

Инвестициялау мақсаты

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

Портфель параметрлері

Негізгі валюта: Қазақстан теңгесі

Зейнетақы активтерінің инвестициялық портфель құны – 21 009 918 674,75 мың теңге

ИПБ зейнетақы активтері бойынша инвестициялық қызметі 01.04.2021ж. бастап қарастырылды

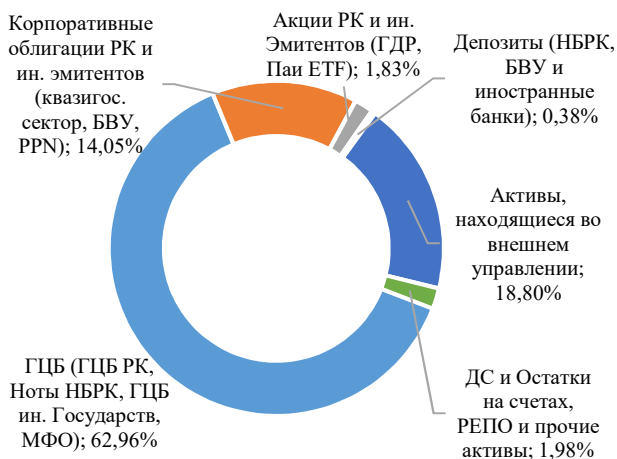
Halyk Finance зейнетақы активтері бойынша ИПБ инвестициялық қызметін 15.12.2022ж. бастады

Сенімгерлік басқаруға берілген зейнетақы активтері:

	Активы, млрд тенге на 01.10.24г.	Инвест. доход, млрд тенге с 01.01.24г.	Доходность ПА, % с 01.01.24г.
BCC Invest	5,18	0,50	10,67%
Halyk Global Markets	4,40	0,45	10,84%
Jusan Invest	9,79	1,07	12,49%
Сентрас Секьюритиз	1,62	0,16	12,23%
Halyk Finance	38,72	3,67	11,52%
Национальный Банк РК	20 950,20	2 116,77	11,22%

«БЖЗҚ» АҚ зейнетақы активтерінің инвестициялық портфеліне шолу¹

Зейнетақы активтері порфелінің құрылымы, %



Инвестициялық қызмет нәтижесі

Инвестициялық қызмет нәтижесінде, сондай-ақ шетелдік валюта бағамының және қаржы құралдарының нарықтық құнының өзгеруі салдарынан 01.01.2024 жылдан бастап 30.09.2024 жылға дейінгі кезеңге есептелген инвестициялық кіріс мөлшері 2 123 млрд теңгені құрады, оның ішінде:

Атауы	2024 жылдың басынан түскен инвестициялық кіріс млрд тенге
Бағалы қағаздар бойынша (оның ішінде орналастырылған салымдар және «кері РЕПО» операциялары) сыйақы түріндегі және нарықтық қайта бағалаудан түскен кірістер	1 271,18
Шетел валютасын қайта бағалаудан түскен кірістер (шығындар)	228,50
Сыртқы басқарудан түскен кірістер (шығындар)	620,16
Басқа кірістер (шығындар)	2,76
Жиынтығы:	2 122,60

Сенімгерлік басқарудағы компаниялар бойынша зейнетақы активтері портфелінің құрылымы, %

