

Инвестициялау мақсаты

Зейнетақы активтерінің сақталуын және ықтималдығы жоғары деңгейдегі зейнетақы активтері құнының сақталуын қамтамасыз етуге мүмкіндік беретін тәуекел деңгейі кезінде ұзақ мерзімді келешекте нақты табыс алуды қамтамасыз ету

Портфель параметрлері

Негізгі валюта: **Қазақстан теңгесі**

Зейнетақы активтерінің инвестициялық портфель құны – **12 714 270 046 мың теңге**

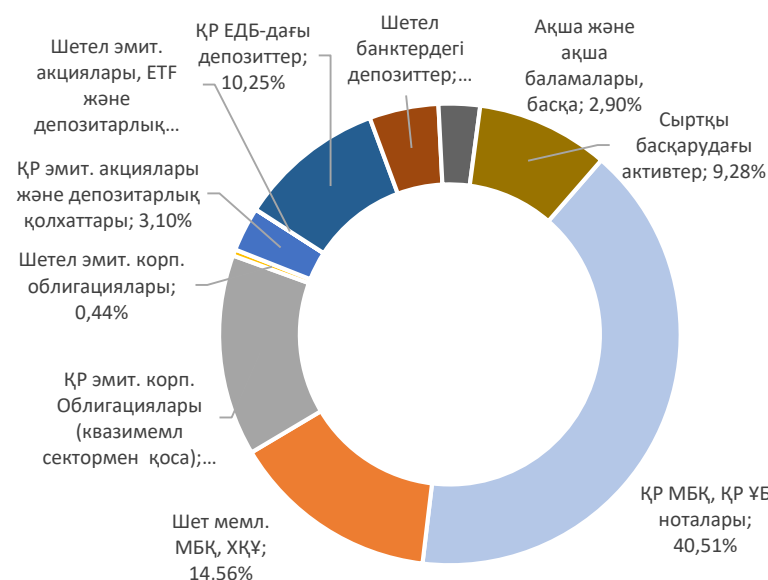
Сенімгерлік басқаруыға берілген зейнетақы активтері:

ҚР Ұлттық Банкі	– 12 710 621 172 мың теңге;
Jusan Invest	– 1 581 645 мың теңге;
Halyk Global Markets	– 964 003 мың теңге;
BCC Invest	– 706 233 мың теңге;
Сентрас Секьюритиз	– 396 993 мың теңге.

«БЖЗК» АҚ зейнетақы активтерінің инвестициялық портфеліне шолу

Зейнетақы активтері портфелінің құрылымы, %

Инвестициялық қызмет нәтижесі



Инвестициялық қызмет нәтижесінде, сондай-ақ шетелдік валюта бағамының құбылмалылығы және қаржы құралдарының нарықтық құнының өзгеруі салдарынан 01.01.2021 жылдан бастап 31.05.2021 жылға дейінгі кезеңге есептелген инвестициялық кіріс мөлшері **671,88 млрд.теңгені** құрады, оның ішінде:

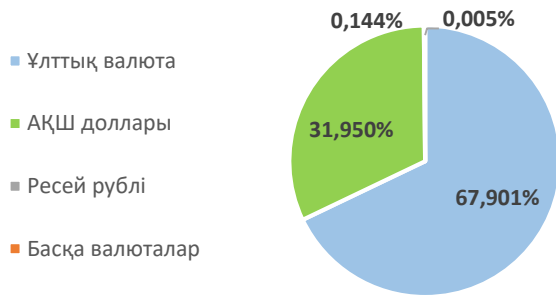
ҚР Ұлттық Банкі	– 671,80 млрд. теңге;
Jusan Invest	- 46,48 млн. теңге;
Halyk Global Markets	- 11,68 млн. теңге;
Сентрас Секьюритиз	- 9,35 млн. теңге;
BCC Invest	- 11,97 млн. теңге.

