

«BCC Invest» АҚ сенімгерлік басқаруындағы «БЖЗҚ» АҚ зейнетақы активтерін инвестициялық басқару бойынша ақпарат

2021 жылғы 01 сәуірдегі жағдай бойынша «BCC Invest» АҚ басқаруындағы (бұдан әрі – BCC Invest) БЖЗҚ зейнетақы активтері (бұдан әрі – ЗА) 304 415 740 теңгені құрады.

BCC Invest басқаруындағы БЖЗҚ зейнетақы активтерінің есебінен қалыптастырылған қаржы құралдарының инвестициялық портфелінің құрылымы 1-кестеде көрсетілген.

1-кесте. Қаржы құралдарының бөлігінде BCC Invest сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфелінің құрылымы

Атауы	01.01.2021 жылға ағымдағы құны	01.01.2021 жылға үлесі	01.04.2021 жылға ағымдағы құны	01.04.2021 жылға үлесі	Жыл басынан өсуі/төмендеуі
ҚР квазимемлекеттік ұйымдарының облигациялары	0,00	0,00%	38,01	12,49%	0,00
Пайлар (ETF индекстеріне)	0,00	0,00%	20,89	6,86%	0,00
Шетелдік эмитенттердің акциялары және депозитарлық қолхаттары	0,00	0,00%	24,49	8,05%	0,00
Инвестициялық шоттардағы ақшалай қаражат	0,00	0,00%	194,88	64,02%	0,00
Репо	0,00	0,00%	55,11	18,10%	0,00
ИПБ басқаруындағы ЗА жиынтығы	0,00	0,00%	304,42	100,00%	0,00
Жасалаған мәмілелер бойынша төлеуге міндеттемелер			28,98	9,52%	0,00
Зейнетақы активтерінің жиынтығы	0,00	0,00%	333,39		0,00

млн. теңге

01.04.2021ж. жағдай бойынша БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфеліндегі борышты қаржы құралдарды өтеуге (УТМ) орташа алынған кірістілік жылдық 11,75% құрады.

Ақшалай қаражат және кері РЕПО операциялары

Инвестициялық стратегияға және инвестициялық декларацияға сай қаржы құралдарын портфельге сатып алу кезіне дейін уақытша диверсификация және инвестициялау лимиттері бойынша талаптарды есепке ала отырып бос ақшалай қаражат кері репо операцияларына орналастырылады. 2021 жылғы 1 сәуірге кері репо операциялары бойынша талаптар 55 113 369 теңгені, ал 2021 жылғы наурыздың 15-нен 31-не дейінгі кезең үшін репо операциялары бойынша кіріс 377 680 теңгені құрады. Есептік кезеңнің аяғына инвестициялық шоттардағы ақшалай қаражаттың қалдығы 194 884 985 теңгені құраған. Кері репо операциялары бойынша талаптар мен ақшалай қаражаттың жиынтық үлесі есептік айдың аяғына 82,12% құрады.

Қазақстан Республикасының квазимемлекеттік ұйымдарының облигациялары

Есептік кезеңде мынадай қаржы құралдары сатып алынды:

- өтеуге жылдық 11,00% мөлшеріндегі кірістілікпен номиналдық құны бойынша 9 000 000 тенге көлеміндегі «Бәйтерек» ұлттық басқарушы холдингі» АҚ облигациялары;
- өтеуге жылдық 12,00% мөлшеріндегі кірістілікпен номиналдық құны бойынша 28 000 000 тенге көлеміндегі «КазАгроФинанс» АҚ облигациялары (валюталау датасы 02.04.2021ж.).

Есептік кезеңде Қазақстан Республикасы квазимемлекеттік ұйымдарының облигациялары сатылмады және өтелмеді.

Есептік датаға теңгеге номинирленген Қазақстан Республикасы квазимемлекеттік ұйымдарының облигациялары бойынша өтеуге орташа алынған кірістілік жылдық 11,75% құрады.

Есептік айдың аяғына Қазақстан Республикасының квазимемлекеттік ұйымдары облигацияларының ағымдағы құны 38 006 330 теңгені құрады. Портфельдегі олардың үлесі 12,49% құрады.

ВСС Invest сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА портфелінің нысаналы құрылымында теңгеге номинирленген қазақстандық эмитенттердің (мемлекеттік, квазимемлекеттік және корпоративтік) борышты қаржы құралдарының жоспарлы үлесі – 50% дейін.