■ Ақша, Шоттардағы қаражат, РЕПО және басқа активтер

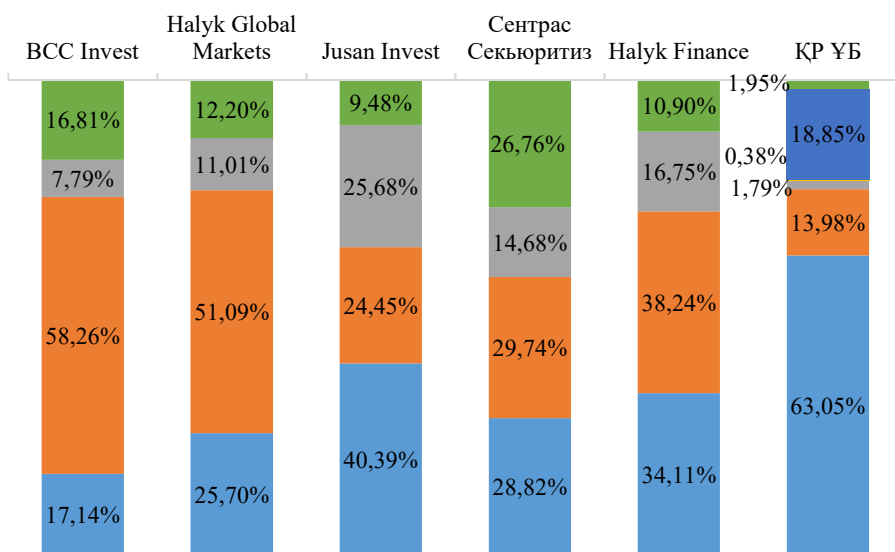
■ Сыртқы басқарудағы активтер

■ Депозиттер (ҚР ҰБ, ЕДБ және шет ел банктері)

■ ҚР және шет ел эмитенттерінің акциялары (ГДК, ETF пайлары)

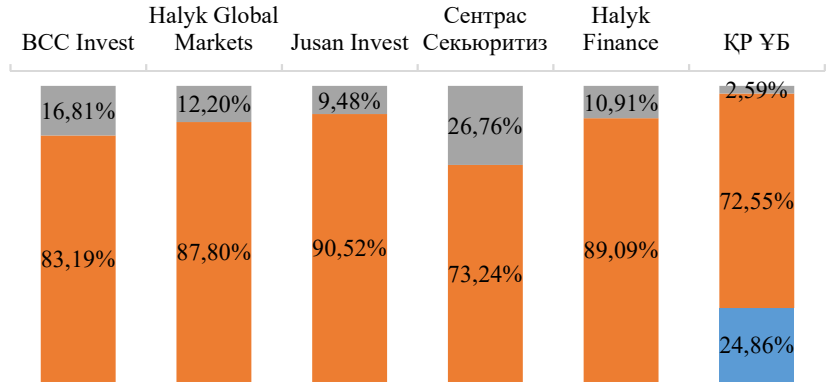
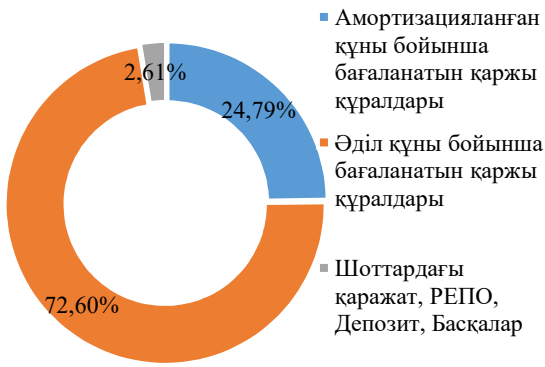
■ ҚР және шет ел эмитенттерінің корп. облигациялары (квазимем. сектор, ЕДБ, PPN)

■ МБҚ (ҚР МБҚ, ҚР ҰБ ноталары, Шет мемл. МБҚ, ХҚҰ)



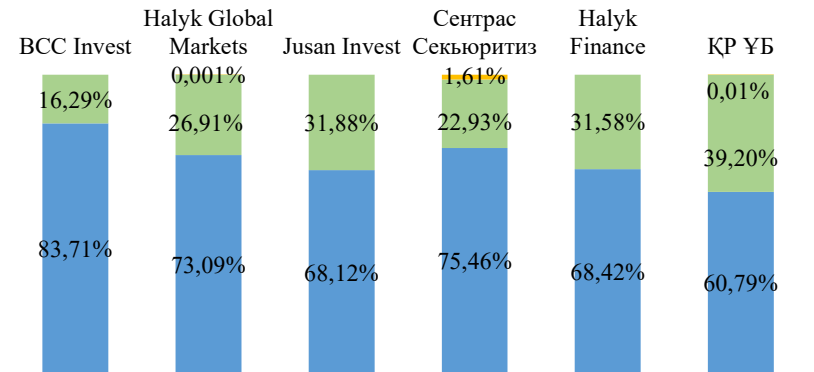
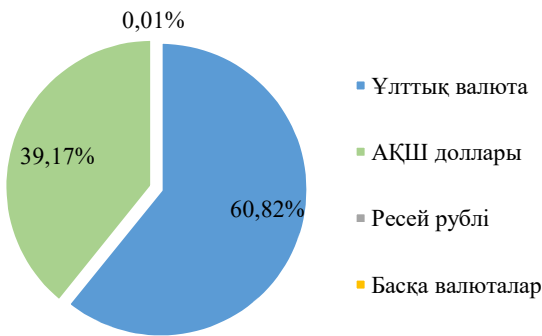
¹ Материалдар ҚРҰБ (17.10.2024 жылғы шығыс №05-4-02/674 хат), «BCC Invest» АҚ (14.10.2024 жылғы шығыс №0937/24 хат), «Jusan Invest» АҚ (07.10.2024 жылғы шығыс №12/817 хат), «Halyk Finance» АҚ (07.10.2024 жылғы шығыс №09/1093 хат), «Сентрас Секьюритиз» АҚ (10.10.2024 жылғы шығыс №10/567 хат), «Halyk Global Markets» АҚ (07.10.2024 жылғы шығыс №07-1024/1 хат)

