

**«Nalyk Finance» Қазақстан Халық Банкінің ЕҰ» АҚ сенімгерлік
басқаруындағы «БЖЗҚ» АҚ зейнетақы активтерін
инвестициялық басқару бойынша ақпарат**

2024 жылғы 1 қарашадағы жағдай бойынша «Nalyk Finance» Қазақстан Халық Банкінің ЕҰ» АҚ (бұдан әрі – Nalyk Finance) сенімгерлік басқаруындағы «БЖЗҚ» АҚ (бұдан әрі – БЖЗҚ) зейнетақы активтері (бұдан әрі – ЗА) **39 565,36** млн. теңгені құрап отыр.

Nalyk Finance сенімгерлік басқаруындағы зейнетақы активтері есебінен құралған қаржы құралдары портфелінің құрылымы 1-кестеде берілді.

**1-кесте. Қаржы құралдарының бөлігінде Nalyk Finance сенімгерлік басқаруындағы
БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфелінің құрылымы**

млн. теңге

Атауы	01.01.2024 жылға ағымдағы құны	01.01.2024 жылға үлесі	01.11.2024 жылға ағымдағы құны	01.11.2024 жылға үлесі	01.01.2024ж. бастап өсу/төмендеу
ҚР ҚМ МБҚ	501,69	3,65%	10 180,95	25,73%	1 929,33%
ҚР ҰБ ноттары	428,77	3,12%	0,00	0,00%	-100,00%
Шетел мемлекеттерінің МБҚ	835,91	6,08%	2 742,98	6,93%	228,14%
ХҚҰ	19,05	0,14%	388,89	0,98%	1 941,80%
ҚР эмитенттерінің корпоративтік облигациялары	22,93	0,17%	4 274,71	10,80%	18 544,83%
ҚР екінші деңгейдегі банктерінің облигациялары	794,08	5,77%	3 953,54	9,99%	397,88%
ҚР квазимемлекеттік ұйымдарының облигациялары	536,44	3,90%	4 377,42	11,06%	716,02%
Шетелдік эмитенттердің корпоративтік облигациялары	144,59	1,05%	3 362,64	8,50%	2 225,64%
ҚР эмитенттерінің акциялары мен депозитарлық қолхаттары	99,76	0,73%	668,02	1,69%	569,63%
Exchange Traded Funds (ETF) пайлары	1 132,78	8,23%	4 821,89	12,19%	325,67%
Шетелдік эмитенттердің акциялары мен депозитарлық қолхаттары	49,96	0,36%	2 141,56	5,41%	4 186,86%
Шоттардағы ақшалай қаражат	11,15	0,08%	529,24	1,34%	4 648,47%
Басқа активтер (дебиторлық берешек, мерзімі өткен берешек, провизия)	4,69	0,03%	278,67	0,70%	5 842,99%
Кері Репо (90 күнтізбелік күннен артық емес)	9 177,31	66,70%	1 844,84	4,66%	-79,90%
ИПБ басқаруындағы ЗА жиынтығы	13 759,08	100,00%	39 565,36	100,00%	187,56%
Жасалған мәмілелер бойынша төлемге міндеттемелер	0,00	0,00%	0,00	0,00%	
Зейнетақы жарналары мен төлемдері шоттарындағы ақша	0,00	0,00%	0,00	0,00%	
Зейнетақы активтерінің жиынтығы	13 759,08	100,00%	39 565,36	100,00%	187,56%

Дисконттық облигацияларды есептемегенде теңгемен номиналданған борыштық қаржы құралдарын өтеуге орташа алынған кірістілік жылдық 12,58%-ге тең. АҚШ долларымен номиналданған купондық борыштық қаржы құралдарының орташа алынған кірістілігі жылдық 5,07%-ге тең.

Кері Репо операциялары (90 күнтізбелік күннен артық емес)

Есепті айда кері Репо операцияларының ағымдағы құны 1 844,84 млн. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі – 4,66 %.

Есепті күнге кері Репо операцияларның орташа алынған кірістілігі – 13,90 %.

Қазақстан Республикасы Қаржы министрлігінің мемлекеттік бағалы қағаздары

Есепті кезеңде портфель құрамына Қазақстан Республикасы Қаржы министрлігінің мемлекеттік бағалы қағаздары сатып алынған жоқ.

Есепті айда ҚР ҚМ МБҚ ағымдағы құны 10 180,95 млн. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі – 25,73 %.

Есепті күнге ҚР ҚМ МБҚ орташа алынған кірістілік жылына 12,58 % құрады.

Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкінің ноттары

Есепті кезеңде Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкінің (бұдан әрі – ҚР ҰБ) ноттары сатып алынған жоқ. Есепті кезеңде ҚРҰБ ноттары портфельде жоқ.

Шетел мемлекеттерінің мемлекеттік бағалы қағаздары

Есепті кезеңде портфель құрамына 487,48 млн теңге сомасына АҚШ Қаржы министрлігінің мемлекеттік бағалы қағаздары сатып алынды.

Есепті айдың соңында шетел мемлекеттерінің мемлекеттік бағалы қағаздарының ағымдағы құны 2 742,98 млн. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі – 6,93%.

Есепті күнге шетел мемлекеттерінің купондық мемлекеттік бағалы қағаздарын өтеуге орташа алынған кірістілік жылына 4,10% АҚШ долларын құрады.

Есепті күнге шетел мемлекеттерінің дисконттық мемлекеттік бағалы қағаздарын өтеуге орташа алынған кірістілік жылына 5,74% АҚШ долларын құрады.

Халықаралық қаржы ұйымдарының облигациялары

Есепті кезеңде халықаралық қаржы ұйымдарының облигациялары портфель құрамына сатып алынған жоқ.

Есепті айдың соңында халықаралық қаржы ұйымдарының (бұдан әрі – ХҚҰ) облигацияларының ағымдағы құны 388,89 млн.теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі – 0,98 %.

Есепті күнге халықаралық қаржы ұйымдарының дисконттық облигацияларын өтеуге орташа алынған кірістілік теңгемен жылына 25,92 % құрады.

Есепті күнге халықаралық қаржы ұйымдарының купондық облигацияларын өтеуге орташа алынған кірістілік теңгемен жылына 12,83 % құрады.

Қазақстан Республикасы резиденттері-эмитенттердің корпоративтік облигациялары

Есепті кезеңде портфель құрамына жалпы сомасы 1 015,87 теңгеге Қазақстан Республикасы резиденттері-эмитенттердің корпоративтік облигациялары сатып алынды.

Есепті айдың соңында Қазақстан Республикасы резиденттері-эмитенттердің корпоративтік облигацияларының ағымдағы құны 4 274,71 млн.теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі – 10,80 %.

Есепті күнге Қазақстан Республикасы резиденттері-эмитенттердің корпоративтік облигацияларының өтеуге орташа алынған кірістілігі теңгемен жылына 11,69 % құрады.

Есепті күнге Қазақстан Республикасы резиденттері-эмитенттердің корпоративтік облигацияларын өтеуге орташа алынған кірістілік USD-мен жылына 7,50 % құрады.

Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банктерінің облигациялары

Есепті кезеңде портфель құрамына Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банктерінің (бұдан әрі – ҚР ЕДБ) облигациялары сатып алынған жоқ.

Есепті айдың соңында ҚР ЕДБ облигацияларының ағымдағы құны 3 953,54 млн.теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі – 9,99 %.

Есепті күнге ҚР ЕДБ облигацияларын өтеуге орташа алынған кірістілік жылдық 15,14% құрады.

