

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

2022 жылғы 1 желтоқсандағы жағдай бойынша «Halyk Global Markets» АҚ басқаруындағы (бұдан әрі – Halyk Global Markets) «БЖЗҚ» АҚ (бұдан әрі - БЖЗҚ) зейнетақы активтері (бұдан әрі – ЗА) 2 653,51 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	01.01.2022 жылға ағымдағы құны	01.01.2022 жылға үлесі	01.12.2022 жылға ағымдағы құны	01.12.2022 жылға үлесі	01.01.2022 ж. бастап өсуі/төмендеуі
ҚР екінші деңгейдегі банктердің облигациялары	155,30	7,54%	153,35	5,78%	-1,25%
ХҚҰ облигациялары	120,20	5,83%	114,22	4,30%	-4,97%
ҚР ұйымдарының корпоративтік облигациялары	125,67	6,10%	120,52	4,54%	-4,09%
ҚР квазимемлекеттік ұйымдардың облигациялары	296,51	14,39%	355,01	13,38%	19,73%
Шетелдік эмитенттердің үлестік құралдары (ETF пайлары)	288,40	13,99%	357,03	13,45%	23,80%
ҚР ҰБ ноталары	-	-	-	-	-
Шетелдік эмитенттердің акциялары және депозитарлық қолхаттары	180,38	8,75%	-	-	-
Шетелдік мемлекеттердің орталық орталық үкіметтері шығарған мемлекеттік мәртебесі бар бағалы қағаздары	-	-	180,35	6,80%	-
Кері Репо (90 күнтізбелік күннен артық емес)	892,98	43,33%	1 296,03	48,84%	45,14%
Басқа активтер (дебиторлық берешек, мерзімі өткен берешек, провизиялар)	0,38	0,02%	-	-	-
Шоттардағы ақшалай қаражат	1,02	0,05%	77,00	2,90%	7417,51%
Halyk Global Markets басқаруындағы ЗА жиынтығы	2 060,84	100,00%	2 653,51	100,00%	28,76%
Жасалған мәмілелер бойынша төлеуге міндеттемелер	0	-	0	-	-
Зейнетақы активтерінің жиынтығы	2 060,84	100,00%	2 653,51	100,00%	28,76%

01.12.2022 ж. жағдай бойынша теңгеге номинирленген борыштық қаржы құралдарының орташа кірістілігі жылдық 25,82% - ды құрады. АҚШ долларына номинирленген борыштық қаржы құралдарының орташа кірістілігі жылдық 4,69% - 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 1296,03 млн. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 48,84%-ды құрады. Кері Репо операцияларының орташа алынған кірістілігі есепті күнге жылдық 15,40% -ды құрады.

Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банктерінің облигациялары

Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банктерінің облигацияларының ағымдағы құны есепті айда 4,15 млн теңгеге артып, 153,35 млн теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 5,78% -ды құрады.

Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банктерінің облигацияларын өтеуге орташа алынған кірістілігі есепті күнге жылдық 45,20%-ды құрады.

Халықаралық қаржы ұйымдарының облигациялары

Есептік айда халықаралық қаржы ұйымдары облигацияларының ағымдағы құны 3,41 млн теңгеге азайды және 114,22 млн теңгені құрады. Халықаралық қаржы ұйымдары облигацияларының портфельдегі үлесі 4,30% құрады.

Халықаралық қаржы ұйымдарының облигацияларын өтеуге теңгеге номинирленген орташа алынған кірістілік белгіленген сыйақы мөлшерлемесімен жылдық 15,01% құрады.

Шетелдік эмитенттердің үлестік құралдары (ETF пайлары)

Nalyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфелінде шетелдік эмитенттердің (ETF пайлары) үлестік құралдары бар, олардың ағымдағы құны есепті айда 11,57 млн.теңгеге артып, 357,03 млн.теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 13,45%-ды құрады.

Қазақстан Республикасы эмитенттерінің корпоративтік облигациялары

ҚР эмитенттердің корпоративтік облигацияларының ағымдағы құны есепті айда 3,70 млн.теңгеге артып, 120,52 млн.теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 4,54%-ды құрады.

ҚР эмитенттердің корпоративтік облигацияларын өтеуге орташа алынған кірістілігі есепті күнге жылдық 12,19% -ды құрады.

Шет мемлекеттердің орталық үкіметтері шығарған мемлекеттік деген мәртебесі бар бағалы қағаздар

Шет мемлекеттердің орталық үкіметтері шығарған мемлекеттік деген мәртебесі бар бағалы қағаздардың ағымдағы құны есепті айда 0,67 млн. теңгеге артып және 180,35 млн теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 6,80%-ды құрады.

ҚР эмитенттердің корпоративтік облигацияларын өтеуге орташа алынған кірістілігі есепті күнге жылдық 4,69% -ды құрады.

Шетелдік эмитенттердің акциялары мен депозитарлық қолхаттары

01.12.2022ж. жағдай бойынша Nalyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфелінде шетелдік эмитенттердің акциялары мен депозитарлық қолхаттары жоқ.

Қазақстан Республикасының квазимемлекеттік ұйымдарының облигациялары

ҚР квазимемлекеттік ұйымдарының облигациялары бар, олардың ағымдағы құны есепті айда 9,39 млн.теңгеге артып, 355,01 млн.теңгені құрады. ҚР квазимемлекеттік ұйымдарының облигацияларының үлесі 13,38%-ды құрады.

