

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

2024 жылғы 1 қаңтардағы жағдай бойынша «Сентрас Секьюритиз» АҚ (бұдан әрі – Сентрас Секьюритиз) сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ зейнетақы активтері (бұдан әрі – ЗА) 1 023,54 млн. теңгені құрап отыр.

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

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

| Атауы | 01.01.2023 жылға ағымдағы құны | 01.01.2023 жылға үлесі | 01.12.2024 жылға ағымдағы құны | 01.12.2024 жылға үлесі | Жыл басынан бергі өсу/төмендеу |
|-------------------------------------------------------------------------|--------------------------------|------------------------|--------------------------------|------------------------|--------------------------------|
| ҚР ҚМ МБҚ | 696,58 | 68,78% | 346,86 | 33,89% | -50,21% |
| ҚР квазимемлекеттік ұйымдарының облигациялары | 86,90 | 8,58% | 197,07 | 19,25% | 126,77% |
| ҚР ЕДБ облигациялары | - | - | 168,85 | 16,50% | - |
| ҚР эмитенттерінің акциялары мен депозитарлық қолхаттары | 82,61 | 8,16% | 83,98 | 8,21% | 1,67% |
| Шетелдік эмитенттердің үлестік құралдары (ETF пайлары) | 26,98 | 2,66% | 9,48 | 0,93% | -64,88% |
| Шетелдік эмитенттердің акциялары мен депозитарлық қолхаттары | - | - | 21,86 | 2,14% | - |
| АҚШ мемлекеттік облигациялары | - | - | 81,04 | 7,92% | - |
| Репо | - | - | 88,07 | 8,60% | - |
| Басқа активтер (дебиторлық берешек, мерзімі өткен берешек, провизиялар) | - | - | - | - | - |
| Инвестициялық шоттардағы ақшалай қаражат | 119,76 | 11,82% | 26,33 | 2,57% | -78,01% |
| ИПБ басқаруындағы ЗА жиынтығы | 1012,84 | 100,00% | 1023,54 | 100,00% | 1,06% |
| Жасалған мәмілелер бойынша төлемге міндеттемелер | - | - | 0,00 | 0,00% | - |
| Зейнетақы активтерінің жиынтығы | 1012,84 | - | 1023,54 | | 1,06% |

01.01.2024 жылғы жағдай бойынша борыштық қаржы құралдарын өтеуге орташа алынған кірістілік (ҮТМ) – жылына 13,10%.

Инвестициялық шоттардағы ақшалай қаражат және кері РЕПО операциялары

Есепті кезең соңындағы инвестициялық шоттардағы ақшалай қаражат қалдығы – 26,33 млн. теңге. Олардың портфельдегі үлесі – 2,57%. Есепті кезең соңындағы РЕПО операциялары бойынша ақшалай қаражат қалдығы – 88,07 млн. теңге. Олардың портфельдегі үлесі – 8,60%. Есепті кезеңдегі кері РЕПО операцияларының орташа өлшенген кірістілігі – жылына 15,20%.

Қазақстан Республикасы Қаржы министрлігінің мемлекеттік бағалы қағаздары

Портфельдің негізгі үлесін алып тұрған Қазақстан Республикасы Қаржы министрлігінің мемлекеттік бағалы қағаздарының ағымдағы құны есепті ай соңында 346,86 млн. теңге болды.

Олардың портфельдегі үлесі – 33,89%. Есепті күндегі теңгемен номиналданған ҚР Қаржы министрлігінің МБҚ бойынша өтеуге орташа алынған кірістілік – жылына 12,89%.

Қазақстан Республикасының квазимемлекеттік ұйымдарының облигациялары

Есепті күндегі Қазақстан Республикасының квазимемлекеттік ұйымдарының облигациялары бойынша өтелуі тиіс орташа өлшенген кірістілік – АҚШ долларымен жылына 5,64% және теңгемен жылына 21,31%. Қазақстан Республикасының квазимемлекеттік ұйымдары облигацияларының ағымдағы құны есепті ай соңында 197,07 млн. теңге болып отыр. Олардың портфельдегі үлесі – 19,25%.