Қазақстан Республикасының квазимемлекеттік ұйымдарының облигациялары

Есепті кезеңде Қазақстан Республикасының квазимемлекеттік ұйымдарының облигациялары сатып алынған жоқ.

Есепті айдың соңында Қазақстан Республикасының квазимемлекеттік ұйымдары облигацияларының ағымдағы құны 4 377,42 млн.теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі–11,06 %.

Есепті күнге Қазақстан Республикасының квазимемлекеттік ұйымдарының облигацияларын өтеуге орташа алынған кірістілік жылына 11,24 % құрады.

Шетелдік эмитенттердің корпоративтік облигациялары

Есепті кезеңде шетелдік эмитенттердің корпоративтік облигациялары сатып алынған жоқ.

Есепті айдың соңында шетелдік эмитенттердің корпоративтік облигацияларының ағымдағы құны 3 362,64 млн теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі –8,50 % .

Есепті күнге шетелдік эмитенттердің корпоративтік облигацияларын өтеуге орташа алынған кірістілік теңгемен жылына 12,24% және АҚШ долларымен жылына 5,53 % құрады.

Қазақстан Республикасы эмитенттерінің акциялары мен депозитарлық қолхаттары

Есепті кезеңде портфель құрамына 11,99 млн теңге сомасына «ҚазМұнайГаз» АҚ жай акциялары сатып алынды.

Есепті айдың соңында Қазақстан Республикасы эмитенттерінің акциялары мен депозитарлық қолхаттарының ағымдағы құны 668,02 млн.теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі –1,69%.

Exchange Traded Funds (ETF) пайлары

Есепті кезеңде портфель құрамына жалпы сомасы 1 016,19 млн.теңгеге SPDR Portfolio S&P 500 Growth ETF (SPYG), iShares Core S&P Mid-Cap ETF (IJH), Vanguard Energy (VDE) пайлары сатып алынды.

Есепті кезеңде портфель құрамынан жалпы сомасы 1 301,30 млн.теңгеге PDR Portfolio S&P 500 Value ETF (SPYV), Global X Uranium ETF (URA), iShares U.S. Utilities ETF (IDU), Vanguard Consumer Staples ETF (VDC), VanEck Gold Miners ETF (GDX) пайлары сатылды.

Есепті айдың соңында ETF ағымдағы құны 4821,89 млн. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі–12,19 %.

Шетелдік эмитенттердің акциялары мен депозитарлық қолхаттары

Есепті кезеңде портфель құрамына жалпы сомасы 1 455,36 млн теңгеге Lam Research Corporation и Merck & Co., Inc. акциялары мен депозитарлық қолхаттары сатып алынды.

Есепті айдың соңында шетелдік эмитенттердің акциялары мен депозитарлық қолхаттарының ағымдағы құны 2 141,56 млн теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі–5,41%.

Валюталық құрылым

Nalyk Finance сенімгерлік басқаруындағы зейнетақы активтерінің есебінен сатып алынған қаржы құралдары номиналданған валюталар бөлігінде қаржы құралдарының инвестициялық портфелі 2-кестеде берілді.

2-кесте. Валюталар бөлігінде Nalyk Finance сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфелінің құрылымы

млн теңге

Валюта	01.01.2024 жылғы ағымдағы құны	01.01.2024 жылға үлесі	01.11.2024 жылға ағымдағы құны	01.11.2024 жылға үлесі	01.01.2024ж. бастап өсу/төмендеу
Ұлттық валюта	11 580,33	84,16%	25 755,92	65,10%	122,41%
Еуро	57,68	0,42%	0,00	0,00%	-100,00%
АҚШ доллары	2 121,07	15,42%	13 809,43	34,90%	551,06%
Жиыны:	13 759,08	100,00%	39 565,36	100,00%	187,56%

Инвестициялық қызмет нәтижесі

Инвестициялық қызмет нәтижесінде 2024 жыл басынан бергі есептелген инвестициялық табыс мөлшері 3 946,37 млн. теңге болды. 2024 жылдың басынан бері зейнетақы активтерінің кірістілігі – 12,28%.

Есептелген инвестициялық табыс құрылымы 3-кестеде берілді.

3-кесте. Nalyk Finance сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА бойынша алған инвестициялық табыс құрылымы

млн теңге

Атауы	2024 жыл басынан бергі инвестициялық табыс
Бағалы қағаздар бойынша, оның ішінде орналастырылған салымдар және «кері РЕПО» операциялары бойынша сыйақы түріндегі табыс	2 735,14
Бағалы қағаздарды нарықтық қайта бағалаудан түскен табыс (шығын)	761,08
Шетелдік валютаны қайта бағалаудан түскен табыс (шығын)	483,22
Басқа активтерді қайта бағалаудан түскен табыс (шығын)	0,00
Басқа табыс (шығын)	-33,07
Жиыны:	3 946,37

Шартты бірлік құны туралы ақпарат

Nalyk Finance сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА шартты зейнетақы бірлігі құнының динамикасы 4-кестеде берілді.

4-кесте. Nalyk Finance сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА бір шартты бірлік құны

№	Күні	Бір шартты бірлік құны
1	01.10.2024	1 369,8522940
2	02.10.2024	1 369,8522940
3	03.10.2024	1 369,8522940
4	04.10.2024	1 369,8522940
5	05.10.2024	1 369,8522940
6	06.10.2024	1 369,8522940
7	07.10.2024	1 375,4080879
8	08.10.2024	1 375,4080879
9	09.10.2024	1 375,4080879
10	10.10.2024	1 375,4080879
11	11.10.2024	1 375,4080879

№	Күні	Бір шартты бірлік құны
12	12.10.2024	1 375,4080879
13	13.10.2024	1 375,4080879
14	14.10.2024	1 376,7619715
15	15.10.2024	1 376,7619715
16	16.10.2024	1 376,7619715
17	17.10.2024	1 376,7619715
18	18.10.2024	1 376,7619715
19	19.10.2024	1 376,7619715
20	20.10.2024	1 376,7619715
21	21.10.2024	1 371,7160374
22	22.10.2024	1 371,7160374
23	23.10.2024	1 371,7160374
24	24.10.2024	1 371,7160374
25	25.10.2024	1 371,7160374
26	26.10.2024	1 371,7160374
27	27.10.2024	1 371,7160374
28	28.10.2024	1 378,0059893
29	29.10.2024	1 378,0059893
30	30.10.2024	1 378,0059893
31	31.10.2024	1 379,1125588

Инвестициялық декларация өлшемдерін сақтау туралы ақпарат

Nalyk Finance сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА құрылымдық бөлу Nalyk Finance сенімгерлік басқаруындағы зейнетақы активтері есебінен құралған қаржы құралдарының портфеліне инвестициялық декларация¹ талаптарына сәйкес. Валюталық позициялар үлесі рұқсат етілген деңгей шегінде қалады және Nalyk Finance сенімгерлік басқаруындағы зейнетақы активтері есебінен құралған қаржы құралдарының портфеліне инвестициялық декларация талаптарын бұзбайды. 2024 жылғы 01 қарашадағы жағдай бойынша Nalyk Finance сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА бойынша инвестициялау шектерін сақтау туралы мәлімет төменде 5-кестеде берілді.

