

## «БЖЗҚ» АҚ ЗЕЙНЕТАҚЫ АКТИВТЕРІН ИНВЕСТИЦИЯЛЫҚ БАСҚАРУ БОЙЫНША АҚПАРАТ

2024 жылғы 1 қазандағы жағдай бойынша Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкінің (бұдан әрі – ҚРҰБ) сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ зейнетақы активтері<sup>1</sup> (бұдан әрі – ЗА) 20 950,201 млрд.<sup>2</sup> теңгені құрады.

БЖЗҚ зейнетақы активтерінің есебінен құрылған қаржы құралдарының инвестициялық портфелінің құрылымы 1-кестеде көрсетілген.

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

Атауы	01.01.2024 жылға ағымдағы құны	01.01.2024 жылға үлесі	01.10.2024 жылға ағымдағы құны	01.10.2024 жылға үлесі	млрд. теңге Жыл басынан өсуі/төмендеуі
ҚР ҚМ МБҚ	8 289,48	46,55%	8 859,08	42,29%	6,87%
Шетелдік мемлекеттердің МБҚ	22,36	0,13%	890,86	4,25%	3884,39%
ХҚҰ	359,46	2,02%	348,21	1,66%	-3,13%
ҚР эмитенттерінің корпоративтік облигациялары	14,01	0,08%	13,56	0,07%	-3,22%
ҚР квазимемлекеттік ұйымдарының облигациялары	1 619,89	9,10%	1 950,77	9,31%	20,43%
ҚР ЕДБ облигациялары	848,05	4,76%	953,89	4,56%	12,48%
PPN (құрылымдық ноттар)	7,23	0,04%	7,88	0,04%	8,94%
ҚР эмитенттерінің акциялары және депозитарлық қолхаттары	350,53	1,97%	377,22	1,80%	7,61%
Депозиттер	197,21	1,11%	25,98	0,12%	-86,83%
ҚРҰБ депозиттері	876,66	4,92%	55,40	0,26%	-93,68%
Инвестициялық шоттардағы ақшалай қаражат	48,34	0,27%	9,21	0,04%	-80,95%
РЕПО операциялары	26,71	0,15%	401,06	1,91%	1401,72%
<b>Активтерді индекстік басқару, оның ішінде:</b>	5 146,10	28,90%	7 057,07	33,69%	37,13%
дамыған елдердің активтері	1 644,24	9,23%	1 824,10	8,71%	10,94%
дамушы елдердің активтері	1 122,87	6,31%	1 286,83	6,14%	14,60%
<b>сыртқы басқарудағы активтер дамушы елдер облигацияларының мандаты бойынша:</b>	<b>2 378,99</b>	<b>13,36%</b>	<b>3 946,14</b>	<b>18,85%</b>	<b>65,87%</b>
Aviva Investors Global Services Limited	173,41	0,97%	248,31	1,19%	43,19%
<b>ғаламдық акциялар мандаты бойынша:</b>					
Invesco Asset Management Deutschland GmbH	170,5	0,96%	308,48	1,47%	80,93%
HSBC Global Asset Management (UK) Limited	311,96	1,75%	485,29	2,32%	55,56%
UBS Asset Management (UK) Ltd	226,16	1,27%	406,04	1,94%	79,54%
Blackrock Financial Management	176,62	0,99%	294,40	1,41%	66,69%
BlackRock Investment Management	116,41	0,65%	204,81	0,98%	75,94%
Robeco Institutional Asset Management B.V.	219,38	1,23%	315,18	1,50%	43,67%

<sup>1</sup> Міндетті зейнетақы жарналары, міндетті кәсіптік зейнетақы жарналары және ерікті зейнетақы жарналары есебінен қалыптастырылған

<sup>2</sup> зейнетақы жарналары мен төлемдері шоттарындағы ақшаны есепке алмағанда

инвестициялық деңгейдегі корпоративтік облигациялар мандаты бойынша:					
Principal Global Investors (Europe) Limited	489,75	2,75%	557,75	2,66%	13,88%
PGIM Limited	494,79	2,78%	566,81	2,71%	14,56%
PIMCO Asia Pte Ltd	-	-	559,07	2,67%	100,00%
<b>ҚРҰБ басқаруындағы ЗА жиынтығы</b>	<b>17 806,03</b>	<b>100,00%</b>	<b>20 950,20</b>	<b>100,00%</b>	<b>17,66%</b>
Зейнетақы жарналары мен төлемдері шоттарындағы ақша	38,97		13,08		
<b>Зейнетақы активтерінің жиынтығы</b>	<b>17 845,01</b>		<b>20 963,28</b>		<b>17,47%</b>

БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфеліндегі борыштық қаржы құралдарын өтеуге орташа алынған кірістілік (ҮТМ) 01.10.2024 жылғы жағдай бойынша жылдық 9,83% құрады, оның ішінде теңгеге номинирленген – жылдық 11,51%, шетелдік валютада – жылдық 4,50%.