Шетелдік эмитенттердің акциялары және депозитарлық қолхаттары және ETF

Есептік кезеңде ВСС Invest сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА портфелінің құрамына Dow Jones U.S. Large-Cap Value Total Stock Market Index (үлкен капитализацияның американдық «құндық» акцияларының индексі), CRSP US Large Cap Value Index (үлкен капитализацияның американдық «құндық» акцияларының индексі), S&P® Developed Ex-U.S. Broad Market Index (АҚШ қоспағанда дамыған нарықтар акцияларының кең нарығының индексі), MSCI Emerging Markets Investable Market Index (дамушы нарықтар акцияларының нарық индексі), WisdomTree Emerging Markets ex-State-Owned Enterprises Index (үкімет иеліктерінің үлесі 20% аспайтын дамушы нарықтар акцияларының нарық индексі) индекстеріне ETF сатып алынды.

Бұдан басқа ВСС Invest сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА портфелінің құрамына AAA бастап ВВВ+ дейінгі кредиттік рейтингілермен дамыған және дамушы нарықтардың, АҚШ жекелеген эмитенттерінің депозитарлық қолхаттары, акциялары сатып алынды.

Есептік кезеңде шетелдік эмитенттердің ETF, акциялары және депозитарлық қолхаттары сатылмады.

Есептік айдың аяғына ETF ағымдағы құны 20 893 294 теңгені, портфельдегі үлесі 6,86% құрады.

Шетелдік эмитенттердің акциялары мен депозитарлық қолхаттарының ағымдағы құны 24 493 842 теңгені құрады. Портфельдегі олардың үлесі 8,05% құрады.

ВСС Invest сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА портфелінің нысаналы құрылымында шетелдік эмитенттердің ETF, акциялары мен депозитарлық қолхаттарының жоспарлы үлесі – 49% дейін.

Валюталық құрылым

ВСС Invest сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ зейнетақы активтері есебінен сатып алынған қаржы құралдарына номинирленген қаржы құралдарының валюталар бөлігіндегі инвестициялық портфелі 2-кестеде көрсетілген.

Есептік кезеңде Қазақстандық қор биржасында шетелдік валютамен сатып алу-сату мәмілелері 107 234,64 АҚШ долларын сатып алуға жасалды.

2-кесте. ВСС Invest сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфель құрылымы, валюталар бөлігінде

Валюта	млн. теңге				
	01.01.2021ж. ағымдағы құны	01.01.2021ж. . үлесі	01.04.2021ж. ағымдағы құны	01.04.2021ж. . үлесі	Жыл басынан өсуі/төмендеу і
Ұлттық валюта	0,00	0,00%	259, 01	85,08%	0,00
АҚШ доллары	0,00	0,00%	45,41	14,92%	0,00
Ресей рублі	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00
Басқа валюта	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00
Жиынтығы:			304,42	100,00%	

Инвестициялық қызметтің нәтижелері

Инвестициялық қызметтің нәтижесінде есептелген инвестициялық кіріс мөлшері 0,94 млн. теңгені құрады. Зейнетақы активтерінің кірістілігі 0,29% құрады.

Есептелген инвестициялық кірістің үлкен бөлігі кері репо операциялары бойынша сыйақыға және шетелдік валютаны қайта бағалаудан кірістерге келді.

Көрсетілген кезең үшін есептелген инвестициялық кіріс құрылымы 3-кестеде көрсетілген.

3-кесте. ВСС Invest сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА бойынша алынған инвестициялық кірістің құрылымы

млн. теңге

Атауы	01/04/2021 жылға инвестициялық кіріс
Бағалы қағаздар бойынша, оның ішінде орналастырылған салымдар мен «кері РЕПО» бойынша сыйақы түріндегі кірістер	0,46
Бағалы қағаздарды нарықтық қайта бағалаудан кірістер (шығындар)	0,01
Шетелдік валютаны қайта бағалаудан кірістер (шығындар)	0,48
Өзге активтерді қайта бағалаудан кірістер (шығындар) (ӨҚК)	0
Сыртқы басқарудағы активтер бойынша кірістер (шығындар)	0
Өзге кірістер (шығындар)	-0,01
Жиынтығы:	0,94

Шартты бірліктің құны туралы ақпарат

ВСС Invest сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА шартты зейнетақы бірлігі құнының динамикасы 4-кестеде берілген.