Сенімгерлік басқарудағы компаниялардың бағалы қағаздарды есепке алу санаты бойынша зейнетақы активтері портфелінің құрылымы, %



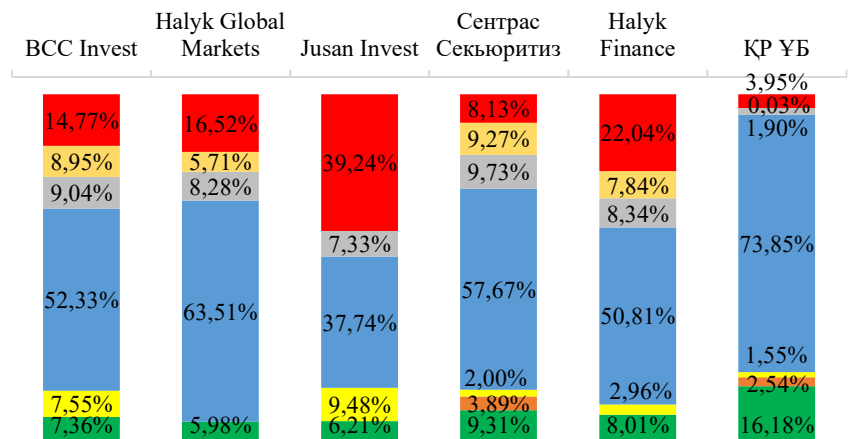
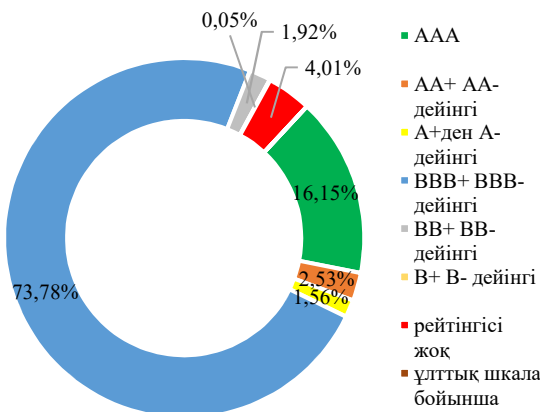
БЖЗК инвестициялық портфелінің зейнетақы активтерінің 24,79%-ын амортизацияланған құны бойынша ескерілетін бағалы қағаздар құрайды. Әділ құны бойынша бағаланатын есепке алу санатындағы бағалы қағаздардың үлес салмағы зейнетақы активтерінің 72,6% - ын құрады. Ақша қаражаты, РЕПО операциялары, Депозиттер және өзгелері қалған бөлікті - 2,61% құрайды.

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



БЖЗК Инвестициялық декларациясында белгіленген ҚРҰБ сенімгерлік басқаруындағы зейнетақы активтерінің валюталық портфелін нысаналы бөлуге сәйкес 01.10.2024 ж. жағдай бойынша индекстік инвестициялау шеңберінде шетелдік басқарушы компаниялардың сыртқы басқаруындағы активтер 3 946,14 млрд теңгені (инвестициялық портфельдің 18,78%) құрайды.