#### **Қазақстан Республикасы Қаржы министрлігінің мемлекеттік бағалы қағаздары**

БЖЗҚ ЗА портфелінде негізгі үлесті ҚР Қаржы министрлігінің МБҚ құрайды, олардың есептік айдағы ағымдағы құны 25,43 млрд. теңгеге азайды және 8 859,08 млрд. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 42,29% құрады.

Қарастырылып отырған кезеңде ҚР Қаржы министрлігінің бағалы қағаздары сатып алынған жоқ және сатылған жоқ.

Есептік айда 17,72 млрд.теңге көлемінде ҚР МБҚ өтелді.

Есептік күнге ҚР Қаржы министрлігінің МБҚ бойынша өтеуге орташа алынған кірістілік жылдық 11,69% құрады.

#### **Өтімділіктің қосалқы портфеліндегі шетелдік мемлекеттердің мемлекеттік бағалы қағаздары**

Есептік ай үшін өтімділіктің қосалқы портфеліндегі шетелдік мемлекеттердің мемлекеттік бағалы қағаздарының ағымдағы құны 128,69 млрд. теңгеге азайды және 890,86 млрд. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 4,25% құрады.

Қарастырылып отырған кезеңде орташа алынған кірістілігі жылдық 4,92% құрайтын номиналды құны бойынша 311,78 млрд.теңге көлемінде АҚШ МБҚ сатып алынды.

Есептік айда 123,22 млрд.теңге көлемінде АҚШ МБҚ сатылды, сондай-ақ 318,02 млрд.теңге көлемінде АҚШ МБҚ өтелді.

Есептік күнге БЖЗҚ ЗА валюталық портфелінің өтімділіктің қосалқы портфеліндегі шетелдік мемлекеттердің МБҚ өтеуге орташа алынған кірістілігі жылдық 4,97% құрады.

#### **Халықаралық қаржы ұйымдарының облигациялары**

Есептік айда халықаралық қаржы ұйымдары облигацияларының ағымдағы құны 3,01 млрд. теңгеге ұлғайды және 348,21 млрд. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 1,66% құрады.

Халықаралық қаржы ұйымдарының бағалы қағаздары сатып алынбады, сатылмады және өтелмеді.

Халықаралық қаржы ұйымдарының облигацияларын өтеуге орташа алынған кірістілік теңгеге номинирленген сыйақының белгіленген мөлшерлемесімен жылдық 12,59%, сыйақының индекстелген мөлшерлемесі – инфляция және сыйлықақы құрады.

#### **Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банктеріндегі депозиттер**

Орташа алынған өтеу мерзімі 0,18 жыл болатын ҚР ЕДБ салымдарының ағымдағы құны есептік айда 124,96 млрд. теңгеге азайды және 25,98 млрд. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 0,12% құрады.

Есептік айда 20,00 млрд.теңге көлемінде «ForteBank» АҚ, 25,00 млрд.теңге көлемінде «Еуразиялық Банк» АҚ, 55,00 млрд.теңге көлемінде «Қазақстан Халық Банкі» АҚ және 20,00

млрд.теңге көлемінде «First Heartland Jusan Bank» АҚ депозиттері өтелді. Есептік айда ҚР ЕДБ салымдары орналастырылмады.

Есептік күнге ҚР ЕДБ салымдарын өтеуге орташа алынған кірістілік жылдық 9,50% құрады.

#### **ҚР Ұлттық Банкіндегі депозиттер**

Есептік күнге ҚР Ұлттық Банкіндегі депозиттердің ағымдағы құны 55,40 млрд.теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 0,26%.