4-кесте. ВСС Invest сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА шартты зейнетақы бірлігі құны

№	Дата	Бір шартты бірліктің құны, теңге
1	15.03.2021	899,4814074
2	16.03.2021	899,4330679
3	17.03.2021	899,4491654
4	18.03.2021	900,3045501
5	19.03.2021	902,3182193
6	20.03.2021	902,4233285
7	21.03.2021	902,5284377
8	22.03.2021	902,6335469
9	23.03.2021	902,7386561
10	24.03.2021	902,8437653
11	25.03.2021	900,2985184
12	26.03.2021	900,2985184
13	27.03.2021	900,2985184
14	28.03.2021	900,2985184
15	29.03.2021	901,4019321
16	30.03.2021	901,4019321
17	31.03.2021	902,0745882

Инвестициялық декларация параметрлерін сақтау туралы ақпарат

ВСС Invest сенімгерлік басқаруындағы зейнетақы активтерін құрылымдық үлестіру зейнетақы активтерін сенімгерлік басқару бойынша Инвестициялық декларация талаптарына сәйкес келеді. Валюталық позициялар үлесі рұқсат етілген деңгей шегінде қалады және зейнетақы активтерін сенімгерлік басқару бойынша Инвестициялық декларацияның талаптарын бұзбайды. 2021 жылғы 1 сәуірдегі жағдай бойынша ВСС Invest сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА бойынша инвестициялау лимиттерін сақтау туралы мәліметтер 5-кестеде берілген.

5-кесте. ВСС Invest сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА бойынша инвестициялау лимиттері

№	Қаржы құралының түрі	Нақты мәні (басқаруда ЗА жалпы көлемінен пайызбен)	Орында луы (иә/жоқ)
1	Ұлттық валютадағы ақшалай қаражат – теңге (KZT).	64,04%	иә
2	«Standard&Poor's» Poor's (Стандард энд Пурс) агенттігінің халықаралық шәкілі бойынша «BBB» төмен емес тәуелсіз рейтингісі немесе Moody's Investors Service (Мудис Инвесторс Сервис) немесе Fitch (Фич)	0,01%	иә

	агенттіктерінің бірінің осыған ұқсас деңгейінің рейтинг бағасы бар елдердің шетелдік валютасы		
3	Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкі мен Қазақстан Республикасы Қаржы министрлігі шығарған Қазақстан Республикасының мемлекеттік бағалы қағаздары (оның ішінде шетелдік мемлекеттердің заңнамасына сәйкес эмитирленген), сондай-ақ Қазақстан Республикасы Үкіметінің кепілдемесімен және (немесе) кепілдігімен шығарылған бағалы қағаздар	2,96%	иә
4	Қазақстан Республикасының жергілікті атқарушы органдары шығарған борыштық бағалы қағаздар	0,00%	иә
5	Акцияларының жүз пайызы Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкіне тиесілі, заңды тұлға шығарған борыштық бағалы қағаздар	2,96%	иә
6	Қазақстан Республикасы заңнамасы мен басқа мемлекеттердің заңнамасына сәйкес «Қазақстан Даму банкі», «Самрұқ-Қазына» Ұлттық әл-ауқат қоры», «Бөйтерек» Ұлттық басқарушы холдингі», «Проблемалық кредиттер қоры» акционерлік қоғамдар шығарған борыштық бағалы қағаздар	2,97%	иә
7	Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банктеріне салымдар, келесі талаптардың біріне сәйкес келсе: банктердің «Standard&Poor's» Poor's (Стандарт энд Пурс) агенттігінің халықаралық шәкілі бойынша «BB-» төмен емес ұзақ мерзімді кредиттік рейтингісі немесе Moody's Investors Service (Мудис Инвесторс Сервис) немесе Fitch (Фич) агенттіктерінің бірінің осыған ұқсас деңгейінің рейтинг бағасы бар, немесе Standard & Poor's (Стандарт энд Пурс) ұлттық шәкілі бойынша «kzA-» төмен емес рейтингтік бағасы бар; банктер резидент еншілес банктер болып табылады, олардың бас бейрезидент банкінің «Standard&Poor's» Poor's (Стандарт энд Пурс) агенттігінің халықаралық шәкілі бойынша «A-» төмен емес ұзақ мерзімді кредиттік рейтингісі немесе Moody's Investors Service (Мудис Инвесторс Сервис) немесе Fitch (Фич) агенттіктерінің бірінің осыған ұқсас деңгейінің рейтинг бағасы бар.	0,00%	иә
8	«Standard&Poor's» Poor's (Стандарт энд Пурс) агенттігінің халықаралық шәкілі бойынша «A-» төмен емес ұзақ мерзімді рейтингісі немесе Moody's Investors Service (Мудис Инвесторс Сервис) немесе Fitch (Фич) агенттіктерінің бірінің осыған ұқсас деңгейінің рейтинг бағасы бар бейрезидент банктерге салымдар	0,00%	иә
9	«Standard&Poor's» Poor's (Стандарт энд Пурс) агенттігінің халықаралық шәкілі бойынша «BB+» төмен емес рейтингтік бағасы немесе Moody's Investors Service (Мудис Инвесторс Сервис) немесе Fitch (Фич) агенттіктерінің бірінің осыған ұқсас деңгейінің рейтинг бағасы бар келесі халықаралық қаржы ұйымдары шығарған борыштық бағалы қағаздар: Азия даму банкі (the Asian Development Bank); Америка аралық даму банкі (the Inter-American Development Bank); Африка даму банкі (the African Development Bank); Еуразия даму банкі (Eurasian Development Bank); Еуропа қайта құрылымдау және даму банкі (the European Bank for Reconstruction and Development); Еуропа инвестициялық банкі (the European Investment Bank); Еуропалық Кеңестің Даму банкі (the Council of Europe Development Bank); Жеке секторды дамыту бойынша ислам корпорациясы (the Islamic Corporation for the Development of the Private Sector); Ислам Даму банкі (the Islamic Development Bank); Инвестицияларға кепілдік беру көптарапты агенттігі (the Multilateral Investment Guarantee Agency); Скандинавия инвестиция банкі (the Nordic Investment Bank); Халықаралық валюта қоры (the International Monetary Fund); Халықаралық дамыту қауымдастығы (the International Development Association); Халықаралық Инвестициялық дауларды реттеу орталығы (the International Centre for Settlement of Investment Disputes); Халықаралық қайта құрылымдау және даму банкі (the International Bank for Reconstruction and Development);	0,00%	иә