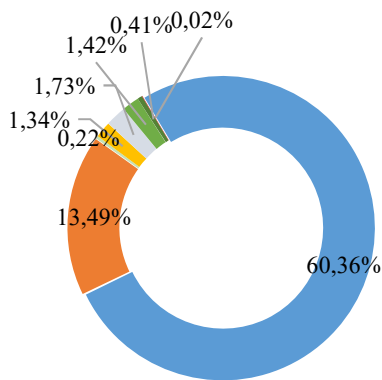
Сенімгерлік басқарудағы компаниялардың кредиттік сапа бойынша зейнетақы активтері портфелінің құрылымы, %



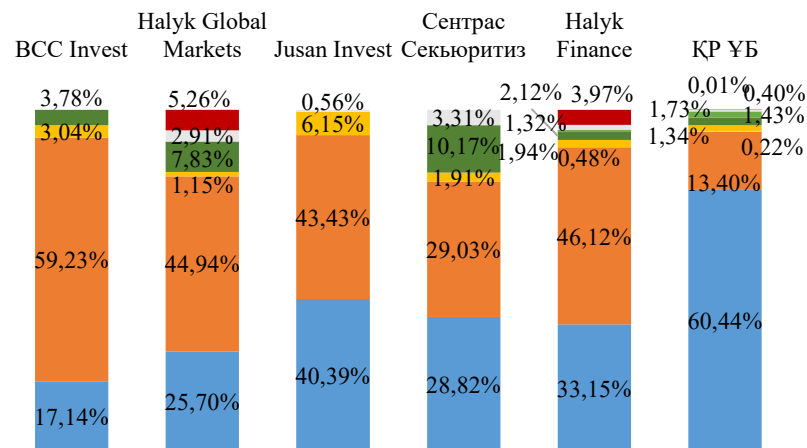
Халықаралық шәкіл бойынша «AAA»-дан «BBB-» дейінгі бағалы қағаздар/эмитент рейтингісі бар барынша төмен тәуекел деңгейдегі қаржы құралдары инвестициялық портфельдің² 94,02%-ын құрайды. Халықаралық шәкіл бойынша «BB+»-дан «B-» дейінгі және ұлттық шәкіл бойынша «kzBB+» рейтингісі бар қаржы құралдары 1,97%-ды құрайды. Рейтингтік бағасы жоқ қаржы құралдарының үлесі - 4,01%.

² Сыртқы басқарудағы активтер, шоттардағы қалдық, жолдағы ақша және пай қорларын қоспағанда

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

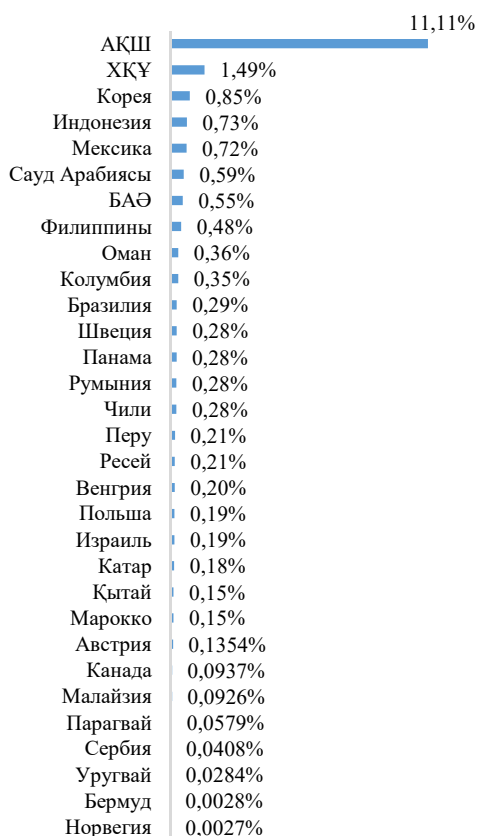


■ Егеменді міндеттемелер, ХҚҰ
■ Қаржы секторы
■ Ауыл шаруашылығы
■ Көлік
■ Энергетика, мұнай және газ
■ Өңдеуші өнеркәсіп
■ АТ (технология, байланыс, қызметтер)
■ Басқа (Тамақ, Сауда, Денсаулық)