5-кесте. Nalyk Finance сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА бойынша инвестициялау шектері

№	Қаржы құралының атауы	Нақты мәні (сенімгерлік басқарудағы зейнетақы активтері құнынан пайызбен)	Орындалуы (иә/жоқ)
1.	Ұлттық валютадағы ақшалай қаражат – теңге (KZT)	0,58%	иә
2.	Кері РЕПО	4,66%	иә
3.	Қазақстан Республикасының Қаржы министрлігі және Қазақстан Республикасының Ұлттық Банкі шығарған Қазақстан Республикасының мемлекеттік бағалы қағаздары (оның ішінде шетелдік мемлекеттердің заңнамасына сәйкес эмиссияланған), сондай-ақ Қазақстан Республикасының Үкіметінің кепілімен және (немесе) кепілдігімен шығарылған бағалы қағаздар	25,73%	иә
4.	Қазақстан Республикасының жергілікті атқару органдары шығарған борыштық бағалы қағаздар	0,00%	иә

¹ Nalyk Finance сенімгерлік басқаруындағы зейнетақы активтері есебінен құралған қаржы құралдарының портфеліне инвестициялық декларация "Nalyk Finance" АҚ Директорлар кеңесінің шешімімен бекітілді, Директорлар кеңесінің 2022 жылғы 01 қарашадағы №34/22-3 сырттай дауыс беру қорытындысы туралы хаттама

№	Қаржы құралының атауы	Нақты мәні (сенімгерлік басқарудағы зейнетақы активтері құнынан пайызбен)	Орындалуы (иә/жоқ)
5.	Акцияларының жүз пайызы Қазақстан Республикасының Ұлттық Банкіне тиесілі заңды тұлға шығарған борыштық бағалы қағаздар	4,40%	иә
6.	Қазақстан Республикасының және басқа мемлекеттердің заңнамасына сәйкес «Қазақстан Даму банкі», «Самұрық-Қазына» Ұлттық әл-ауқат қоры», «Бәйтерек» Ұлттық басқарушы холдингі», «Проблемалы кредиттер қоры» акционерлік қоғамдары шығарған борыштық бағалы қағаздар	4,28%	иә
7.	Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банктеріндегі салымдар төмендегі талаптардың біріне сәйкес келген кезде: - банктердің Standard & Poor's (Стандарт энд Пурс) агенттігінің халықаралық шәкілі бойынша "BB-" деңгейінен төмен емес ұзақ мерзімді кредит рейтингі немесе Moody's Investors Service (Мудис Инвесторс Сервис) немесе Fitch (Фич) агенттіктерінің ұқсас деңгейдегі рейтинг бағасы немесе Standard & Poor's (Стандарт энд Пурс) ұлттық шәкілі бойынша "kzA-" деңгейінен төмен емес рейтинг бағасы бар; - банктер – Standard & Poor's (Стандарт энд Пурс) агенттігінің халықаралық шәкілі бойынша "A-" деңгейінен төмен емес ұзақ мерзімді кредит рейтингі немесе Moody's Investors Service (Мудис Инвесторс Сервис) немесе Fitch (Фич) агенттіктерінің ұқсас деңгейдегі рейтинг бағасы бар резидент емес банктің еншілес банктері.	0,00%	иә
8.	Standard & Poor's (Стандарт энд Пурс) агенттігінің халықаралық шәкілі бойынша "A-" деңгейінен төмен емес ұзақ мерзімді кредит рейтингі немесе Moody's Investors Service (Мудис Инвесторс Сервис) немесе Fitch (Фич) агенттіктерінің ұқсас деңгейдегі рейтинг бағасы бар резидент емес банктердегі салымдар	0,00%	иә
9.	Standard & Poor's (Стандарт энд Пурс) агенттігінің халықаралық шәкілі бойынша «BB+» деңгейінен төмен емес рейтинг бағасы немесе Moody's Investors Service (Мудис Инвесторс Сервис) немесе Fitch (Фич) агенттіктерінің ұқсас деңгейдегі рейтинг бағасы бар төмендегі халықаралық қаржы ұйымдары шығарған борыштық бағалы қағаздар: – Азиялық даму банкі (the Asian Development Bank); – Америкалық даму банкі (the Inter-American Development Bank); – Африкалық даму банкі (the African Development Bank); – Еуразиялық даму банкі (Eurasian Development Bank); – Еуропалық қайта құру және даму банкі (the European Bank for Reconstruction and Development); – Еуропалық инвестициялық банк (the European Investment Bank); – Еуропалық Кеңестің Даму банкі (the Council of Europe Development Bank); – Ислам жеке секторды дамыту корпорациясы (the Islamic Corporation for the Development of the Private Sector); – Ислам даму банкі (the Islamic Development Bank); – Көпқырлы инвестициялар кепілі агенттігі (the Multilateral Investment Guarantee Agency); – Скандинав инвестициялық банкі (the Nordic Investment Bank); – Халықаралық валюта қоры (the International Monetary Fund); – Халықаралық даму қауымдастығы (the International Development Association); – Халықаралық инвестициялық дауларды реттеу орталығы (the International Centre for Settlement of Investment Disputes); – Халықаралық қайта құру және даму банкі (the International	0,98%	иә

№	Қаржы құралының атауы	Нақты мәні (сенімгерлік басқарудағы зейнетақы активтері құнынан пайызбен)	Орындалуы (иә/жоқ)
	– Bank for Reconstruction and Development); – Халықаралық қаржы корпорациясы (the International Finance Corporation); сондай-ақ жарғылық капиталындағы Қазақстан Республикасының үлесі 25%-дан кем емес халықаралық қаржы ұйымы шығарған бағалы қағаздар.		
10.	Standard & Poor's (Стандарт энд Пурс) агенттігінің халықаралық шәкіл бойынша «BBB-» деңгейінен төмен емес тәуелсіз рейтингі немесе Moody's Investors Service (Мудис Инвесторс Сервис) немесе Fitch (Фич) агенттіктерінің ұқсас деңгейдегі рейтинг бағасы бар шетелдік мемлекеттердің орталық үкіметтері шығарған мемлекеттік мәртебесі бар бағалы қағаздар	6,93%	иә
11.	Шетелдік ұйымдар шығарған мемлекеттік емес бағалы қағаздар:		иә
	1. Standard & Poor's (Стандарт энд Пурс) агенттігінің халықаралық шәкіл бойынша «BB+» деңгейінен төмен емес рейтинг бағасы немесе Moody's Investors Service (Мудис Инвесторс Сервис) немесе Fitch (Фич) агенттіктерінің ұқсас деңгейдегі рейтинг бағасы бар шетелдік эмитенттердің акциялары; 2. негізгі қор индекстері құрамына кіретін шетелдік эмитенттердің акциялары және осы акциялар базалық активі болып табылатын депозитарлық қолхаттар;	5,41%	иә
	3. Standard & Poor's (Стандарт энд Пурс) агенттігінің халықаралық шәкіл бойынша «BB» деңгейінен төмен емес рейтинг бағасы немесе Moody's Investors Service (Мудис Инвесторс Сервис) немесе Fitch (Фич) агенттіктерінің ұқсас деңгейдегі рейтинг бағасы бар борыштық бағалы қағаздар	8,50%	иә
12.	Қазақстан Республикасының және басқа мемлекеттердің заңнамасына сәйкес Қазақстан Республикасының ұйымдары шығарған мемлекеттік емес бағалы қағаздар:	0,00%	иә
	1. қор биржасында инвесторлардың кең ауқымы арасында жария ұсыныс (сату) аясында орналастырылған (орналастырылатын) Қазақстан Республикасының квазимемлекеттік секторы эмитенттерінің акциялары және (немесе) базалық активі осы акциялар болып табылатын депозитарлық қолхаттар; 2. қор биржасының ресми тізіміне енгізілген, қор биржасының ресми тізімінің "Негізгі" алаңының "акциялар" секторының "премиум" санатының талаптарына сәйкес келетін заңды тұлғалардың акциялары және базалық активтері осы акциялар болып табылатын депозитарлық қолхаттар; 3. негізгі қор индекстерінің құрамына кіретін заңды тұлғалардың акциялары;	1,69%	иә
	4. Standard & Poor's (Стандарт энд Пурс) агенттігінің халықаралық шәкіл бойынша «B+» деңгейінен төмен емес рейтинг бағасы немесе Moody's Investors Service (Мудис Инвесторс Сервис) немесе Fitch (Фич) агенттіктерінің ұқсас деңгейдегі рейтинг бағасы немесе Standard & Poor's (Стандарт энд Пурс) ұлттық шәкілі бойынша "kzBBB" деңгейінен төмен емес рейтинг бағасы бар Қазақстан Республикасының және басқа мемлекеттердің заңнамасына сәйкес Қазақстан Республикасының ұйымдары шығарған борыштық бағалы қағаздар; 5. бұрын шығарылған бағалы қағаздарға не осы эмитенттің өзге де міндеттемелеріне айырбас мақсатында эмитенттің міндеттемелерін қайта құрылымдау аясында шығарылған бағалы қағаздар.	23,19%	иә
	Қазақстан Республикасының кәсіпкерлік кодесіне сәйкес шағын немесе орта кәсіпкерлікке жатқызылған субъектілер шығарған, қор	0,00%	иә