Есептік айда ағымдағы өтімділікті басқару аясында зейнетақы активтері бойынша табыстылықты ұстап тұру мақсатында ҚР Ұлттық Банкінің депозиттеріне инвестиция салынды. Мәмілелердің орташа көлемі жылдық 13,25% орташа алынған кірістілікпен 27,14 млрд. теңгені құрады.

#### **Қазақстан Республикасы эмитенттерінің корпоративтік облигациялары**

ҚР эмитенттерінің корпоративтік облигацияларының ағымдағы құны 13,56 млрд. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 0,07% құрады.

Қарастырылып отырған кезеңде ҚР эмитенттерінің корпоративтік облигациялары сатып алынбады, сатылмады және өтелмеді.

#### **Қазақстан Республикасы квазимемлекеттік ұйымдардың облигациялары**

Есептік айда ҚР квазимемлекеттік ұйымдардың облигацияларының ағымдағы құны 12,88 млрд. теңгеге ұлғайды және 1 950,77 млрд. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 9,31% құрады.

Қарастырылып отырған кезеңде ҚР квазимемлекеттік ұйымдарының бағалы қағаздары сатып алынбады, сатылмады және өтелмеді.

Есептік күнге ҚР квазимемлекеттік ұйымдарының облигациялары бойынша өтеуге орташа алынған кірістілік теңгеге номинирленген жылдық 11,04%, АҚШ долларына – жылдық 5,49% құрады.

#### **Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банктерінің облигациялары**

Есептік айда ҚР ЕДБ облигацияларының ағымдағы құны 59,24 млрд.теңгеге ұлғайды және 953,89 млрд.теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 4,56% құрады.

Қарастырылып отырған кезеңде 5,85% көлемінде тәуекел үшін инфляция мен сыйлықақылар сомасына тең сыйақы мөлшерлемесімен номинал құны бойынша жалпы көлемі 79,95 млрд.теңгеге «Bank RBK» Банкі» АҚ индекстелген облигациялары сатып алынды.

Есептік айда 24,5 млрд.теңге көлемінде «Bank RBK» Банкі» АҚ облигациялары өтелді. Есептік кезеңде ҚР ЕДБ облигациялары сатылмады.

Есептік күнге ҚР ЕДБ облигациялары бойынша өтеуге орташа алынған кірістілік жылдық 10,45% құрады.

#### **Шетелдік эмитенттердің PPN (құрылымдық ноттары)**

Есептік айда шетелдік эмитенттердің PPN (құрылымдық ноттар) ағымдағы құны 7,88 млрд. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 0,04% құрады.

Шетелдік эмитенттердің PPN (құрылымдық ноттар) сатылмады, өтелмеді және сатып алынбады.

#### **Қазақстан Республикасы эмитенттерінің акциялары және депозитарлық қолхаттары**

Есептік айда ҚР эмитенттері акцияларының және депозитарлық қолхаттарының ағымдағы құны 10,67 млрд. теңгеге азайды және 377,22 млрд. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 1,80% құрады.

Қарастырылып отырған кезеңде ҚР эмитенттерінің акциялары мен депозитарлық қолхаттары сатып алынбады және сатылмады.

### **Валюталық портфельді индекстік басқару**

Активтерді индекстік басқару инвестордың стратегиялық мүдделерін көрсететін бағалы қағаздар жиынтығы болып табылатын эталондық портфельге қатысты инвестициялар портфелін қалыптастыруды көздейді. Эталондық портфельдің кірістілігі инвестициялар портфелін басқарудың тиімділігін бағалау кезінде шара ретінде қызмет етеді. Эталондық портфель ретінде жетекші әлемдік қаржы компаниялары немесе ҚРҰБ әзірлеген және қадағалайтын индекстер пайдаланылады.

Валюта портфелінің стратегиялық бөлінуіне сәйкес активтерді индекстік басқару дамыған елдер облигацияларының субпортфеліне, дамушы елдер облигацияларының субпортфеліне, корпоративтік облигациялардың субпортфеліне және акциялардың субпортфеліне қатысты қолданылады.

Активтерді индекстік басқаруды ҚРҰБ дербес, сондай-ақ шетелдік басқарушы компанияларды тарта отырып жүзеге асырады. ҚРҰБ дамыған елдердің субпортфелін және дамушы елдердің облигациялар субпортфелінің бір бөлігін индекстік басқаруды жүзеге асырады.

