

Данные на 01.10.2024

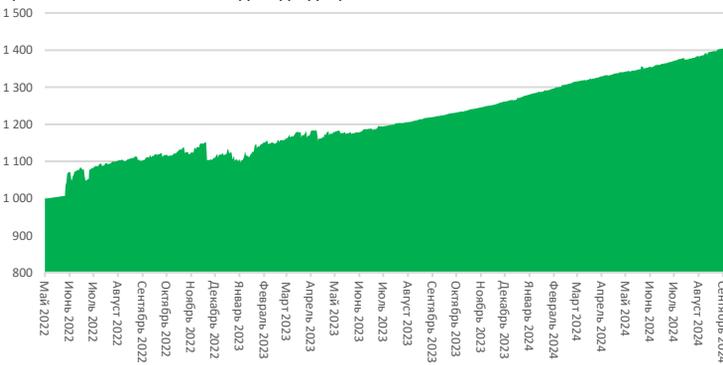
Фонд инвестирует в инструменты денежного рынка и облигации для получения стабильного денежного потока для пайщиков. Фонд не инвестирует средства в долевые инструменты. Активное управление Фонда направлено на получение ставок сопоставимых с рыночными, а также возможность на получение премии.

ИНВЕСТИЦИОННЫЕ ПРИНЦИПЫ ФОНДА*:

1. Инструменты денежного рынка не менее 50%
2. Доля акций = 0,0% от активов Фонда
3. Доллары США = 0,0% от активов Фонда
4. Рейтинг инструментов: ВВ и выше
5. Активный стиль управления

*Инвестиционные принципы Фонда являются целевыми показателями и могут отличаться от реальной структуры на момент составления отчета, в связи с динамической структурой портфеля, изменением СЧА, рыночными и прочими факторами.

РОСТ 1 000 ТГ, С МОМЕНТА ОСНОВАНИЯ (С УЧЕТОМ РЕИНВЕСТИРОВАНИЯ ДИВИДЕНДОВ)



РЕЗУЛЬТАТЫ УПРАВЛЕНИЯ:

	YTD (абс.)	За 1 год (год-х)	По итогам 2023	По итогам 2022	С основания (год-х)
Доходность, %	12,40%	16,64%	13,72%	20,37%*	15,65%

* с 25 мая 2022 года

ОЦЕНКА РИСКА:

Результаты (VaR & CVaR)	тенге	%
Value at risk	2 316 174	1,61%
Conditional Value at Risk (CVaR)	2 904 575	2,02%
Stand-alone VaR	3 555 847	2,48%

Для расчета показателя VaR используется классическая модель EWMA (Exponentially Weighted Moving Average), в качестве временного горизонта берется недельный период, а доверительного уровня 95% вероятность.

В таблице представлены результаты расчетов VaR (Value at Risk), характеризующие риск как величину, которую не превысят ожидаемые в течение данного периода времени потери с заданной вероятностью.

ТЕКУЩАЯ СТРУКТУРА АКТИВОВ ФОНДА:

По состоянию на отчетную дату (на 01.10.2024) активы Фонда полностью сформированы из государственных облигаций Министерства финансов РК, облигаций банка АО «Home Credit Bank», высокодоходных облигаций ТОО «МФО «TAS FINANCE GROUP» и операций РЕПО, которые удалось приобрести с высокой доходностью и высоким потенциалом положительной переоценки, что положительно отразилось на показателях Фонда.

ПАРАМЕТРЫ ФОНДА:

ОБЩИЕ ДАННЫЕ	
Тип:	интервальный паевой инвестиционный фонд
Дата регистрации:	28 января 2020 года
Дата формирования (основание):	25 мая 2022 года
Кастодиан:	АО «Евразийский банк»
Номинальная стоимость пая:	1000 тенге
Минимальная сумма взноса при первом приобретении:	100 000 тенге
Текущая стоимость пая:	1 294,00 тенге
Чистые активы:	704,48 млн. Тенге
Вознаграждение Управляющей компании:	0,50%
Даты в которые можно выйти из Фонда	15 февраля, 15 мая, 15 августа и 15 ноября
Наличие маркет-мейкера	Ежедневные котировки на KASE
Лицензия на осуществление деятельности на рынке ценных бумаг	№3.2.235/12 от 10 июля 2018 г., выданная Национальным Банком Республики Казахстан

РАСПРЕДЕЛЕНИЕ ПО КЛАССАМ АКТИВОВ	
РЕПО, Денежные средства	79,63%
Суверенные облигации	8,72%
Корпоративные облигации	11,64%

РАСПРЕДЕЛЕНИЕ ПО РЕЙТИНГУ ЭМИТЕНТОВ	
BBB	8,72%
BB	4,32%
B	7,32%
РЕПО, Денежные средства	79,63%

ТОП ИНВЕСТИЦИИ (ЭМИТЕНТЫ)	
Министерство Финансов Республики Казахстан (гос. сектор, Казахстан)	
АО «Home Credit Bank» (финансы, Казахстан)	
ТОО «МФО «TAS FINANCE GROUP» (финансы, Казахстан)	20,37%

РАСПРЕДЕЛЕНИЕ ПО ОТРАСЛЯМ	
Суверенные облигации	8,72%
Финансы	11,64%

ГЕОГРАФИЧЕСКОЕ РАСПРЕДЕЛЕНИЕ АКТИВОВ (без учета РЕПО и денежных средств)	
Казахстан	20,37%

ВАЛЮТНОЕ РАСПРЕДЕЛЕНИЕ АКТИВОВ	
Казахстанский тенге	100,0%
Доллар США	0,00%

ДЮРАЦИЯ ПОРТФЕЛЯ ОБЛИГАЦИЙ (кумулятивно)	
до 1 года	12%
до 3 лет	20%
Прочее (акции, ETF, РЕПО)	80%

КОНТАКТНАЯ ИНФОРМАЦИЯ:

Республика Казахстан, г. Алматы, ул. Панфилова 98
веб-сайт: <http://bcc-invest.kz/>

Результаты инвестирования в прошлом не гарантируют доходы в будущем, стоимость паев может как увеличиваться, так и уменьшаться. Государство не гарантирует доходности инвестиций в инвестиционные фонды. Правилами паевого инвестиционного фонда предусмотрено наличие надбавок/скидок, взимание которых уменьшит доходность инвестиций в паи паевого инвестиционного фонда. Перед приобретением паев инвестиционного фонда инвестору необходимо ознакомиться с правилами инвестиционного фонда и инвестиционной декларацией. С информацией о примененных уполномоченным органом к Компании санкциях и ограниченных мерах воздействия можно ознакомиться на корпоративном интернет-сайте Компании.