№	Қаржы құралының атауы	Нақты мәні (сенімгерлік басқарудағы зейнетақы активтері құнынан пайызбен)	Орындалуы (иә/жоқ)
	биржасының ресми тізімінің «Негізгі» немесе «Балама» алаңының «Борыштық бағалы қағаздар» секторына енгізілген және сомасы осы мемлекеттік емес борыштық бағалы қағаздардың номиналды құнының кемінде 50 (елу) пайызын өтейтін «Даму» кәсіпкерлікті дамыту қоры» акционерлік қоғамының және (немесе) «Қазақстан Даму Банкі» акционерлік қоғамының кепілдігі бар мемлекеттік емес борыштық бағалы қағаздар		
14	Эксчейндж Трэдэд Фандс (Exchange Traded Funds), Эксчейндж Трэдэд Коммодитис (Exchange Traded Commodities), Эксчейндж Трэдэд Ноутс (Exchange Traded Notes) пайлары:		
	1) активтерінің құрылымы негізгі қор индекстерінің бірінің құрылымын қайталайтын немесе олардың пайлар бойынша баға белгілеулері негізгі қор индексіне байланысты болатын Эксчейндж Трэдэд Фандс (Exchange Traded Funds) пайлары 2) Активтерінің құрылымы негізгі қор индекстерінің бірінің құрылымын қайталайтын немесе пайлары бойынша баға белгілеу негізгі қор индекстеріне байланысты Exchange Traded Funds (Эксчейндж Трэдэд Фандс) пайларын қоспағанда, Morningstar (Морнингстар) рейтингтік агенттігінің "3 жұлдызынан" төмен емес рейтинг бағасы бар Exchange Traded Funds (Эксчейндж Трэдэд Фандс), Exchange, Traded Commodities (Эксчейндж Трэдэд Коммодитис), Exchange Traded Notes (Эксчейндж Трэдэд Ноутс) пайлары	12,19%	
15.	Қор биржасының ресми тізімінің «Аралас» алаңының «инвестициялық қорлардың бағалы қағаздары» секторының талаптарына сай қор биржасының ресми тізіміне қосылған Қазақстан Республикасының заңнамасына сәйкес құрылған заңды тұлға басқарушы компаниясы болып табылатын интервал пайлық инвестициялық қорлардың пайлары	0,00%	иә
16.	Standard & Poor's (Стандард энд Пурс) агенттігінің халықаралық шәкіл бойынша «BBB» деңгейінен төмен емес тәуелсіздік рейтингі немесе Moody's Investors Service (Мудис Инвесторс Сервис) немесе Fitch (Фич) агенттіктерінің ұқсас деңгейдегі рейтинг бағасы бар елдердің шетелдік валютасы	1,46%	иә
17.	Лондон асыл металдар нарығы қауымдастығы (London bullion market association) қабылдаған және осы қауымдастықтың құжаттарында "Лондон сапалы жеткізілімі" ("London good delivery") стандарты ретінде белгіленген халықаралық сапа стандарттарына сай аффинирленген асыл металдар және металл депозиттер, оның ішінде он екі айдан аспайтын мерзімге Standard & Poor's (Стандард энд Пурс) агенттігінің «AA» деңгейінен төмен емес рейтинг бағасы немесе Moody's Investors Service (Мудис Инвесторс Сервис) немесе Fitch (Фич) агенттіктерінің ұқсас деңгейдегі рейтинг бағасы бар Қазақстан Республикасының резиденті емес банктеріндегі металл депозиттер	0,00%	иә
18.	Базалық активі осы қосымшаға сәйкес зейнетақы активтері есебінен сатып алу рұқсат етілген қаржы құралдары болып табылатын хеджирлеу мақсатында жасалған төмендегі туынды қаржы құралдары: опциондар – сатып алушыға көрсетілген активті белгілі бір бағамен немесе белгілі бір күнге дейін сатып алу немесе сату міндеттемесін емес, құқығын беретін келісімшарт; фьючерстер – болашақта жасалатын сатып алу-сату мәмілесіне қатысты құқықтар мен міндеттерді өзара беруге байланысты келісімшарт;	0,00%	иә

№	Қаржы құралының атауы	Нақты мәні (сенімгерлік басқарудағы зейнетақы активтері құнынан пайызбен)	Орындалуы (иә/жоқ)
	<p>форвардтар – бір тарап белгілі бір мерзімде келісімшарттың мәнін беруге, ал екінші Тарап оны көрсетілген күн бойынша көрсетілген уақытта және көрсетілген жерде қабылдауға міндеттенетін шарт;</p> <p>своптар – болашақта келісімшартта белгіленген талаптарға сәйкес төлемдерді айырбастау туралы екі контрагент арасындағы келісім; жоғарыда аталған туынды қаржы құралдарының жиынтығын білдіретін туынды қаржы құралдары.</p>		

Налык Finance сенімгерлік басқаруындағы зейнетақы активтері есебінен құралған қаржы құралдарының портфеліндегі қаржы құралдарын сатып алу, сату және өтеу бойынша ақпарат

6-кесте. Есепті айдағы қаржы құралдарын сатып алу бойынша мәлімет

Құрал түрі	Валюта	Бағалы қағаз эмитенті	Теңгемен мәміле сомасы
Шетелдік эмитенттердің акциялары мен депозитарлық қолхаттары	USD	Lam Research Corporation	969 708 477,19
ҚР эмитенттерінің корпоративтік облигациялары	KZT	"BI Development LTD" ЖК	796 736 000,00
Exchange Traded Funds (ETF) пайлары	USD	SPDR Portfolio S&P 500 Growth ETF (SPYG)	540 193 076,61
Шетел мемлекеттерінің МБҚ	USD	АҚШ Қаржы министрлігі	487 484 094,14
Шетелдік эмитенттердің акциялары мен депозитарлық қолхаттары	USD	Merck & Co., Inc.	485 650 561,70
PEXchange Traded Funds (ETF) пайлары	USD	iShares Core S&P Mid-Cap ETF (IJH)	388 251 257,30
ҚР эмитенттерінің корпоративтік облигациялары	USD	"BI Development LTD" ЖК	219 131 088,00
Exchange Traded Funds (ETF) пайлары	USD	Vanguard Energy (VDE)	87 742 487,25
ҚР эмитенттерінің акциялары мен депозитарлық қолхаттары	KZT	"ҚазМұнайГаз" АҚ	11 990 655,00
Жиыны			3 986 887 697,19