#### *Дамыған елдер облигацияларының субпортфелі*

Есептік айда дамыған елдер облигациялары субпортфелінің ағымдағы құны 16,40 млрд.теңгеге ұлғайды және 1 824,10 млрд.теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 8,71%.

Дамыған елдер облигацияларының субпортфелі үшін АҚШ долларына номиналданған 10 жылға дейін өтеу мерзімімен АҚШ мемлекеттік бағалы қағаздарынан тұратын Custom Index (G502) индекс эталон портфель болып табылады. 2024 жылғы 1 қазанға аталған индекстің құрамына облигациялардың 205 шығарылымы кіреді.

#### *Дамушы елдер облигацияларының субпортфелі*

Есептік айда дамушы елдер облигациялары субпортфелінің ағымдағы құны 19,30 млрд.теңгеге ұлғайды және 1 535,14 млрд.теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 7,33%.

Дамушы елдер облигацияларының субпортфелі үшін эмитенттері «ВВ» төмен емес рейтингі бағасы бар дамушы елдер болып табылатын, АҚШ долларына номиналданған облигацияларынан тұратын Custom Index (Q979) индекс эталон портфель болып табылады. 2024 жылғы 1 қазанға аталған индекстің құрамына 29 дамушы елдер шығарған АҚШ долларына номиналданған облигациялардың 416 шығарылымы кіреді.

#### *Корпоративтік облигациялардың субпортфелі*

Есептік айда корпоративтік облигациялары субпортфелінің ағымдағы құны 355,73 млрд.теңгеге ұлғайды және 1 683,63 млрд.теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 8,04%. Есепті кезеңде БЖЗК зейнетақы активтерінің бір бөлігі PIMCO Asia Pte Ltd басқаруына 700,00 млн. АҚШ доллары сомасында берілді.

Корпоративтік облигацияларының субпортфелі үшін эмитенттері «ВВВ» төмен емес рейтингі бағасы және жоғары капитализациямен дамыған және дамушы елдердің резиденттері болып табылатын, АҚШ долларына номиналданған корпоративтік бағалы қағаздардан тұратын Custom Index (Q980) индекс эталон портфель болып табылады. 2024 жылғы 1 қазанға аталған индекстің құрамына 1300 эмитент шығарған облигациялардың 7 405 шығарылымы кіреді.

#### *Акциялардың субпортфелі*

Есептік айда акциялардың субпортфелінің ағымдағы құны 84,25 млрд.теңгеге ұлғайды және 2 014,20 млрд.теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 9,61%. Есепті кезеңде БЖЗК зейнетақы активтерінің бір бөлігі 70,00 млн АҚШ доллары сомасында UBS Asset Management (UK) Ltd басқаруына берілді.

Акциялардың субпортфелі үшін әлемнің дамыған елдері компанияларының акцияларынан тұратын Custom MSCI World Index индекс эталон портфель болып табылады. 2024 жылғы 1 қазанға аталған индекстің құрамына 23 дамыған елдерге жататын жоғары және орташа капитализациясымен компаниялардың 1 366 акциясы кіреді. Индекстің 74,1%

көлеміндегі негізгі үлесін АҚШ компанияларының акциялары иеленеді. Индекске Жапония, Ұлыбритания, Франция, Канада сынды елдердің акциялары және т.б. кіреді.

### Валюталық құрылым

БЖЗҚ зейнетақы активтерінің есебінен сатып алынған қаржы құралдары номиналданған валюталар бөлігінде қаржы құралдарының инвестициялық портфелі 2-кестеде келтірілген.

Есептік кезеңде зейнетақы активтерінің валюталық үлесін 40% деңгейде ұстау мақсатында инвестициялық портфельді түрлендіру үшін Қазақстан қор биржасында 500,00 млн. АҚШ доллары сатып алынды.

#### 2-кесте. Валюталар бөлігінде ҚРҰБ сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфелінің құрылымы

Валюта	01.01.2024 жылға ағымдағы құны	01.01.2024 жылға үлесі	01.10.2024 ж. ағымдағы құны	01.10.2024 ж. үлесі	млрд. теңге Жыл басынан өсуі/төмендеуі
Ұлттық валюта	12 161,38	68,30%	12 735,69	60,79%	4,72%
АҚШ доллары	5 639,89	31,67%	8 213,12	39,20%	45,63%
Басқа валюталар	4,76	0,03%	1,39	0,01%	-70,77%
<b>Жиыны:</b>	<b>17 806,03</b>	<b>100,00%</b>	<b>20 950,20</b>	<b>100,00%</b>	<b>17,66%</b>

### Инвестициялық қызметтің нәтижелері

Инвестициялық қызметтің нәтижесінде, сондай-ақ шетелдік валюталар бағамының құбылмалылығы және қаржы құралдарының нарықтық құнының өзгеруі салдарынан 2024 жылдың басынан бері есептелген инвестициялық кіріс көлемі 2,12 трлн. теңгені құрады.

