) 143,33 млн теңгені және есептелген инвестициялық табыс мөлшері (2022 жылғы 01 қаңтардан бастап 2022 жылғы 01 қыркүйектегі жағдай бойынша) 30,54 млн теңгені құрады. Зейнетақы активтерінің кірістілігі қызмет басынан бері 9,71%-ды және 2022 жылдың басынан бастап 1,19%-ды құрды.

Есептелген инвестициялық табыстың құрылымы 3-кестеде көрсетілген.

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

*млн. теңге*

Атауы	2022 жыдың басынан бастап инвестициялық табыс
Бағалы қағаздар бойынша, оның ішінде орналастырылған салымдар және «кері РЕПО» операциялары бойынша сыйақы түріндегі табыстар	108,85
Бағалы қағаздарды нарықтық қайта бағалаудан түскен кірістер (шығындар)	-90,23
Шетел валюталарын қайта бағалаудан түскен кірістер (шығындар)	0,13
Басқа кірістер (шығындар)	11,79
<b>Жиынтығы:</b>	<b>30,54</b>

## Шартты бірліктің құны туралы ақпарат

Nalyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА шартты зейнетақы бірлігі құнының динамикасы 4-кестеде көрсетілген.

4-кесте. Nalyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА бір шартты бірлігінің құны

№	Күні	Бір шартты бірліктің құны
1	01.08.2022	982,0356156
2	02.08.2022	982,0356156
3	03.08.2022	982,0356156
4	04.08.2022	982,0356156
5	05.08.2022	982,0356156
6	06.08.2022	982,0356156
7	07.08.2022	982,0356156
8	08.08.2022	982,7319418
9	09.08.2022	982,7319418
10	10.08.2022	982,7319418
11	11.08.2022	982,7319418

12	12.08.2022	982,7319418
13	13.08.2022	982,7319418
14	14.08.2022	982,7319418
15	15.08.2022	994,6995834
16	16.08.2022	994,6995834
17	17.08.2022	994,6995834
18	18.08.2022	994,6995834
19	19.08.2022	994,6995834
20	20.08.2022	994,6995834
21	21.08.2022	994,6995834
22	22.08.2022	993,6751752
23	23.08.2022	993,6751752
24	24.08.2022	993,6751752
25	25.08.2022	993,6751752
26	26.08.2022	993,6751752
27	27.08.2022	993,6751752
28	28.08.2022	993,6751752
29	29.08.2022	993,6751752
30	30.08.2022	993,6751752
31	31.08.2022	986,8120244

### 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 келеді<sup>1</sup>. 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 қыркүйектегі 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	8,85%	иә
	Кері РЕПО	51,73%	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 & Poor '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	4,71%	иә

<sup>1</sup> 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

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	15,07%	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	19,65%	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

**Налық Global Markets сенімгерлік басқаруындағы зейнетақы активтері есебінен қалыптастырылған қаржы құралдары портфеліндегі қаржы құралдарын сатып алу, сату және өтеу жөніндегі ақпарат**

**Кесте 6. Есепті айда қаржы құралдарын сатып алу бойынша мәліметтер**

Құрал түрі	Валюта	Бағалы қағаз эмитенті	Мәміле құны, теңгемен
Жиыны			

**Кесте 7. Есепті айда қаржы құралдарын сату бойынша мәліметтер**

Құрал түрі	Валюта	Бағалы қағаз эмитенті	Мәміле құны, теңгемен
Жиыны			

**Кесте 8. Есепті айда бағалы қағаздар бойынша негізгі борышты өтеу жөніндегі мәліметтер**

Құрал түрі	Валюта	Бағалы қағаз эмитенті	Мәміле сомасы, теңгемен
Облигация (KFUSb16)	теңге	"Қазақстандық орнықтылық қоры" АҚ	25 079 000,00
Жиыны			25 079 000,00

**Кесте 9. Есепті айда шетелдік банктердің салымдарына орналастыру жөніндегі мәліметтер**

Вид инструмента	Валюта	Наименование банка	Өтеуге берілетін сома теңгемен
Есепті айда шетелдік банктердің салымдарына орналастыру жүзеге асырылған жоқ			
Жиыны			