* сыртқы басқарудағы активтер, дебиторлық берешек және ақша нарығының құралдары есепке алынбады

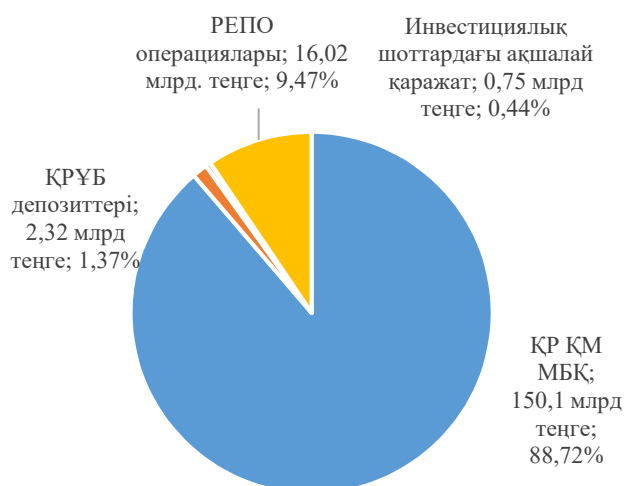
Сенімгерлік басқарудағы компаниялар бойынша елдер бөлігіндегі зейнетақы активтері портфелінің құрылымы, %



Мемлекет/Басқарушы	BCC Invest	Halyk Global Markets	Jusan Invest	Сентрас Секьюритиз	Halyk Finance	ҚР ҰБ
АҚШ	15,60%	15,46%	37,53%	8,92%	26,03%	11,07%
ХҚҰ	2,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	1,50%
Корея	0,00%	2,91%	0,00%	1,24%	1,32%	0,85%
Индонезия	0,00%	3,02%	0,00%	0,00%	1,14%	0,73%
Мексика	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,72%
Сауд Арабиясы	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,60%
БАӘ	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,55%
Филиппины	1,16%	3,01%	0,00%	0,00%	0,05%	0,48%
Оман	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,36%
Колумбия	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,35%
Бразилия	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,29%
Швеция	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,29%
Панама	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,28%
Румыния	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,28%
Чили	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,28%
Перу	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,21%
Ресей	0,00%	0,00%	3,52%	0,00%	0,96%	0,20%
Венгрия	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,20%
Польша	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,19%
Израиль	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,19%
Катар	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,18%
Қытай	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,15%
Марокко	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,15%
Австрия	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,14%
Канада	0,00%	0,00%	0,00%	1,61%	0,00%	0,09%
Малайзия	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,09%
Парагвай	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,06%
Сербия	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,04%
Уругвай	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,03%
Бермуд	1,62%	2,14%	0,00%	0,00%	1,09%	0,00%
Норвегия	0,00%	3,00%	0,00%	0,00%	1,14%	0,00%
Барлығы	20,39%	29,54%	41,05%	11,77%	31,73%	20,56%

Жұмыс берушінің міндетті зейнетақы жарналары есебінен қалыптастырылған «БЖЗҚ» АҚ зейнетақы активтерін инвестициялық басқару бойынша ақпарат

Зейнетақы активтері порфелінің құрылымы, %



Инвестициялық қызмет нәтижелері

2024 жылғы 1 қазандағы жағдай бойынша ҚРҰБ сенімгерлік басқаруындағы жұмыс берушінің міндетті зейнетақы жарналары есебінен қалыптастырылған зейнетақы активтері (бұдан әрі – ЖМЗЖ ЗА) 169,2 млрд теңгені құрады.

ЖМЗЖ ЗА инвестициялық портфеліндегі борыштық қаржы құралдарын (ҮТМ) өтеуге орташа алынған кірістілік жылдық 12,50% құрады.

Басқарудың басынан бастап ЖМЗЖ ЗА бойынша есептелген инвестициялық кіріс мөлшері 9,19 млрд теңгені құрады.

2024 жылғы 1 қазандағы жағдай бойынша басқарудың басынан бергі кезең үшін ЖМЗЖ ЗА кірістілігі 8,87% құрады.

ЖМЗЖ ЗА инвестициялық портфеліне ұлттық валютада белгіленген қаржы құралдары ғана кіреді.