7-кесте. Есепті айдағы қаржы құралдарын сату бойынша мәлімет

Құрал түрі	Валюта	Бағалы қағаз эмитенті	Теңгемен мәміле сомасы
Exchange Traded Funds (ETF) пайлары	USD	SPDR® Portfolio S&P 500® Value ETF (SPYV)	542 565 180,00
Шетелдік мемлекеттердің МБҚ	USD	АҚШ Қаржы министрлігі	489 689 244,16
Exchange Traded Funds (ETF) пайлары	USD	Global X Uranium ETF (URA)	422 928 363,27
Exchange Traded Funds (ETF) пайлары	USD	iShares U.S. Utilities ETF (IDU)	133 104 419,25
Exchange Traded Funds (ETF) пайлары	USD	Vanguard Consumer Staples ETF (VDC)	121 075 745,80

Exchange Traded Funds (ETF) пайлары	USD	VanEck Gold Miners ETF (GDX)	81 623 743,80
Жиыны			1 790 986 696,28

8-кесте. Есепті айдағы бағалы қағаздар бойынша негізгі борышты өтеу бойынша мәлімет

Құрал түрі	Валюта	Бағалы қағаз эмитенті	Теңгемен мәміле сомасы
Есепті айда бағалы қағаздар бойынша өтеу болған жоқ			
Жиыны			

9-кесте. Есепті айдағы шетелдік банктердегі салымдарға орналастыру бойынша мәлімет

Құрал түрі	Валюта	Бағалы қағаз эмитенті	Теңгемен мәміле сомасы
Есепті айда шетелдік банктердегі салымдарға орналастыру болған жоқ			
Жиыны			

10-кесте. Есепті айдағы салымдар бойынша негізгі борышты өтеу бойынша мәлімет

Құрал түрі	Валюта	Бағалы қағаз эмитенті	Теңгемен мәміле сомасы
Есепті айда салымдар бойынша негізгі борышты өтеу болған жоқ			
Жиыны			

пенсионными активами АО «ЕНПФ», находящимися в доверительном управлении АО «ДО Народного Банка Казахстана «Halyk Finance»

По состоянию на 1 ноября 2024 года пенсионные активы (далее – ПА) АО «ЕНПФ» (далее – ЕНПФ), находящиеся в доверительном управлении АО «ДО Народного Банка Казахстана «Halyk Finance» (далее – Halyk Finance), составили **39 565,36** млн. тенге.

Структура портфеля финансовых инструментов, сформированного за счет пенсионных активов, находящихся в доверительном управлении Halyk Finance представлена в Таблице 1.

Таблица 1. Структура инвестиционного портфеля ПА ЕНПФ, находящихся в доверительном управлении Halyk Finance, в разрезе финансовых инструментов

млн тенге

Наименование	Текущая стоимость на 01.01.2024г.	Доля на 01.01.2024г.	Текущая стоимость на 01.11.2024г.	Доля на 01.11.2024г.	Прирост/снижение с 01.01.2024г.
ГЦБ МФ РК	501,69	3,65%	10 180,95	25,73%	1 929,33%
Ноты НБРК	428,77	3,12%	0,00	0,00%	-100,00%
ГЦБ иностранных государств	835,91	6,08%	2 742,98	6,93%	228,14%
МФО	19,05	0,14%	388,89	0,98%	1 941,80%
Корпоративные облигации эмитентов РК	22,93	0,17%	4 274,71	10,80%	18 544,83%
Облигации банков второго уровня РК	794,08	5,77%	3 953,54	9,99%	397,88%
Облигации квазигосударственных организаций РК	536,44	3,90%	4 377,42	11,06%	716,02%
Корпоративные облигации иностранных эмитентов	144,59	1,05%	3 362,64	8,50%	2 225,64%
Акции и депозитарные расписки эмитентов РК	99,76	0,73%	668,02	1,69%	569,63%
Паи Exchange Traded Funds (ETF)	1 132,78	8,23%	4 821,89	12,19%	325,67%
Акции и депозитарные расписки иностранных эмитентов	49,96	0,36%	2 141,56	5,41%	4 186,86%
Денежные средства на счетах	11,15	0,08%	529,24	1,34%	4 648,47%
Прочие активы (дебиторская задолженность, просроченная задолженность, провизии)	4,69	0,03%	278,67	0,70%	5 842,99%
Обратное РЕПО (не более 90 календарных дней)	9 177,31	66,70%	1 844,84	4,66%	-79,90%
Итого ПА, находящиеся в управлении УИП	13 759,08	100,00%	39 565,36	100,00%	187,56%
Обязательства к оплате по совершенным сделкам	0,00	0,00%	0,00	0,00%	
Деньги на счетах пенсионных взносов и выплат	0,00	0,00%	0,00	0,00%	
Итого пенсионные активы	13 759,08	100,00%	39 565,36	100,00%	187,56%

Средневзвешенная доходность к погашению долговых финансовых инструментов, номинированных в тенге, без учета дисконтных облигаций, равна 12,58% годовых. Средневзвешенная доходность купонных долговых финансовых инструментов, номинированных в долларах США, равна 5,07% годовых.

Операции обратного РЕПО (не более 90 календарных дней)

Текущая стоимость операций обратного РЕПО за отчетный месяц составила 1 844,84 млн тенге. Их доля в портфеле составила 4,66%.

Средневзвешенная доходность операций обратного РЕПО на отчетную дату составила 13,90% годовых.

Государственные ценные бумаги Министерства финансов Республики Казахстан

В отчетном периоде в состав портфеля государственные ценные бумаги Министерства финансов Республики Казахстан не приобретались.

Текущая стоимость ГЦБ МФ РК за отчетный месяц составила 10 180,95 млн тенге. Их доля в портфеле составила 25,73%.

Средневзвешенная доходность ГЦБ МФ РК на отчетную дату составила 12,58% годовых.

Ноты Национального Банка Республики Казахстан

В отчетном периоде ноты Национального Банка Республики Казахстан (далее – НБРК), в состав портфеля не приобретались. Ноты НБРК на отчетную дату в портфеле отсутствуют.

Государственные ценные бумаги иностранных государств

В отчетном периоде в состав портфеля были приобретены государственные ценные бумаги Министерства финансов США на сумму 487,48 млн тенге.

Текущая стоимость государственных ценных бумаг иностранных государств на конец отчетного месяца составила 2 742,98 млн тенге. Их доля в портфеле составила 6,93%.

Средневзвешенная доходность к погашению купонных государственных ценных бумаг иностранных государств на отчетную дату составила 4,10% годовых в долларах США.

Средневзвешенная доходность к погашению дисконтных государственных ценных бумаг иностранных государств на отчетную дату составила 5,74% годовых в долларах США.

Облигации международных финансовых организаций

В отчетном периоде облигации международных финансовых организаций в состав портфеля не приобретались.

Текущая стоимость облигаций международных финансовых организаций (далее – МФО) на конец отчетного месяца составила 388,89 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 0,98%.

Средневзвешенная доходность к погашению дисконтных облигаций международных финансовых организаций на отчетную дату составила 25,92% годовых в тенге.

Средневзвешенная доходность к погашению купонных облигаций международных финансовых организаций на отчетную дату составила 12,83% годовых в тенге.

Корпоративные облигации эмитентов-резидентов Республики Казахстан

В отчетном периоде в состав портфеля были приобретены облигации эмитентов-резидентов Республики Казахстан на общую сумму 1 015,87 млн тенге.