ҚР ЕДБ облигациялары

Есепті күндегі облигациялар бойынша өтелуі тиіс орташа өлшенген кірістілік – жылына 16,11%. Есепті ай соңында облигациялардың ағымдағы құны 168,85 млн. теңге болды. Олардың портфельдегі үлесі – 16,50%.

Қазақстан Республикасы эмитенттерінің акциялары мен депозитарлық қолхаттары

Қазақстан Республикасы эмитенттерінің акциялары мен депозитарлық қолхаттарының ағымдағы құны есепті ай соңында 83,98 млн. теңге болды. Олардың портфельдегі үлесі – 8,21%.

Шетелдік эмитенттердің үлестік құралдары (ETF пайлары)

Шетелдік эмитенттердің үлестік құралдарының (ETF пайлары) ағымдағы құны есепті ай соңында 9,48 млн. теңге болды. Олардың портфельдегі үлесі – 0,93%.

Шетелдік эмитенттердің акциялары мен депозитарлық қолхаттары

Есепті кезеңде Bank of Nova Scotia қарапайым акциялары сатып алынды. Есепті айдың соңында шетелдік эмитенттердің акциялары мен депозитарлық қолхаттарының ағымдағы құны 21,86 млн. теңге болды. Олардың портфельдегі үлесі – 2,14%.

АҚШ мемлекеттік облигациялары

Есепті айдың соңындағы ағымдағы құн 81,04 млн. теңге болды. Олардың портфельдегі үлесі – 7,92%.

Валюталық құрылым

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

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

| Валюта | <i>млн теңге</i> | | | | |
|----------------|--------------------------------|------------------------|--------------------------------|------------------------|--------------------------------|
| | 01.01.2023 жылғы ағымдағы құны | 01.01.2023 жылға үлесі | 01.01.2024 жылға ағымдағы құны | 01.01.2024 жылға үлесі | Жыл басынан бергі өсу/төмендеу |
| Ұлттық валюта | 806,73 | 79,65% | 759,45 | 74,20% | -5,86% |
| АҚШ доллары | 206,11 | 20,35% | 242,24 | 23,67% | 17,53% |
| Канада доллары | - | - | 21,86 | 2,14% | - |
| Жиыны: | 1012,84 | 100% | 1023,54 | 100% | 1,06% |

Инвестициялық қызмет нәтижесі

Инвестициялық қызметтің және қаржы құралдарының нарықтық құнының өзгеруі нәтижесінде 2023 жыл басынан бері есептелген инвестициялық табыс мөлшері 105,27 млн. теңге болды. 2023 жыл басынан бергі зейнетақы активтерінің кірістілігі 10,67% болып отыр.

Көрсетілген кезеңдегі есептелген инвестициялық табыс құрылымы 3-кестеде берілді.

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

| <i>млн теңге</i> | |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------|
| Атауы | 2023 жылғы инвестициялық табыс |
| Бағалы қағаздар бойынша, оның ішінде орналастырылған салымдар және «кері РЕПО» операциялары бойынша сыйақы түріндегі табыс | 95,97 |
| Бағалы қағаздарды нарықтық қайта бағалаудан, шетелдік валютаны қайта бағалаудан түскен табыс (шығын) және басқа табыс (шығын) | 9,73 |
| Шетелдік валютаны қайта бағалаудан түскен табыс (шығын) | -4,53 |
| Басқа активтерді қайта бағалаудан түскен табыс (шығын) (БҚҚ) | 0 |
| Сыртқы басқарудағы активтер бойынша табыс (шығын) | 0 |
| Басқа табыс (шығын) | 4,10 |
| Жиыны: | 105,27 |

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 | 01.12.2023 | 1127,1144014 |
| 2 | 02.12.2023 | 1127,1144014 |
| 3 | 03.12.2023 | 1127,1144014 |
| 4 | 04.12.2023 | 1134,6653856 |
| 5 | 05.12.2023 | 1134,6653856 |
| 6 | 06.12.2023 | 1134,6653856 |
| 7 | 07.12.2023 | 1134,6653856 |
| 8 | 08.12.2023 | 1134,6653856 |
| 9 | 09.12.2023 | 1134,6653856 |
| 10 | 10.12.2023 | 1134,6653856 |
| 11 | 11.12.2023 | 1133,4764283 |
| 12 | 12.12.2023 | 1133,4764283 |
| 13 | 13.12.2023 | 1133,4764283 |
| 14 | 14.12.2023 | 1133,4764283 |
| 15 | 15.12.2023 | 1133,4764283 |
| 16 | 16.12.2023 | 1133,4764283 |
| 17 | 17.12.2023 | 1133,4764283 |
| 18 | 18.12.2023 | 1133,4764283 |
| 19 | 19.12.2023 | 1138,4070231 |
| 20 | 20.12.2023 | 1138,4070231 |
| 21 | 21.12.2023 | 1138,4070231 |
| 22 | 22.12.2023 | 1138,4070231 |