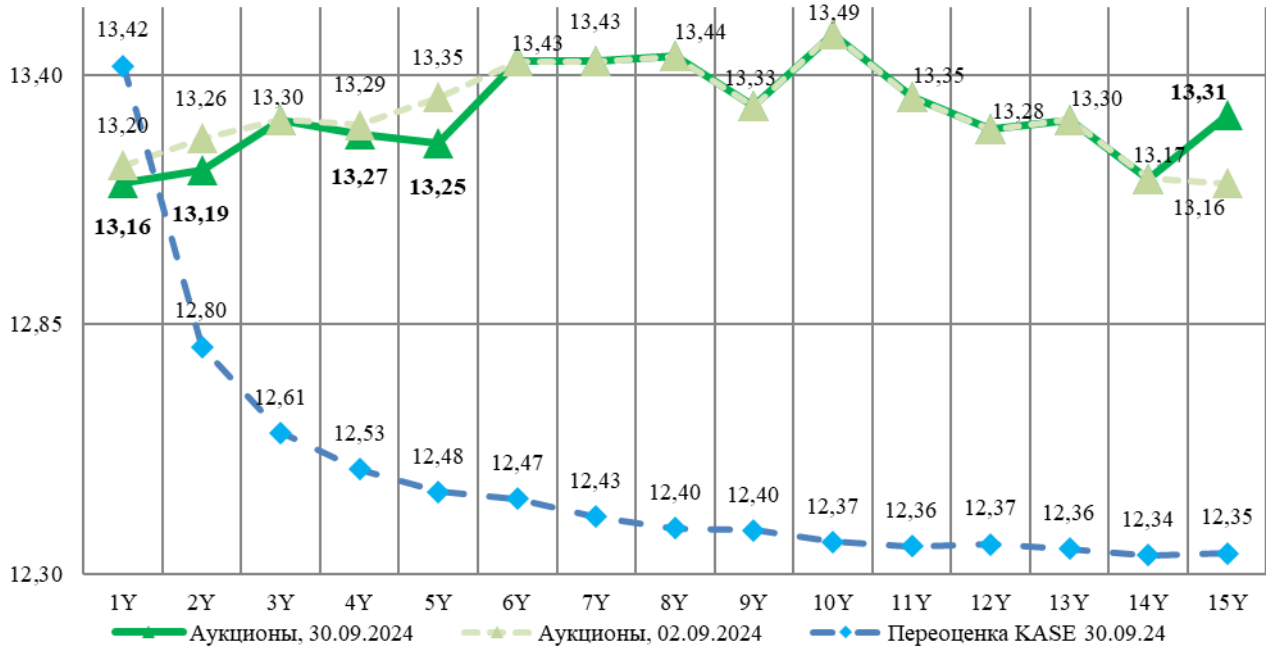
2024 жылғы 1 қазандағы жағдай бойынша салымшылардың (алушылардың) шоттарына бөлінген соңғы 12 ай үшін БЖЗҚ зейнетақы активтерінің кірістілігі инфляция 8,30% болғанда 12,47% құрады. 2024 жылдың басынан бастап салымшылардың (алушылардың) шоттарына бөлінген БЖЗҚ зейнетақы активтерінің кірістілігі 11,22% құрады.

2024 жылғы қыркүйекте ФРЖ-ның кезекті отырысы өтті, отырыста базалық мөлшерлеменің деңгейіне қатысты мәселе шешілді. Еңбек нарығы бойынша деректердің нашарлауы және инфляция деңгейін нысаналы мәнге төмендету жөніндегі прогресс аясында базалық мөлшерлемені 50 базалық тармаққа төмендету туралы шешім қабылданды. Осылайша, базалық мөлшерлеме дәлізі 4,75-5,00% деңгейлерінде орнықты. 2024 жылдың аяғына дейін нарық қатысушылары 25 базалық тармақ бойынша тағы 2 төмендеуді күтуде. Қыркүйек айында АҚШ-та айлық инфляция 0,2% (тамызда 0,2%) болды, бірақ жылдық есептеуде 2,4%-ға (тамызда 2,5%) азайды. Ауылшаруашылық емес секторда қыркүйек айында жұмыс орындары санының өсуі күтілгеннен жоғары болып, 254 мың жұмыс орнын құрап, жұмыссыздық деңгейі 4,2%-дан 4,1%-ға төмендеді.

