

«Nalyk Finance» Қазақстан Халық Банкінің ЕҰ» АҚ сенімгерлік басқаруындағы «БЖЗҚ» АҚ зейнетақы активтерін инвестициялық басқару бойынша ақпарат

2023 жылғы 1 наурыздағы жағдай бойынша «Nalyk Finance» Қазақстан Халық Банкінің ЕҰ» АҚ (бұдан әрі – Nalyk Finance) сенімгерлік басқаруындағы «БЖЗҚ» АҚ (бұдан әрі – БЖЗҚ) зейнетақы активтері (бұдан әрі – ЗА) **53,9** млн. теңгені құрап отыр.

Nalyk Finance сенімгерлік басқаруындағы зейнетақы активтері есебінен құралған қаржы құралдары портфелінің құрылымы 1-кестеде берілді.

1-кесте. Қаржы құралдарының бөлігінде Nalyk Finance сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфелінің құрылымы

Атауы	01.01.2023 жылға ағымдағы құны	01.01.2023 жылға үлесі	01.03.2023 жылға ағымдағы құны	01.03.2023 жылға үлесі	01.01.2023ж. бастап өсу/төмендеу
Шоттардағы ақшалай қаражат	1,35	16,19%	5,57	10,33%	311,24%
Кері Репо (90 күнтізбелік күннен артық емес)	7,01	83,81%	48,33	89,67%	589,08%
ИПБ басқаруындағы ЗА жиынтығы	8,37	100,00%	53,90	100,00%	544,11%
Жасалған мәмілелер бойынша төлемге міндеттемелер	0	0,00%	0	0,00%	-
Зейнетақы активтерінің жиынтығы	8,37		53,90		544,11%

Кері Репо операциялары (90 күнтізбелік күннен артық емес)

Есепті айдағы кері Репо операцияларының ағымдағы құны – 48,33 млн. теңге. Олардың портфельдегі үлесі – 89,67%. Репо операциялары бойынша орташа өлшенген мөлшерлеме – 16,21%.

Валюталық құрылым

Nalyk Finance сенімгерлік басқаруындағы 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 Nalyk Finance сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфелінің құрылымы

Валюта	01.01.2023 жылғы ағымдағы құны	01.01.2023 жылға үлесі	01.03.2023 жылға ағымдағы құны	01.03.2023 жылға үлесі	01.01.2023ж. бастап өсу/төмендеу
Ұлттық валюта	8,37	100,00%	53,90	100,00%	544,11%
Жиыны:	8,37	100,00%	53,90	100,00%	544,11%

млн теңге

Инвестициялық қызмет нәтижесі

Инвестициялық қызмет нәтижесінде 2023 жыл басынан бері есептелген инвестициялық табыс мөлшері 456 954,16 теңге болды. 2023 жыл басынан бергі зейнетақы активтерінің кірістілігі 1,83% болып отыр.

Есептелген инвестициялық табыс құрылымы 3-кестеде берілді.

3-кесте. Nalyk Finance сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА бойынша алған инвестициялық табыс құрылымы

Атауы	2023 жыл басынан бергі инвестициялық табыс
Бағалы қағаздар бойынша, оның ішінде орналастырылған салымдар және «кері РЕПО» операциялары бойынша сыйақы түріндегі табыс	459 544,29
Бағалы қағаздарды нарықтық қайта бағалаудан түскен табыс (шығын)	0,00
Шетелдік валютаны қайта бағалаудан түскен табыс (шығын)	0,00
Басқа активтерді қайта бағалаудан түскен табыс (шығын)	0,00
Басқа табыс (шығын)	-2 590,13
Жиыны:	456 954,16

Шартты бірлік құны туралы ақпарат

Nalyk Finance сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА шартты зейнетақы бірлігі құнының динамикасы 4-кестеде берілді.