Текущая стоимость корпоративных облигаций эмитентов-резидентов Республики Казахстан на конец отчетного месяца составила 4 274,71 млн тенге. Их доля в портфеле составила 10,80%.

Средневзвешенная доходность к погашению корпоративных облигаций эмитентов-резидентов Республики Казахстан на отчетную дату составила 11,69% годовых в тенге.

Средневзвешенная доходность к погашению корпоративных облигаций эмитентов-резидентов Республики Казахстан на отчетную дату составила 7,50% годовых в USD.

Облигации банков второго уровня Республики Казахстан

В отчетном периоде в состав портфеля облигации банков второго уровня Республики Казахстан (далее – БВУ РК) не приобретались.

Текущая стоимость облигаций БВУ РК на конец отчетного месяца составила 3 953,54 млн тенге. Их доля в портфеле составила 9,99%.

Средневзвешенная доходность к погашению облигаций БВУ РК на отчетную дату составила 15,14% годовых.

Облигации квазигосударственных организаций Республики Казахстан

В отчетном периоде облигации квазигосударственных организаций Республики Казахстан не приобретались.

Текущая стоимость облигаций квазигосударственных организаций Республики Казахстан на конец отчетного месяца составила 4 377,42 млн тенге. Их доля в портфеле составила 11,06%.

Средневзвешенная доходность к погашению облигаций квазигосударственных организаций Республики Казахстан на отчетную дату составила 11,24% годовых.

Корпоративные облигации иностранных эмитентов

В отчетном периоде корпоративные облигации иностранных эмитентов не приобретались.

Текущая стоимость корпоративных облигаций иностранных эмитентов на конец отчетного месяца составила 3 362,64 млн тенге. Их доля в портфеле составила 8,50%.

Средневзвешенная доходность к погашению корпоративных облигаций иностранных эмитентов на отчетную дату составила 12,23% годовых в тенге и 5,53% годовых в долларах США.

Акции и депозитарные расписки эмитентов Республики Казахстан

В отчетном периоде в состав портфеля были приобретены простые акции АО «КазМунайГаз» на сумму 11,99 млн тенге.

Текущая стоимость акций и депозитарных расписок эмитентов Республики Казахстан на конец отчетного месяца составила 668,02 млн тенге. Их доля в портфеле составила 1,69%.

Паи Exchange Traded Funds (ETF)

В отчетном периоде в состав портфеля были приобретены паи SPDR Portfolio S&P 500 Growth ETF (SPYG), iShares Core S&P Mid-Cap ETF (IJH), Vanguard Energy (VDE) на общую сумму 1 016,19 млн тенге.

В отчетном периоде из состава портфеля были проданы паи SPDR Portfolio S&P 500 Value ETF (SPYV), Global X Uranium ETF (URA), iShares U.S. Utilities ETF (IDU), Vanguard Consumer Staples ETF (VDC), VanEck Gold Miners ETF (GDX) на общую сумму 1 301,30 млн тенге.

Текущая стоимость ETF на конец отчетного месяца составила 4821,89 млн тенге. Их доля в портфеле составила 12,19%.

Акции и депозитарные расписки иностранных эмитентов

В отчетном периоде в состав портфеля были приобретены акции и депозитарные расписки Lam Research Corporation и Merck & Co., Inc. на общую сумму 1 455,36 млн тенге

Текущая стоимость акций и депозитарных расписок иностранных эмитентов на конец отчетного месяца составила 2 141,56 млн тенге. Их доля в портфеле составила 5,41%.

Валютная структура

Инвестиционный портфель финансовых инструментов в разрезе валют, в которых номинированы финансовые инструменты, приобретенные за счет пенсионных активов, находящихся в доверительном управлении Halyk Finance представлен в Таблице 2.

Таблица 2. Структура инвестиционного портфеля ПА ЕНПФ, находящихся в доверительном управлении Halyk Finance, в разрезе валют

млн тенге

Валюта	Текущая стоимость на 01.01.2024 г.	Доля на 01.01.2024 г.	Текущая стоимость на 01.11.2024г.	Доля на 01.11.2024г.	Прирост/ снижение с 01.01.2024 г.
Национальная валюта	11 580,33	84,16%	25 755,92	65,10%	122,41%
Евро	57,68	0,42%	0,00	0,00%	-100,00%
Доллар США	2 121,07	15,42%	13 809,43	34,90%	551,06%
Итого:	13 759,08	100,00%	39 565,36	100,00%	187,56%

Результаты инвестиционной деятельности

В результате инвестиционной деятельности, размер начисленного инвестиционного дохода с начала 2024 года составил 3 946,37 млн тенге. Доходность пенсионных активов с начала 2024 года составила 12,28%.

Структура начисленного инвестиционного дохода представлена в Таблице 3.

Таблица 3. Структура инвестиционного дохода, полученного по ПА ЕНПФ, находящихся в доверительном управлении Halyk Finance

млн тенге

Наименование	Инвестиционный доход с начала 2024 года
Доходы в виде вознаграждения по ценным бумагам, в том числе по размещенным вкладам и операциям «обратное РЕПО»	2 735,14
Доходы (убытки) от рыночной переоценки ценных бумаг	761,08
Доходы (убытки) от переоценки иностранной валюты	483,22
Доходы (убытки) от переоценки прочих активов	0,00
Прочие доходы (убытки)	-33,07
Итого:	3 946,37

Информация о стоимости условной единицы

Динамика стоимости условной пенсионной единицы ПА ЕНПФ, находящихся в доверительном управлении Halyk Finance представлена в Таблице 4.

Таблица 4. Стоимость одной условной единицы ПА ЕНПФ, находящихся в доверительном управлении Halyk Finance

№	Дата	Стоимость одной условной единицы
1	01.10.2024	1 369,8522940
2	02.10.2024	1 369,8522940
3	03.10.2024	1 369,8522940
4	04.10.2024	1 369,8522940
5	05.10.2024	1 369,8522940
6	06.10.2024	1 369,8522940
7	07.10.2024	1 375,4080879
8	08.10.2024	1 375,4080879
9	09.10.2024	1 375,4080879
10	10.10.2024	1 375,4080879
11	11.10.2024	1 375,4080879
12	12.10.2024	1 375,4080879
13	13.10.2024	1 375,4080879
14	14.10.2024	1 376,7619715

№	Дата	Стоимость одной условной единицы
15	15.10.2024	1 376,7619715
16	16.10.2024	1 376,7619715
17	17.10.2024	1 376,7619715
18	18.10.2024	1 376,7619715
19	19.10.2024	1 376,7619715
20	20.10.2024	1 376,7619715
21	21.10.2024	1 371,7160374
22	22.10.2024	1 371,7160374
23	23.10.2024	1 371,7160374
24	24.10.2024	1 371,7160374
25	25.10.2024	1 371,7160374
26	26.10.2024	1 371,7160374
27	27.10.2024	1 371,7160374
28	28.10.2024	1 378,0059893
29	29.10.2024	1 378,0059893
30	30.10.2024	1 378,0059893
31	31.10.2024	1 379,1125588

Информация о соблюдении параметров инвестиционной декларации

Структурное распределение ПА ЕНПФ, находящихся в доверительном управлении, соответствует требованиям Инвестиционной декларации на портфель финансовых инструментов, сформированный за счет пенсионных активов, находящихся в доверительном управлении Haluk Finance². Доли валютных позиций остаются в рамках допустимого уровня и не нарушают требований Инвестиционной декларации на портфель финансовых инструментов, сформированный за счет пенсионных активов, находящихся в доверительном управлении Haluk Finance. Сведения о соблюдении лимитов инвестирования по состоянию на 01 ноября 2024 года представлены в Таблице 5 ниже.