Атауы	2021жылдың басынан түскен инвестициялық кіріс млрд. теңге
Бағалы қағаздар, орналастырылған салымдар және «кері РЕПО» операциялары бойынша сыйақы түріндегі кірістер	354,11
Бағалы қағаздарды нарықтық қайта бағалаудан түскен кірістер (шығындар)	94,67
Шетел валютасын қайта бағалаудан түскен кірістер (шығындар)	49,36
Сыртқы басқарудан түскен кірістер (шығындар)	88,25
Басқа кірістер (шығындар)	85,49
Жиынтығы:	671,88

Сенімгерлік басқарудағы компаниялар бойынша зейнетақы активтері портфелінің құрылымы, %

Құрылым/Басқарушы	BCC Invest	Halyk Global Markets	Jusan Invest	Сентрас Секьюритиз	ҚР ҰБ
ҚР МБҚ, ҚР ҰБ ноталары	0,00%	0,00%	48,59%	93,45%	40,51%
Шет мемл. МБҚ, ХҚҰ	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	14,57%
ҚР эмит. корп. Облигациялары (квзимемл сектормен қоса)	12,85%	0,00%	0,00%	0,00%	14,10%
Шетел эмит. корп. облигациялары	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,44%
ҚР эмит. акциялары және депозитарлық қолжаттары	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	3,10%
Шетел эмит. акциялары және депозитарлық қолжаттары	35,10%	15,55%	47,29%	0,00%	0,00%
ҚР ЕДБ-дағы депозиттер	8,24%	5,27%	0,00%	0,00%	10,25%
Шетел банктердегі депозиттер	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	4,85%
РЕПО/Кері РЕПО, Ақша және ақша баламалары, басқа	43,82%	79,18%	8,01%	6,55%	2,89%
Сыртқы басқарудағы активтер	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	9,28%
Жасалаған мәмілелер бойынша төлеуге міндеттемелер	0,00%	0,00%	3,89%	0,00%	0,00%
Барлығы, 3А портфельдегі үлесі	100%	100%	100%	100%	100%

Сенімгерлік басқарудағы компаниялар бойынша валюталар бөлігіндегі зейнетақы активтері портфелінің құрылымы, %

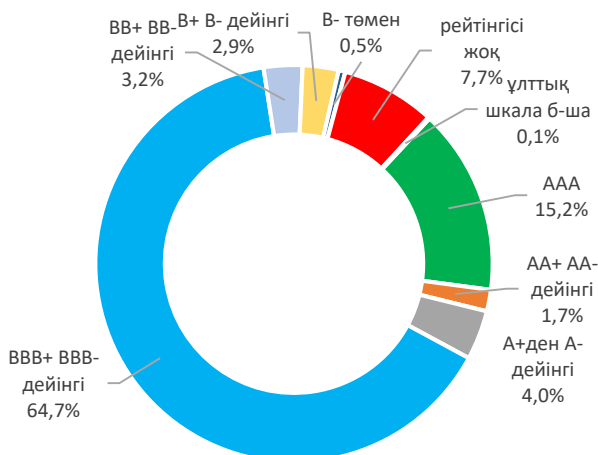


Валюта/Басқарушы	BCC Invest	Halyk Global Markets	Jusan Invest	Сентрас Секьюритиз	ҚР ҰБ
Ұлттық валюта	64,44%	84,45%	52,71%	100,00%	67,90%
АҚШ доллары	35,56%	15,55%	47,29%	0,00%	31,95%
Ресей рублі	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,14%
Басқа валюталар	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Барлығы	100%	100%	100%	100%	100%

БЖЗҚ инвестициялық декларациясында белгіленген ҚР Ұлттық Банкі сенімгерлік басқаруындағы зейнетақы активтерінің валюталық портфелін мақсатты бөлуге сәйкес жаһандық акцияларға, дамушы елдердің облигацияларына және инвестициялық деңгейдегі корпоративтік облигацияларға индексті инвестициялау үшін мынадай шетелдік басқарушы компаниялар тартылды:

- Aviva Investors Global Services Limited дамушы елдер облигацияларының мандаты бойынша;
- HSBC Global Asset Management (UK) Limited, Blackrock Financial Management және Robeco Institutional Asset Management B.V. жаһандық акциялар мандаты бойынша;
- PGIM Limited и Principal Global Investors (Europe) Limited инвестициялық деңгейдегі корпоративтік облигациялар мандаты бойынша.