4-кесте. Nalyk Finance сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА бір шартты бірлік құны

№	Күні	Бір шартты бірлік құны
1	01.02.2023	1 058,3729491
2	02.02.2023	1 058,3729491
3	03.02.2023	1 058,3729491
4	04.02.2023	1 058,3729491
5	05.02.2023	1 058,3729491
6	06.02.2023	1 060,3921712
7	07.02.2023	1 060,3921712
8	08.02.2023	1 060,3921712
9	09.02.2023	1 060,3921712
10	10.02.2023	1 060,3921712
11	11.02.2023	1 060,3921712
12	12.02.2023	1 060,3921712
13	13.02.2023	1 062,2019322
14	14.02.2023	1 062,2019322
15	15.02.2023	1 062,2019322
16	16.02.2023	1 062,2019322
17	17.02.2023	1 062,2019322
18	18.02.2023	1 062,2019322
19	19.02.2023	1 062,2019322
20	20.02.2023	1 064,8172039
21	21.02.2023	1 064,8172039
22	22.02.2023	1 064,8172039
23	23.02.2023	1 064,8172039
24	24.02.2023	1 064,8172039
25	25.02.2023	1 064,8172039
26	26.02.2023	1 064,8172039
27	27.02.2023	1 066,8831495
28	28.02.2023	1 067,2812679

Инвестициялық декларация өлшемдерін сақтау туралы ақпарат

Nalyk Finance сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА құрылымдық бөлу Nalyk Finance сенімгерлік басқаруындағы зейнетақы активтері есебінен құралған қаржы құралдарының портфеліне инвестициялық декларация¹ талаптарына сәйкес. Валюталық позициялар үлесі рұқсат етілген деңгей шегінде қалады және Nalyk Finance сенімгерлік басқаруындағы

¹ Nalyk Finance сенімгерлік басқаруындағы зейнетақы активтері есебінен құралған қаржы құралдарының портфеліне инвестициялық декларация "Nalyk Finance" АҚ Директорлар кеңесінің шешімімен бекітілді, Директорлар кеңесінің 2022 жылғы 01 қарашадағы №34/22-3 сырттай дауыс беру қорытындысы туралы хаттама

зейнетақы активтері есебінен құралған қаржы құралдарының портфеліне инвестициялық декларация талаптарын бұзбайды. 2023 жылғы 1 наурыздағы жағдай бойынша Nalyk Finance сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА бойынша инвестициялау шектерін сақтау туралы мәлімет 5-кестеде берілді.

5-кесте. Nalyk Finance сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА бойынша инвестициялау шектері

№	Қаржы құралының атауы	Нақты мәні (сенімгерлік басқарудағы зейнетақы активтері құнынан пайызбен)	Орындалуы (иә/жоқ)
1.	Ұлттық валютадағы ақшалай қаражат – теңге (KZT)	10,33%	иә
2.	Кері РЕПО	89,67%	иә
3.	Қазақстан Республикасының Қаржы министрлігі және Қазақстан Республикасының Ұлттық Банкі шығарған Қазақстан Республикасының мемлекеттік бағалы қағаздары (оның ішінде шетелдік мемлекеттердің заңнамасына сәйкес эмиссияланған), сондай-ақ Қазақстан Республикасының Үкіметінің кепілімен және (немесе) кепілдігімен шығарылған бағалы қағаздар	0,00%	иә
4.	Қазақстан Республикасының жергілікті атқару органдары шығарған борыштық бағалы қағаздар	0,00%	иә
5.	Акцияларының жүз пайызы Қазақстан Республикасының Ұлттық Банкіне тиесілі заңды тұлға шығарған борыштық бағалы қағаздар	0,00%	иә
6.	Қазақстан Республикасының 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 бағалы қағаздар	0,00%	иә
7.	Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банктеріндегі салымдар төмендегі талаптардың біріне сәйкес келген кезде: - банктердің Standard & Poor's (Стандарт энд Пурс) агенттігінің халықаралық шәкілі бойынша "BB-" деңгейінен төмен емес ұзақ мерзімді кредит рейтингі немесе Moody's Investors Service (Мудис Инвесторс Сервис) немесе Fitch (Фич) агенттіктерінің ұқсас деңгейдегі рейтинг бағасы немесе Standard & Poor's (Стандарт энд Пурс) ұлттық шәкілі бойынша "kzA-" деңгейінен төмен емес рейтинг бағасы бар; - банктер – Standard & Poor's (Стандарт энд Пурс) агенттігінің халықаралық шәкілі бойынша "A-" деңгейінен төмен емес ұзақ мерзімді кредит рейтингі немесе Moody's Investors Service (Мудис Инвесторс Сервис) немесе Fitch (Фич) агенттіктерінің ұқсас деңгейдегі рейтинг бағасы бар резидент емес банктің еншілес банктері.	0,00%	иә
8.	Standard & Poor's (Стандарт энд Пурс) агенттігінің халықаралық шәкілі бойынша "A-" деңгейінен төмен емес ұзақ мерзімді кредит рейтингі немесе Moody's Investors Service (Мудис Инвесторс Сервис) немесе Fitch (Фич) агенттіктерінің ұқсас деңгейдегі рейтинг бағасы бар резидент емес банктердегі салымдар	0,00%	иә
9.	Standard & Poor's (Стандарт энд Пурс) агенттігінің халықаралық шәкілі 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);	0,00%	иә