Нәтижесінде АҚШ-тың эталондық 10 жылдық қазынашылық облигацияларының кірістілігі қыркүйекте 5 базалық тармаққа азайды. Дамушы елдердің облигациялары бойынша спредтер 18 базалық тармаққа тарылды, ал корпоративтік облигациялар бойынша спредтер 4 базалық тармаққа тарылды. Мұнымен бірге, MSCI World акцияларының индексі 1,74%-ға артты.

ҚР МБҚ орналастыру бойынша аукциондарда тамызда ҚРҰБ-тың базалық мөлшерлемені 14,25%-ға дейінде сақтау туралы шешімі аясында қисықтың жақын ұшында кірістіліктің аздап төмендеуі байқалды. Бұл ретте қыркүйекте инфляция жылдық 8,3%-ға (тамызда 8,4%) немесе қыркүйек ішінде 0,4%-ға (тамызда 0,6%) дейін бәсеңдеді. ҚР МБҚ аукциондарында орташа сұраныс ұсыныстан 2,6 ретке асып түсті, бұл ретте негізгі сұраныс қысқа мерзімді МБҚ орналастыруларына шоғырландырылды. Мұнымен бірге ҚР ҚМ қарыз алу көлемінің тамызда 330 млрд.теңгеден қыркүйекте 224 млрд. теңгеге дейін азаюы байқалады.

## ГЦБ РК, ҮТМ (%)



Көрсетілген кезеңге есептелген инвестициялық кіріс құрылымы 3-кестеде көрсетілген.

3-кесте. ҚРҰБ сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА бойынша алынған инвестициялық кіріс құрылымы  
млрд. теңге

Атауы	2024 жыл үшін инвестициялық кіріс
Бағалы қағаздар, орналастырылған салымдар және «кері РЕПО» операциялары бойынша сыйақы түріндегі және бағалы қағаздарды қайта бағалаудан түскен кірістер	1 166,96
Бағалы қағаздарды нарықтық қайта бағалаудан кірістер (шығындар)	98,86
Шетелдік валютаны қайта бағалаудан кірістер (шығындар)	227,98
Сыртқы басқарудағы активтер бойынша кірістер (шығындар)	620,16
Басқа кірістер (шығындар)	2,81
<b>Жиньы:</b>	<b>2 116,77</b>

### Инвестициялық декларация параметрлерін сақтау туралы ақпарат

Сенімгерлік басқарудағы БЖЗҚ ЗА құрылымдық үлестіруі БЖЗҚ Инвестициялық декларациясының<sup>3</sup> талаптарына сәйкес келеді. Валюталық позициялар үлесі рұқсат етілген деңгей шегінде қалады және БЖЗҚ Инвестициялық декларациясының талаптарын бұзбайды. 2024 жылғы 01 қазандағы жағдай бойынша БЖЗҚ ЗА бойынша инвестициялау лимиттерін сақтау туралы мәліметтер 4-кестеде көрсетілген.

4-кесте. БЖЗҚ ЗА бойынша инвестициялау лимиттері

№	Қаржы құралының түрі	Нақты мәні (ЗА жалпы көлемінен пайыздарбен)	Орындалуы (иә/жоқ)
	КЗТ ақшалай қаражаты	0,00%	иә
	Шетелдік валютадағы ақшалай қаражат	0,28%	иә
<b>1</b>	<b>Қазақстандық қаржы құралдары:</b>	<b>57,96%</b>	
1.1	Қазақстан Республикасы Қаржы Министрлігі, Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкі шығарған Қазақстан Республикасының мемлекеттік бағалы қағаздары	42,29%	иә

<sup>3</sup> Қазақстан Республикасы Ұлттық Банк Басқармасының 2023 жылғы 23 қазандағы № 82 қаулысымен бекітілген БЖЗҚ Инвестициялық декларациясы