Таблица 5. Лимиты инвестирования по ПА ЕНПФ, находящихся в доверительном управлении Haluk Finance

№	Наименование финансового инструмента	Фактическое значение (в процентах от стоимости пенсионных активов, находящихся в доверительном управлении)	Выполнение (да/нет)
1.	Денежные средства в национальной валюте – тенге (KZT)	0,58%	да
2.	Обратное РЕПО	4,66%	да
3.	Государственные ценные бумаги Республики Казахстан (в том числе, эмитированные в соответствии с законодательством иностранных государств), выпущенные Министерством финансов Республики Казахстан и Национальным Банком Республики Казахстан, а также ценные бумаги, выпущенные под гарантию и (или) поручительство Правительства Республики Казахстан	25,73%	да
4.	Долговые ценные бумаги, выпущенные местными исполнительными органами Республики Казахстан	0,00%	да
5.	Долговые ценные бумаги, выпущенные юридическим лицом, сто процентов акций которого принадлежат Национальному Банку Республики Казахстан	4,40%	да
6.	Долговые ценные бумаги, выпущенные акционерными обществами «Банк Развития Казахстана», «Фонд национального	4,28%	да

² Инвестиционная декларация на портфель финансовых инструментов, сформированный за счет пенсионных активов, находящихся в доверительном управлении Haluk Finance утверждена решением Совета директоров АО «Haluk Finance» Протокол об итогах заочного голосования Совета директоров от 01 ноября 2022 года №34/22-3

№	Наименование финансового инструмента	Фактическое значение (в процентах от стоимости пенсионных активов, находящихся в доверительном управлении)	Выполнение (да/нет)
	благосостояния «Самрук-Казына», «Национальный управляющий холдинг «Байтерек», «Фонд проблемных кредитов» в соответствии с законодательством Республики Казахстан и других государств		
7.	Вклады в банках второго уровня Республики Казахстан, при соответствии одному из следующих условий: - банки имеют долгосрочный кредитный рейтинг не ниже «BB-» по международной шкале агентства Standard & Poor's (Стандарт энд Пурс) или рейтинговую оценку аналогичного уровня агентств Moody's Investors Service (Мудис Инвесторс Сервис) или Fitch (Фич), или рейтинговую оценку не ниже «kzA-» по национальной шкале Standard & Poor's (Стандарт энд Пурс); - банки являются дочерними банками-резидентами, родительский банк-нерезидент которых имеет долгосрочный кредитный рейтинг по международной шкале агентства Standard & Poor's (Стандарт энд Пурс) не ниже «A-» или рейтинговую оценку аналогичного уровня агентств Moody's Investors Service (Мудис Инвесторс Сервис) или Fitch (Фич).	0,00%	да
8.	Вклады в банках-нерезидентах, имеющих долгосрочный рейтинг не ниже «A-» по международной шкале агентства Standard & Poor's (Стандарт энд Пурс) или рейтинговую оценку аналогичного уровня агентств Moody's Investors Service (Мудис Инвесторс Сервис) или Fitch (Фич)	0,00%	да
9.	Долговые ценные бумаги, выпущенные следующими международными финансовыми организациями, имеющие рейтинговую оценку не ниже «BB+» по международной шкале агентства Standard & Poor's (Стандарт энд Пурс) или рейтинговую оценку аналогичного уровня агентств Moody's Investors Service (Мудис Инвесторс Сервис) или Fitch (Фич): - Азиатский банк развития (the Asian Development Bank); - Межамериканский банк развития (the Inter-American Development Bank); - Африканский банк развития (the African Development Bank); - Европейский банк реконструкции и развития (the European Bank for Reconstruction and Development); - Европейский инвестиционный банк (the European Investment Bank); - Банк Развития Европейского Совета (the Council of Europe Development Bank); - Исламская корпорация по развитию частного сектора (the Islamic Corporation for the Development of the Private Sector); - Исламский банк развития (the Islamic Development Bank); - Многостороннее агентство гарантии инвестиций (the Multilateral Investment Guarantee Agency); - Скандинавский инвестиционный банк (the Nordic Investment Bank); - Международный валютный фонд (the International Monetary Fund); - Международная ассоциация развития (the International Development Association); - Международный центр по урегулированию инвестиционных споров (the International Centre for Settlement of Investment Disputes);	0,98%	да

№	Наименование финансового инструмента	Фактическое значение (в процентах от стоимости пенсионных активов, находящихся в доверительном управлении)	Выполнение (да/нет)
	<p>- Международный банк реконструкции и развития (the International Bank for Reconstruction and Development);</p> <p>- Международная финансовая корпорация (the International Finance Corporation);</p> <p>а также ценные бумаги, выпущенные международной финансовой организацией, доля Республики Казахстан в уставном капитале которой составляет не менее 25%.</p>		
10.	<p>Ценные бумаги, имеющие статус государственных, выпущенные центральными правительствами иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг не ниже «BBB-» по международной шкале агентства Standard & Poor's (Стандарт энд Пурс) или рейтинговую оценку аналогичного уровня агентств Moody's Investors Service (Мудис Инвесторс Сервис) или Fitch (Фич)</p>	6,93%	да
11.	<p>Негосударственные ценные бумаги, выпущенные иностранными организациями:</p>		да
11.	<p>1. акции иностранных эмитентов, имеющих рейтинговую оценку не ниже «BB+» по международной шкале агентства Standard & Poor's (Стандарт энд Пурс) или рейтинговую оценку аналогичного уровня агентств Moody's Investors Service (Мудис Инвесторс Сервис) или Fitch (Фич);</p> <p>2. акции иностранных эмитентов, входящие в состав основных фондовых индексов, и депозитарные расписки, базовым активом которых являются данные акции;</p>	5,41%	да
11.	<p>3. долговые ценные бумаги, имеющие рейтинговую оценку не ниже «BB» по международной шкале агентства Standard & Poor's (Стандарт энд Пурс) или рейтинговую оценку аналогичного уровня агентств Moody's Investors Service (Мудис Инвесторс Сервис) или Fitch (Фич)</p>	8,50%	да
12.	<p>Негосударственные ценные бумаги, выпущенные организациями Республики Казахстан в соответствии с законодательством Республики Казахстан и других государств:</p>	0,00%	да
12.	<p>1. акции эмитентов квазигосударственного сектора Республики Казахстан, размещенные (размещаемые) в рамках публичного предложения (продажи) среди широкого круга инвесторов на фондовой бирже, и (или) депозитарные расписки, базовым активом которых являются данные акции;</p> <p>2. акции юридических лиц, включенные в официальный список фондовой биржи, соответствующие требованиям категории «премиум» сектора «акции» площадки «Основная» официального списка фондовой биржи и депозитарные расписки, базовым активом которых являются данные акции;</p> <p>3. акции юридических лиц, входящие в состав основных фондовых индексов;</p>	1,69%	да
12.	<p>4. долговые ценные бумаги, выпущенные организациями Республики Казахстан в соответствии с законодательством Республики Казахстан и других государств, имеющими рейтинговую оценку не ниже "B+" по международной шкале агентства Standard&Poor's (Стандарт энд Пурс) или рейтинговую оценку аналогичного уровня агентств Moody's Investors Service (Мудис Инвесторс Сервис) или Fitch (Фич), или рейтинговую оценку не ниже "kzBBB" по национальной шкале Standard & Poor's (Стандарт энд Пурс);</p>	23,19%	да