№	Қаржы құралының атауы	Нақты мәні (сенімгерлік басқарудағы зейнетақы активтері құнынан пайызбен)	Орындалуы (иә/жоқ)
	<ul style="list-style-type: none"> – 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); <p>сондай-ақ жарғылық капиталындағы Қазақстан Республикасының үлесі 25%-дан кем емес халықаралық қаржы ұйымы шығарған бағалы қағаздар.</p>		
10.	Standard & Poor's (Стандард энд Пурс) агенттігінің халықаралық шәкіл бойынша «BBB-» деңгейінен төмен емес тәуелсіз рейтингі немесе Moody's Investors Service (Мудис Инвесторс Сервис) немесе Fitch (Фич) агенттіктерінің ұқсас деңгейдегі рейтинг бағасы бар шетелдік мемлекеттердің орталық үкіметтері шығарған мемлекеттік мәртебесі бар бағалы қағаздар	0,00%	иә
11.	Шетелдік ұйымдар шығарған мемлекеттік емес бағалы қағаздар:	0,00%	иә
	1. 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;	0,00%	иә
	2. негізгі қор индекстері құрамына кіретін шетелдік эмитенттердің акциялары және осы акциялар базалық активі болып табылатын депозитарлық қолхаттар;		
	3. 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 бағалы қағаздар	0,00%	иә
12.	Қазақстан Республикасының және басқа мемлекеттердің заңнамасына сәйкес Қазақстан Республикасының ұйымдары шығарған мемлекеттік емес бағалы қағаздар:	0,00%	иә
	1. қор биржасында инвесторлардың кең ауқымы арасында жария ұсыныс (сату) аясында орналастырылған (орналастырылатын) Қазақстан Республикасының квазимемлекеттік секторы эмитенттерінің акциялары және (немесе) базалық активі осы акциялар болып табылатын депозитарлық қолхаттар;	0,00%	иә
	2. қор биржасының ресми тізіміне енгізілген, қор биржасының ресми тізімінің "Негізгі" алаңының "акциялар" секторының "премиум" санатының талаптарына сәйкес келетін заңды		