1.1.1	Қазақстан Республикасының жергілікті атқарушы органдары шығарған Қазақстан Республикасының мемлекеттік бағалы қағаздары	0,00%	иә
1.2	Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкінің депозиттері	0,26%	иә
1.3	Квазимемлекеттік сектор субъектілерінің бағалы қағаздары	10,67%	иә
1.4	«Standard&Poor's» агенттігінің халықаралық шәкілі бойынша «В» төмен емес бағалы қағаздар және/немесе эмитент рейтингі бағасы бар немесе басқа рейтинг агенттіктерінің бірінің осыған ұқсас деңгейінің рейтинг бағасы бар Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банктерінің қаржы құралдары, оның ішінде:	4,44%	иә
1)	реттелген борыштық бағалы қағаздарды қоспағанда, борыштық бағалы қағаздар	4,24%	иә
2)	үлестік бағалы қағаздар	0,07%	иә
3)	депозиттер	0,12%	иә
1.5	«Standard&Poor's» агенттігінің халықаралық шәкілі бойынша «В-» төмен емес бағалы қағаздар және/немесе эмитент рейтингі бағасы бар немесе басқа рейтинг агенттіктерінің бірінің осыған ұқсас деңгейінің рейтингтік бағасы бар Қазақстан Республикасының квазимемлекеттік секторы мен екінші деңгейдегі банктері субъектілерінің борыштық бағалы қағаздарын қоспағанда мемлекеттік емес борыштық бағалы қағаздары	0,00%	иә
1.5.1	Қазақстан Республикасы Үкіметінің кепілдігі және/немесе кепілдемесімен шығарылған мемлекеттік емес борышты бағалы қағаздары	0,00%	иә
1.6	Квазимемлекеттік сектор субъектілерінің және Қазақстан Республикасы Екінші деңгейдегі банктерінің инвестициялау сәтіндегі Қазақстан Республикасы қор биржасының ресми тізімінің "Премиум" санатына кіретін немесе оған ұқсас не нарықтық капиталдандырылуы үш триллион АҚШ долларынан асатын әлемдік қор биржаларында листингі бар үлестік емес үлестік бағалы қағаздарды қоспағанда, мемлекеттік емес үлестік бағалы қағаздар	0,31%	иә
1.7	Қазақстан Республикасы қор биржасының және (немесе) "Астана" халықаралық қаржы орталығының аумағында жұмыс істейтін қор биржасындағы ресми тізіміне енгізілген исламдық қаржыландыру құралдары	0,00%	иә
1.8	«Standard&Poor's» агенттігінің халықаралық шәкілі бойынша «BB-» төмен емес бағалы қағаздар және/немесе эмитент рейтингі бағасы бар немесе басқа рейтинг агенттіктерінің бірінің осыған ұқсас деңгейінің рейтингтік бағасы бар жылжымайтын мүлік (MBS) және активтердің (ABS) кепіліне бағалы қағаздар	0,00%	иә
2	<b>Шетелдік қаржы құралдары, оның ішінде шетелдік қаржы нарықтарында айналымда жүрген құралдар:</b>	<b>37,14%</b>	иә
2.1	«Standard&Poor's» агенттігінің халықаралық шәкілі бойынша «BB-» төмен емес бағалы қағаздар және/немесе эмитент рейтингі бағасы бар немесе басқа рейтинг агенттіктерінің бірінің осыған ұқсас деңгейінің рейтингтік бағасы бар халықаралық қаржы ұйымдарының мемлекеттік, агенттік және бағалы қағаздары	21,40%	иә
2.2.	Мемлекеттік және агенттік бағалы қағаздарға инвестициялау аясындағы муниципалды бағалы қағаздар	0,00%	иә
2.3	«Standard&Poor's» агенттігінің халықаралық шәкілі бойынша «BB-» төмен емес бағалы қағаздар және/немесе эмитент рейтингі бағасы бар немесе басқа рейтинг агенттіктерінің бірінің осыған ұқсас деңгейінің рейтингтік бағасы бар корпоративтік борыштық бағалы қағаздар	6,29%	иә
2.4	«Standard&Poor's» агенттігінің халықаралық шәкілі бойынша «BBB-» төмен емес бағалы қағаздар және/немесе эмитент рейтинг бағасы бар немесе басқа рейтинг агенттіктерінің бірінің осыған ұқсас деңгейінің рейтингтік бағасы бар жылжымайтын мүлік (MBS) және активтері (ABS) кепілдігіне бағалы қағаздар	0,00%	иә
2.5	«Standard&Poor's» агенттігінің халықаралық шәкілі бойынша «BB-» төмен емес бағалы қағаздар және/немесе эмитент рейтинг бағасы бар немесе басқа рейтинг агенттіктерінің бірінің осыған ұқсас деңгейінің рейтингтік бағасы бар корпоративтік бағалы қағаздарға инвестициялау аясында конвертацияланатын бағалы қағаздар	0,00%	иә
2.6	Акциялар, акцияларға депозитарлық қолхаттар	9,41%	иә
2.7	«Standard&Poor's» агенттігінің халықаралық шәкілі бойынша «А-» төмен емес рейтингтік бағасы бар немесе басқа рейтинг агенттіктерінің бірінің осыған ұқсас деңгейінің рейтингтік бағасы бар шетелдік банктердегі депозиттер (салымдар)	0,00%	иә
2.8	«Standard&Poor's» агенттігінің халықаралық шәкілі бойынша «BBB-» төмен емес рейтинг бағасы бар немесе басқа рейтинг агенттіктерінің бірінің осыған ұқсас деңгейінің рейтингтік бағасы бар ұйымдар шығарған құрылымдық өнімдер	0,04%	иә
2.9	«Standard&Poor's» агенттігінің халықаралық шәкілі бойынша «BB-» төмен емес рейтинг бағасы бар немесе басқа рейтинг агенттіктерінің бірінің осыған ұқсас деңгейінің рейтингтік бағасы бар ислам қаржыландыру құралдары	0,53%	иә