№	Наименование финансового инструмента	Фактическое значение (в процентах от стоимости пенсионных активов, находящихся в доверительном управлении)	Выполнение (да/нет)
	5. ценные бумаги, выпущенные в рамках реструктуризации обязательств эмитента в целях обмена на ранее выпущенные ценные бумаги либо иные обязательства данного эмитента.		
13.	Негосударственные долговые ценные бумаги, выпущенные субъектами, отнесенными к малому или среднему предпринимательству согласно Предпринимательскому кодексу Республики Казахстан, включенные в сектор "долговые ценные бумаги" площадки "Основная" либо "Альтернативная" официального списка фондовой биржи, и имеющие гарантию акционерного общества "Фонд развития предпринимательства "ДАМУ" и (или) акционерного общества "Банк Развития Казахстана", сумма которой покрывает не менее 50 (пятидесяти) процентов номинальной стоимости данных негосударственных долговых ценных бумаг	0,00%	да
14.	Паи Exchange Traded Funds (Эксчейндж Трэйдэд Фандс), Exchange Traded Commodities (Эксчейндж Трэйдэд Коммодитис), Exchange Traded Notes (Эксчейндж Трэйдэд Ноутс):		
	1) Паи Exchange Traded Funds (Эксчейндж Трэйдэд Фандс), структура активов которых повторяет структуру одного из основных фондовых индексов, или ценообразование по паям которых привязано к основным фондовым индексам; 2) Паи Exchange Traded Funds (Эксчейндж Трэйдэд Фандс), Exchange Traded Commodities (Эксчейндж Трэйдэд Коммодитис), Exchange Traded Notes (Эксчейндж Трэйдэд Ноутс), имеющие рейтинговую оценку не ниже "3 звезды" рейтингового агентства Morningstar (Морнингстар), за исключением Паев Exchange Traded Funds (Эксчейндж Трэйдэд Фандс), структура активов которых повторяет структуру одного из основных фондовых индексов, или ценообразование по паям которых привязано к основным фондовым индексам	12,19%	да
15.	Паи интервальных паевых инвестиционных фондов, управляющая компания которых является юридическим лицом, созданным в соответствии с законодательством Республики Казахстан, включенные в официальный список фондовой биржи, соответствующие требованиям сектора «ценные бумаги инвестиционных фондов» площадки «Смешанная» официального списка фондовой биржи	0,00%	да
16.	Иностранная валюта стран, имеющих суверенный рейтинг не ниже «BBB» по международной шкале агентства Standard & Poor's (Стандарт энд Пурс) или рейтинговую оценку аналогичного уровня агентств Moody's Investors Service (Мудис Инвесторс Сервис) или Fitch (Фич)	1,46%	да
17.	Аффинированные драгоценные металлы, соответствующие международным стандартам качества, принятым Лондонской ассоциацией рынка драгоценных металлов (London bullion market association) и обозначенным в документах данной ассоциации как стандарт «Лондонская качественная поставка» («London good delivery»), и металлические депозиты, в том числе в банках-нерезидентах Республики Казахстан, обладающих рейтинговой оценкой не ниже «AA» агентства Standard & Poor's (Стандарт энд Пурс) или рейтинговую оценку аналогичного уровня агентств	0,00%	да

№	Наименование финансового инструмента	Фактическое значение (в процентах от стоимости пенсионных активов, находящихся в доверительном управлении)	Выполнение (да/нет)
	Moody's Investors Service (Мудис Инвесторс Сервис) или Fitch (Фич), на срок не более двенадцати месяцев		
18.	<p>Следующие производные финансовые инструменты, заключенные в целях хеджирования, базовым активом которых являются финансовые инструменты, разрешенные к приобретению за счет пенсионных активов в соответствии с настоящим приложением:</p> <p>опционы – контракт, дающий покупателю право, но не обязательство, купить или продать указанный актив по определенной цене или до определенной даты;</p> <p>фьючерсы – контракт, связанный с взаимной передачей прав и обязанностей в отношении сделки купли-продажи, которая будет совершена в будущем;</p> <p>форварды – договор, по которому одна сторона в определенные сроки обязуется передать предмет контракта, а другая сторона принять его по указанной стоимости, в указанное время и указанном месте;</p> <p>свопы – соглашение между двумя контрагентами об обмене в будущем платежами в соответствии с определенными в контракте условиями;</p> <p>производные финансовые инструменты, представляющие собой комбинацию вышеперечисленных производных финансовых инструментов.</p>	0,00%	да

Информация по покупкам, продажам и погашениям финансовых инструментов, находящихся в портфеле финансовых инструментов, сформированном за счет пенсионных активов, находящихся в доверительном управлении Halyk Finance

Таблица 6. Сведения по приобретению финансовых инструментов в отчетном месяце

Вид инструмента	Валюта	Эмитент ценной бумаги	Сумма сделки в тенге
Акции и депозитарные расписки иностранных эмитентов	USD	Lam Research Corporation	969 708 477,19
Корпоративные облигации эмитентов РК	KZT	ЧК "BI Development LTD"	796 736 000,00
Паи Exchange Traded Funds (ETF)	USD	SPDR Portfolio S&P 500 Growth ETF (SPYG)	540 193 076,61
ГЦБ Иностранных государств	USD	Министерство финансов США	487 484 094,14
Акции и депозитарные расписки иностранных эмитентов	USD	Merck & Co., Inc.	485 650 561,70
Паи Exchange Traded Funds (ETF)	USD	iShares Core S&P Mid-Cap ETF (IJH)	388 251 257,30
Корпоративные облигации эмитентов РК	USD	ЧК "BI Development LTD"	219 131 088,00
Паи Exchange Traded Funds (ETF)	USD	Vanguard Energy (VDE)	87 742 487,25
Акции и депозитарные расписки эмитентов РК	KZT	АО "КазМунайГаз"	11 990 655,00
Итого			3 986 887 697,19

Таблица 7. Сведения по продаже финансовых инструментов в отчетном месяце

Вид инструмента	Валюта	Эмитент ценной бумаги	Сумма сделки в тенге
Паи Exchange Traded Funds (ETF)	USD	SPDR® Portfolio S&P 500® Value ETF (SPYV)	542 565 180,00
ГЦБ Иностранных государств	USD	Министерство финансов США	489 689 244,16
Паи Exchange Traded Funds (ETF)	USD	Global X Uranium ETF (URA)	422 928 363,27
Паи Exchange Traded Funds (ETF)	USD	iShares U.S. Utilities ETF (IDU)	133 104 419,25
Паи Exchange Traded Funds (ETF)	USD	Vanguard Consumer Staples ETF (VDC)	121 075 745,80
Паи Exchange Traded Funds (ETF)	USD	VanEck Gold Miners ETF (GDX)	81 623 743,80
Итого			1 790 986 696,28

Таблица 8. Сведения по погашениям основного долга по ценным бумагам в отчетном месяце

Вид инструмента	Валюта	Эмитент ценной бумаги	Сумма сделки в тенге
В отчетном месяце погашений по ценным бумагам не было			
Итого			

Таблица 9. Сведения по размещениям во вклады иностранных банков в отчетном месяце

Вид инструмента	Валюта	Эмитент ценной бумаги	Сумма сделки в тенге
В отчетном месяце не осуществлялись размещения во вклады иностранных банков			
Итого			

Таблица 10. Сведения по погашениям основного долга по вкладам в отчетном месяце

Вид инструмента	Валюта	Эмитент ценной бумаги	Сумма сделки в тенге
В отчетном месяце не осуществлялись погашения основного долга по вкладам			
Итого			