	Халықаралық қаржы корпорациясы (the International Finance Corporation).		
10	«Standard&Poor's» агенттігінің халықаралық шәкілі бойынша «BB+» төмен емес тәуелсіз рейтингісі бағасы бар немесе басқа рейтинг агенттіктерінің бірінің осыған ұқсас деңгейінің рейтингісі бар, шетелдік мемлекеттердің орталық үкіметтері шығарған мемлекеттік мәртебесі бар бағалы қағаздар	0,00%	иә
11	Шетелдік ұйымдар шығарған мемлекеттік емес бағалы қағаздар: «Standard&Poor's» Poor's (Стандард энд Пурс) агенттігінің халықаралық шәкілі бойынша «BB+» төмен емес рейтингтік бағасы немесе Moody's Investors Service (Мудис Инвесторс Сервис) немесе Fitch (Фич) агенттіктерінің бірінің осыған ұқсас деңгейінің рейтинг бағасы бар шетелдік эмитенттердің акциялары; негізгі қор индекстерінің құрамына кіретін шетелдік эмитенттердің акциялары және базалық активтері аталған акциялар болып табылатын депозитарлық қолхаттар; «Standard&Poor's» Poor's (Стандард энд Пурс) агенттігінің халықаралық шәкілі бойынша «BB» төмен емес рейтингтік бағасы немесе Moody's Investors Service (Мудис Инвесторс Сервис) немесе Fitch (Фич) агенттіктерінің бірінің осыған ұқсас деңгейінің рейтинг бағасы бар борыштық бағалы қағаздар.	8,04%	иә
12	Қазақстан Республикасы мен басқа мемлекеттердің заңнамасына сәйкес Қазақстан Республикасының ұйымдары шығарған мемлекеттік емес бағалы қағаздар: қор биржасында кең ауқымды инвесторлар арасында жария ұсыныс (сату) аясында орналастырылған (орналастырылатын) Қазақстан Республикасының квазимемлекеттік секторы эмитенттерінің акциялары және базалық активтері аталған акциялар болып табылатын депозитарлық қолхаттар; қор биржасының ресми тізіміне енгізілген, қор биржасының ресми тізімінің "Негізгі" алаңының "Акциялар" секторының "Премиум" санатының талаптарына сәйкес келетін қор биржасының ресми тізіміне енгізілген заңды тұлғалардың акциялары және базалық активтері аталған акциялар болып табылатын депозитарлық қолхаттар; негізгі қор индекстерінің құрамына кіретін заңды тұлғалардың акциялары; «Standard&Poor's» Poor's (Стандард энд Пурс) агенттігінің халықаралық шәкілі бойынша «BB» төмен емес рейтингтік бағасы немесе Moody's Investors Service (Мудис Инвесторс Сервис) немесе Fitch (Фич) агенттіктерінің бірінің осыған ұқсас деңгейінің рейтинг бағасы бар, немесе Standard & Poor's (Стандард энд Пурс) ұлттық шәкілі бойынша «kzBBB» төмен емес рейтингтік бағасы бар борыштық бағалы қағаздар; бұрын шығарылған бағалы қағаздарға немесе аталған эмитенттің басқа міндеттемелеріне айырбастау мақсатында эмитенттің міндеттемелерін қайта құрылымдау аясында шығарылған бағалы қағаздар.	21,71%	иә
13	Morningstar (Морнингстар) рейтингтік агенттігінің «3 жұлдыз» төмен емес рейтингтік бағасы бар Exchange Traded Funds (Эксчейндж Трэйдэд Фандс), Exchange Traded Commodities (Эксчейндж Трэйдэд Коммодитис), Exchange Traded Notes (Эксчейндж Трэйдэд Ноутс) пайлары, олардың активтерінің құрылымы негізгі қор индекстерінің бірінің құрылымын немесе пайлары негізгі қор индекстеріне байлаулы баға құрушыны қайталайды.	6,86%	иә
14	Интервалды пай инвестициялық қорларының пайлары, олардың басқарушы компаниялары қор биржасының ресми тізімінің «Аралас» алаңының «инвестициялық қорлардың бағалы қағаздары» секторының талаптарына сәйкесетін қор биржасының ресми тізіміне енгізілген Қазақстан Республикасы заңнамасына сәйкес құрылған заңды тұлғалар болып табылады.	0,00%	иә
15	Лондон қымбат металлдар нарығының қауымдастығы (London bullion market association) қабылдаған және аталған қауымдастықтың құжаттарында «Лондондық сапалы өнім беру» ("London good delivery") стандарты ретінде белгіленген халықаралық стандарттарға сәйкес келетін тазартылған қымбат металлдар, және металл депозиттер, оның ішінде Standard&Poor's» агенттігінің «AA» төмен емес рейтингтік бағасы немесе басқа рейтинг агенттіктерінің бірінің осыған ұқсас деңгейінің рейтингтік бағасы бар Қазақстан Республикасының	0,00%	иә