№	Қаржы құралының түрі	Нақты мәні (3А жалпы көлемінен пайызбен)	Орындалуы (иә/жоқ)
1	Туынды қаржы құралдары, олардың ішінде:	0,00%	иә
1.1	Инвестициялық тәуекелді хеджирлеу мақсатында пайдаланылатын туынды қаржы құралдары	0,00%	иә
1.2	Инвестициялау мақсатында пайдаланылатын туынды қаржы құралдары	0,00%	иә
1.3	Құймадағы және металл шоттардағы алтын	0,00%	иә

## БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфеліндегі қаржы құралдарды сатып алу, сату және өтеу бойынша ақпарат

### 5-кесте. Есептік айда қаржы құралдарын сатып алу бойынша мәліметтер

Құрал түрі	Валюта	Бағалы қағаз эмитенті	Номинал құны теңгемен
АҚШ МБҚ	USD	АҚШ Үкіметі	311 783 000 000
Облигациялар	KZT	«Bank RBK» Банкі» АҚ	79 945 000 000
<b>Жиыны</b>			<b>391 728 000 000</b>

### 6-кесте. Есептік айда қаржы құралдарын сату бойынша мәліметтер

Құрал түрі	Валюта	Бағалы қағаз эмитенті	Мәміле сомасы теңгемен
АҚШ МБҚ	USD	АҚШ Үкіметі	123 219 672 397
<b>Жиыны</b>			<b>123 219 672 397</b>

### 7-кесте. Есептік айда бағалы қағаздар бойынша негізгі борышты өтеу бойынша мәліметтер

Құрал түрі	Валюта	Бағалы қағаздар эмитенті	Өтеу сомасы теңгемен
АҚШ МБҚ	USD	АҚШ Үкіметі	318 018 990 000
ҚР МБҚ	KZT	ҚР Үкіметі	17 721 815 000
Облигациялар	KZT	«Bank RBK» Банкі» АҚ	24 496 700 000
<b>Жиыны</b>			<b>360 237 505 000</b>

### 8-кесте. Есептік айда салымдар бойынша негізгі борышты өтеу бойынша мәліметтер

Құрал түрі	Валюта	Бағалы қағаздар эмитенті	Өтеу сомасы теңгемен
Салым	KZT	«Қазақстан Халық Банкі» АҚ	55 000 000 000
Салым	KZT	«ForteBank» АҚ	20 000 000 000
Салым	KZT	«Еуразиялық Банк» АҚ	25 000 000 000
Салым	KZT	«First Heartland Jusan Bank» АҚ	20 000 000 000
<b>Жиыны</b>			<b>120 000 000 000</b>