ҚР квазимемлекеттік ұйымдарының облигацияларын өтеуге теңгеге номинирленген орташа алынған кірістілігі есепті күнге жылдық 25,56% -ды құрады.

Валюталық құрылым

Nalyk 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	01.01.2022 жылға ағымдағы құны	01.01.2022 жылға үлесі	01.12.2022 жылға ағымдағы құны	01.12.2022 жылға үлесі	01.01.2022 ж. бастап өсуі/төмендеуі
Ұлттық валюта	1 591,16	77,21%	2 095,34	78,96%	31,69%
АҚШ доллары	469,68	22,79%	558,18	21,04%	18,84%
Жиынтығы:	2 060,84	100,00%	2 653,51	100,00%	28,76%

Инвестициялық қызметтің нәтижелері

Инвестициялық қызметтің нәтижесінде, есептелген инвестициялық табыс мөлшері (активтерді тапсырған сәттен бастап 2022 жылғы 01 желтоқсандағы жағдай бойынша) 221,97 млн. теңгені және есептелген инвестициялық кіріс мөлшері (2022 жылғы 01 қаңтардан бастап 2022 жылғы 01 желтоқсандағы жағдай бойынша) 109,18 млн. теңгені құрады. Қызмет басталғаннан бастап зейнетақы активтерінің табыстылығы 12,91% -ды және 2022 жылдың басынан бастап 4,15% -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	2022 жылдың басынан бастап инвестициялық табыс
Бағалы қағаздар бойынша, оның ішінде орналастырылған салымдар және «кері РЕПО» операциялары бойынша сыйақы түріндегі табыстар	179,09
Бағалы қағаздарды нарықтық қайта бағалаудан түскен кірістер (шығындар)	-79,54
Шетел валюталарын қайта бағалаудан түскен кірістер (шығындар)	-1,47
Басқа кірістер (шығындар)	11,10
Жиынтығы:	109,18

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	01.11.2022	997,5252141
2	02.11.2022	997,5252141
3	03.11.2022	997,5252141
4	04.11.2022	997,5252141
5	05.11.2022	997,5252141
6	06.11.2022	997,5252141
7	07.11.2022	993,6656110
8	08.11.2022	993,6656110
9	09.11.2022	993,6656110
10	10.11.2022	993,6656110
11	11.11.2022	993,6656110
12	12.11.2022	993,6656110
13	13.11.2022	993,6656110
14	14.11.2022	1 000,9204447
15	15.11.2022	1 000,9204447
16	16.11.2022	1 000,9204447
17	17.11.2022	1 000,9204447
18	18.11.2022	1 000,9204447
19	19.11.2022	1 000,9204447
20	20.11.2022	1 000,9204447
21	21.11.2022	1 003,7081825

22	22.11.2022	1 003,7081825
23	23.11.2022	1 003,7081825
24	24.11.2022	1 003,7081825
25	25.11.2022	1 003,7081825
26	26.11.2022	1 003,7081825
27	27.11.2022	1 003,7081825
28	28.11.2022	1 014,8807101
29	29.11.2022	1 014,8807101
30	30.11.2022	1 015,5889819

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. 2022 жылғы 01 желтоқсандағы 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	2,90%	Иә
	Кері РЕПО	48,84%	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%	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	4,30%	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	Халықаралық қаржы ұйымдары шығарған мемлекеттік деген мәртебесі бар бағалы қағаздар	6,80%	иә
8	Шетелдік эмитенттердің акциялары және депозитарлық қолхаттары, Exchange Traded Funds (ETF), Exchange Traded Commodities (ETC), Exchange Traded Notes (ETN) пайлары	13,45%	иә
9	Шетелдік мемлекеттік емес эмитенттердің борыштық бағалы қағаздары	0,00%	иә
10	ҚР эмитенттерінің акциялары және депозитарлық қолхаттары, басқарушы компаниясы Қазақстан Республикасының заңнамасына сәйкес құрылған заңды тұлғаның интервалды пайлық инвестициялық қорлардың пайлары	0,00%	иә
11	ҚР мемлекеттік эмитенттерінің борыштық бағалы қағаздары	23,70%	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

№	Қаржы құралының түрі	Нақты мәні (зейнетақы активтерінен пайызбен)	Орындал уы (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	Мәміле құны теңгемен
Есепті айда қаржы құралдарын сату жүзеге асырылмады			
Жиынтығы			

7-кесте. Есептік айда қаржы құралдарын сату бойынша мәлімет

Құрал түрі	Валюта	Бағалы қағаз эмитенті	Мәміле құны теңгемен
Есептік айда қаржы құралдарын сату жүзеге асырылмады			

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

Құрал түрі	Валюта	Бағалы қағаз эмитенті	Мәміле сомасы теңгемен
Есепті айда бағалы қағаздар бойынша өтеу болған жоқ			
Жиынтығы			

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

Құрал түрі	Валюта	Банк атауы	Мәміле сомасы теңгемен
Есепті айда шетелдік банктердің салымдарына орналастыру жүзеге асырылмады			
Жиынтығы			

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

Құрал түрі	Валюта	Банк атауы	Өтелетін сомасы теңгемен
Есепті айда салымдар бойынша негізгі борышты өтеу жүзеге асырылмады			
Жиынтығы			