	бейрезидент банктеріндегі он екі айдан астам мерзімдегі металл депозиттері		
16	Хеджирлеу мақсатында жасалған туынды қаржы құралдары, олардың негізгі активтері осы қосымшаға сәйкес зейнетақы активтері есебінен сатып алуға рұқсат етілген қаржы құралдары болып табылады: опциондар; фьючерстер; форвардтар; своптар; жоғарыда санамаланған туынды қаржы құралдарының жиынтығын құрайтын туынды қаржы құралдары.	0,00%	иә
17	Ашық валюта позициясының максималды үлесі	14,91%	иә

ВСС Invest сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ АҚ портфеліндегі қаржы құралдарын сатып алу, сату және өтеу бойынша ақпарат

6-кесте. Есептік айда қаржы құралдарын сатып алу бойынша мәлімет

Құрал түрі	Валюта	Бағалы қағаздың эмитенті	Номиналдық құны теңгемен
Акция	USD	Apple Inc AAPL US	4 204 482
Акция	USD	Bank of America Corp BAC US	4 046 541
Акция	USD	Johnson & Johnson JNJ US	4 040 676
Депозитарлық қолхат	USD	JD.com Inc. JD US	3 905 568
Депозитарлық қолхат	USD	Novartis A.G. NVS US	3 946 377
Депозитарлық қолхат	USD	Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Ltd TSM US	4 023 500
Облигация	KZT	"Бәйтерек" ұлттық басқарушы холдингі» АҚ BTRKb7	9 000 000
Exchange Traded Funds пайы	USD	iShares Core MSCI Emerging ETF IEMG US	4 119 228
Exchange Traded Funds пайы	USD	Schwab U.S. Large-Cap Value ETF SCHV US	4 111 058
Exchange Traded Funds пайы	USD	SPDR Portfolio Developed World (ETF ex-US) SPDW US	4 187 724
Exchange Traded Funds пайы	USD	Vanguard Value ETF VTV US	4 135 252
Exchange Traded Funds пайы	USD	Wisdom Tree Emerging Markets ex-State-Owned Enterprises Fund XSOE US	4 198 784
Жиынтығы			53 919 190

7-кесте. Есептік айда қаржы құралдарын сату бойынша мәлімет

Құрал түрі	Валюта	Бағалы қағаздың эмитенті	Теңгемен мәміле сомасы
жоқ			
Жиынтығы			

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

Құрал түрі	Валюта	Бағалы қағаздың эмитенті	Теңгемен мәміле сомасы
жоқ			
Жиынтығы			

9-кесте. Есептік айда шетелдік банктердің салымдарына орналастырылғандар бойынша мәлімет

Құрал түрі	Валюта	Банк атауы	Теңгемен мәміле сомасы
жоқ			
Жиынтығы			

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

Құрал түрі	Валюта	Банк атауы	Теңгемен өтеуге сомасы
жоқ			
Жиынтығы			