Сенімгерлік басқарудағы компаниялардың кредиттік сапа бойынша зейнетақы активтері портфелінің құрылымы, %



Рейтинг/Басқарушы	BCC Invest	Halyk Global Markets	Jusan Invest	Сентрас Секьюритиз	ҚР ҰБ
AAA	4,41%	0,00%	0,00%	0,00%	15,17%
AA+ AA- дейінгі	14,31%	0,00%	0,00%	0,00%	1,75%
A+ден A- дейінгі	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	4,03%
BBB+ BBB- дейінгі	2,32%	0,00%	50,68%	100,00%	64,66%
BB+ BB- дейінгі	10,63%	0,00%	0,00%	0,00%	3,16%
V+ V- дейінгі	7,48%	0,00%	0,00%	0,00%	2,92%
V- төмен рейтингісі жоқ ұлттық шкала б-ша	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,55%
рейтингісі жоқ ұлттық шкала б-ша	60,85%	100,00%	49,32%	0,00%	7,66%
Барлығы	100%	100%	100%	100%	100%

Халықаралық шәкіл бойынша «AAA»-дан «BBB-» дейінгі бағалы қағаздар/эмитент рейтингісі бар барынша төмен тәуекел деңгейдегі қаржы құралдары инвестициялық портфельдің¹ 85,59%-ын құрайды.

Халықаралық шәкіл бойынша «BB+»-дан «B-» дейінгі рейтингісі бар қаржы құралдары 6,08%-ды құрайды, 0,55%– «B-» төмен.

Ұлттық шәкіл бойынша «kzBB+» рейтингісі бар қаржы құралдары 0,12%-ды құрайды.

Рейтингтік бағасы жоқ қаржы құралдары 7,66%-ды құрайды.

Экономика секторлары бойынша зейнетақы активтері портфелінің құрылымы, %



* –сыртқы басқарудағы активтер, дебиторлық берешек, шоттардағы ақша қаражатының қалдығы және туынды қаржы құралдары.

¹ Сыртқы басқарудағы активтер, шоттардағы қалдық, жолдағы ақша және басқаларды қоспағанда, инвестициялық портфельдегі активтер.

Сенімгерлік басқарудағы компаниялар бойынша экономика секторы бөлігіндегі зейнетақы активтері портфелінің құрылымы, %

Экономика секторы/Басқарушы	BCC Invest	Halyk Global Markets	Jusan Invest	Сентрас Секьюритиз	ҚР ҰБ
Егеменді міндеттемелер, ХҚҰ	0,00%	0,00%	48,59%	93,45%	56,94%
Қаржы секторы	42,39%	20,82%	47,29%	0,00%	21,09%
Ауыл шаруашылығы	5,97%	0,00%	0,00%	0,00%	5,56%
Энергетика, мұнай және газ	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	2,15%
Көлік	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	1,94%
Өңдеуші өнеркәсіп	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	1,40%
АТ (технология, байланыс, қызметтер)	3,53%	0,00%	0,00%	0,00%	0,59%
Тамақ өнеркәсібі	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,01%
Денсаулық сақтау	4,30%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Көтерме және бөлшек сауда	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
басқалар*	20,72%	57,32%	0,21%	17,58%	10,32%
Барлығы	100%	100%	100%	100%	100%

* –сыртқы басқарудағы активтер, дебиторлық берешек, шоттардағы ақша қаражатының қалдығы және туынды қаржы құралдары.

Сенімгерлік басқарудағы компаниялар бойынша елдер бөлігіндегі зейнетақы активтері портфелінің құрылымы, %

Мемлекет/Басқарушы	BCC Invest	Halyk Global Markets	Jusan Invest	Сентрас Секьюритиз	ҚР ҰБ
АҚШ	31,56%	15,55%	47,29%	0,00%	9,91%
ХҚҰ	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	4,15%
Біріккен корольдік (УК)	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	1,01%
Сингапур	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,95%
Нидерланды	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,86%
Франция	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,79%
Біріккен корольдік (УК)	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,69%
Индонезия	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,61%
Канада	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,32%
Нидерланды	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,22%
Ресей Федерациясы	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,12%
Перу	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,10%
Қытай	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,08%
Индия	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,08%
Чили	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,08%
Польша	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,07%
Филиппины	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,04%
Мексика	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,03%
Италия	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,02%
Германия	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,02%
Чили	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,01%
Швейцария	1,82%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Тайвань (Қытай)	1,71%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Барлығы	35,10%	15,55%	47,29%	0,00%	19,86%