№	Қаржы құралының атауы	Нақты мәні (сенімгерлік басқарудағы зейнетақы активтері құнынан пайызбен)	Орындалуы (иә/жоқ)
	<p>тұлғалардың акциялары және базалық активтері осы акциялар болып табылатын депозитарлық қолхаттар;</p> <p>3. негізгі қор индекстерінің құрамына кіретін заңды тұлғалардың акциялары;</p>		
	<p>4. Standard & Poor's (Стандарт энд Пурс) агенттігінің халықаралық шәкіл бойынша «В+» деңгейінен төмен емес рейтинг бағасы немесе Moody's Investors Service (Мудис Инвесторс Сервис) немесе Fitch (Фич) агенттіктерінің ұқсас деңгейдегі рейтинг бағасы немесе Standard & Poor's (Стандарт энд Пурс) ұлттық шәкілі бойынша "kzBBB" деңгейінен төмен емес рейтинг бағасы бар Қазақстан Республикасының және басқа мемлекеттердің заңнамасына сәйкес Қазақстан Республикасының ұйымдары шығарған борыштық бағалы қағаздар;</p> <p>5. бұрын шығарылған бағалы қағаздарға не осы эмитенттің өзге де міндеттемелеріне айырбас мақсатында эмитенттің міндеттемелерін қайта құрылымдау аясында шығарылған бағалы қағаздар.</p>	0,00%	иә
13.	<p>Активтерінің құрылымы негізгі қор индекстерінің бірінің құрылымын қайталайтын немесе пайлары бойынша баға белгілеу негізгі қор индекстеріне байланысты Exchange Traded Funds (Эксчейндж Трэдэд Фандс) пайларын қоспағанда, Morningstar (Морнингстар) рейтингтік агенттігінің "3 жұлдызынан" төмен емес рейтинг бағасы бар Exchange Traded Funds (Эксчейндж Трэдэд Фандс), Exchange, Traded Commodities (Эксчейндж Трэдэд Коммодитис), Exchange Traded Notes (Эксчейндж Трэдэд Ноутс) пайлары</p>	0,00%	иә
14.	<p>Қор биржасының ресми тізімінің «Аралас» алаңының «инвестициялық қорлардың бағалы қағаздары» секторының талаптарына сай қор биржасының ресми тізіміне қосылған Қазақстан Республикасының заңнамасына сәйкес құрылған заңды тұлға басқарушы компаниясы болып табылатын интервал пайлық инвестициялық қорлардың пайлары</p>	0,00%	иә
15.	<p>Активтерінің құрылымы негізгі қор индекстерінің бірінің құрылымын қайталайтын немесе пайлары бойынша баға белгілеу негізгі қор индекстеріне байланысты Exchange Traded Funds (Эксчейндж Трэдэд Фандс) пайлары</p>	0,00%	иә
16.	<p>Standard & Poor's (Стандарт энд Пурс) агенттігінің халықаралық шәкіл бойынша «BBB» деңгейінен төмен емес тәуелсіздік рейтингі немесе Moody's Investors Service (Мудис Инвесторс Сервис) немесе Fitch (Фич) агенттіктерінің ұқсас деңгейдегі рейтинг бағасы бар елдердің шетелдік валютасы</p>	0,00%	иә
17.	<p>Лондон асыл металдар нарығы қауымдастығы (London bullion market association) қабылдаған және осы қауымдастықтың құжаттарында "Лондон сапалы жеткізілімі" ("London good delivery") стандарты ретінде белгіленген халықаралық сапа стандарттарына сай аффинирленген асыл металдар және металл депозиттер, оның ішінде он екі айдан аспайтын мерзімге Standard & Poor's (Стандарт энд Пурс) агенттігінің «АА» деңгейінен төмен емес рейтинг бағасы немесе Moody's Investors Service (Мудис Инвесторс Сервис) немесе Fitch (Фич) агенттіктерінің ұқсас деңгейдегі рейтинг бағасы бар Қазақстан Республикасының резиденті емес банктеріндегі металл депозиттер</p>	0,00%	иә
18.	<p>Базалық активі осы қосымшаға сәйкес зейнетақы активтері есебінен сатып алу рұқсат етілген қаржы құралдары болып табылатын хеджирлеу мақсатында жасалған төмендегі туынды қаржы құралдары:</p>	0,00%	иә

№	Қаржы құралының атауы	Нақты мәні (сенімгерлік басқарудағы зейнетақы активтері құнынан пайызбен)	Орындалуы (иә/жоқ)
	<p>опциондар – сатып алушыға көрсетілген активті белгілі бір бағамен немесе белгілі бір күнге дейін сатып алу немесе сату міндеттемесін емес, құқығын беретін келісімшарт;</p> <p>фьючерстер – болашақта жасалатын сатып алу-сату мәмілесіне қатысты құқықтар мен міндеттерді өзара беруге байланысты келісімшарт;</p> <p>форвардтар – бір тарап белгілі бір мерзімде келісімшарттың мәнін беруге, ал екінші Тарап оны көрсетілген күн бойынша көрсетілген уақытта және көрсетілген жерде қабылдауға міндеттенетін шарт;</p> <p>своптар – болашақта келісімшартта белгіленген талаптарға сәйкес төлемдерді айырбастау туралы екі контрагент арасындағы келісім; жоғарыда аталған туынды қаржы құралдарының жиынтығын білдіретін туынды қаржы құралдары.</p>		

Налук Finance сенімгерлік басқаруындағы зейнетақы активтері есебінен құралған қаржы құралдарының 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 атаулы құны
Есепті айда қаржы құралдары сатып алынған жоқ			
Жиыны			

7-кесте. Есепті айдағы қаржы құралдарын сату бойынша мәлімет

Құрал түрі	Валюта	Бағалы қағаз эмитенті	Теңгемен мәміле сомасы
Есепті айда қаржы құралдары сатылған жоқ			
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 негізгі борышты 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			