| | | |
|----|------------|--------------|
| 23 | 23.12.2023 | 1138,4070231 |
| 24 | 24.12.2023 | 1138,4070231 |
| 25 | 25.12.2023 | 1143,3641007 |
| 26 | 26.12.2023 | 1143,3641007 |
| 27 | 27.12.2023 | 1143,3641007 |
| 28 | 28.12.2023 | 1143,3641007 |
| 29 | 29.12.2023 | 1143,3641007 |
| 30 | 30.12.2023 | 1143,3641007 |
| 31 | 31.12.2023 | 1143,2277459 |

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. 2024 жылғы 1 қаңтардағы 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) | 0,35% | иә |
| 2 | Қаулыға сай басқа елдердің шетелдік валютасы | 2,22% | 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 | 33,89% | 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 (Стандард энд Пурс) агенттігінің халықаралық шәкіл бойынша «BB+» 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 | 7,92% | иә |

| | | | |
|----|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------|----|
| 11 | <p>Шетелдік ұйымдар шығарған мемлекеттік емес БҚ:</p> <p>*Standard & Poor's (Стандард энд Пурс) агенттігінің халықаралық шәкіл бойынша «BB» 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;</p> <p>*негізгі қор индекстері құрамына кіретін шетелдік эмитенттердің акциялары және осы акциялар базалық активі болып табылатын депозитарлық қолхаттар;</p> <p>* Standard & Poor's (Стандард энд Пурс) агенттігінің халықаралық шәкіл бойынша «BB» деңгейінен төмен емес рейтинг бағасы немесе Moody's Investors Service (Мудис Инвесторс Сервис) немесе Fitch (Фич) агенттіктерінің ұқсас деңгейдегі рейтинг бағасы бар борыштық БҚ</p> | 2,14% | иә |
| 12 | Қаулыға сай ҚР және басқа мемлекеттердің заңнамасына сәйкес ҚР ұйымдары шығарған мемлекеттік емес БҚ | 52,56% | иә |
| 13 | Қаулыға сай Exchange Traded Funds (Эксчейндж Трэдэд Фандс), Exchange, Traded Commodities (Эксчейндж Трэдэд Коммодитис), Exchange Traded Notes (Эксчейндж Трэдэд Ноутс) пайлары | 0,93% | 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 номиналды құны |
|--------------------|--------|-----------------------|-------------------------|
| қарапайым акциялар | USD | Bank of Nova Scotia | 21 292 230,96 |
| Жиыны | | | 21 292 230,96 |

7-кесте. Есепті айдағы қаржы құралдарын сату бойынша мәлімет

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

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

8-кесте. Есепті айдағы бағалы қағаздар бойынша негізгі борышты өтеу бойынша мәлімет

| Құрал түрі | Валюта | Бағалы қағаз эмитенті | Теңгемен мәміле сомасы |
|-----------------------------------------------------|--------|-----------------------|------------------------|
| Есепті айда бағалы қағаздар бойынша өтеу болған жоқ | | | |
| Жиыны | | | - |

9-кесте. Есепті айдағы шетелдік банктердегі салымдарға орналастыру бойынша мәлімет

| Құрал түрі | Валюта | Банк атауы | Теңгемен мәміле сомасы |
|--------------------------------------------------------------------|--------|------------|------------------------|
| Есепті айда шетелдік банктердегі салымдарға орналастыру болған жоқ | | | |
| Жиыны | | | - |

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

| Құрал түрі | Валюта | Банк атауы | Теңгемен мәміле сомасы |
|--------------------------------------------------------------|--------|------------|------------------------|
| Есепті айда салымдар бойынша негізгі борышты өтеу болған жоқ | | | |
| Жиыны | | | - |