«Halyk Global Markets» АҚ сенімгерлік басқаруындағы «БЖЗҚ» АҚ зейнетақы активтерін инвестициялық басқару бойынша ақпарат

2025 жылғы 1 наурыздағы жағдай бойынша «Halyk Global Markets» АҚ сенімгерлік басқаруындағы (бұдан әрі – Halyk Global Markets) «БЖЗҚ» АҚ (бұдан әрі – БЖЗҚ) зейнетақы активтерінің инвестициялық портфелі (бұдан әрі – Инвестициялық портфель) **5 145,17** млн. теңгені құрады.

Есепті кезеңнің соңындағы қаржы құралдары бөлінісіндегі Инвестициялық портфель құрылымы 1-кестеде берілген.

1-кесте. **Қаржы құралдарының бөлігіндегі Инвестициялық портфель құрылымы**

млн. теңге

Атауы	01.01.2025 жылға ағымдағы құны	01.01.2025 жылға үлесі	01.03.2025 жылға ағымдағы құны	01.03.2025 жылға үлесі	01.01.2025 ж. бастап өсуі/төмендеуі
ҚР екінші денгейдегі банктерінің облигациялары	631,08	13,02%	603,00	11,72%	-4,45%
Шетелдік эмитенттердің корпоративтік облигациялары	789,38	16,29%	754,15	14,66%	-4,46%
ХҚҰ облигациялары	136,30	2,81%	264,26	5,14%	93,89%
ҚР ұйымдарының корпоративтік облигациялары	563,57	11,63%	567,88	11,04%	0,76%
ҚР квазимемлекеттік ұйымдарының облигациялары	597,28	12,32%	592,68	11,52%	-0,77%
ҚР Қаржы министрлігінің мемлекеттік бағалы қағаздары	951,02	19,62%	921,51	17,91%	-3,10%
Шетелдік эмитенттердің үлестік құралдары (ETF пайлары)	129,85	2,68%	300,65	5,84%	131,54%
Қазақстан Республикасының ұйымдары шығарған акциялар және депозитарлық қолхаттар	151,90	3,13%	145,90	2,84%	-3,95%
Шет мемлекеттердің орталық үкіметтері шығарған мемлекеттік мәртебесі бар бағалы қағаздар	0,00	0,00%	383,49	7,45%	-
Кері РЕПО (90 күнтізбелік күннен артық емес)	892,45	18,41%	600,50	11,67%	-32,71%
Басқа активтер (дебиторлық берешек, мерзімі өткен берешек, провизиялар)	0,00	0,00%	0,00	0,00%	-
Шоттардағы ақшалай қаражат	4,16	0,09%	11,14	0,22%	167,89%
Halyk Global Markets басқаруындағы ЗА жиынтығы	**4 846,99**	**100,00%**	**5 145,17**	**100,00%**	**6,15%**
Жасалған мәмілелер бойынша төлеуге міндеттемелер	-	-	-	-	-
Зейнетақы активтерінің жиынтығы	**4 846,99**	**100,00%**	**5 145,17**	**100,00%**	**6,15%**

01.03.2025 ж. жағдай бойынша теңгемен көрсетілген борыштық қаржы құралдарының орташа алынған кірістілігі жылдық 10,30%-ды құрады. АҚШ долларымен көрсетілген қарыздық қаржы құралдарының орташа алынған кірістілігі 5,49%-ды құрады.

Кері РЕПО операциялары (90 күнтізбелік күннен артық емес)

Есепті кезеңнің аяғында Инвестициялық портфельде «Кері РЕПО» ашық позицияларының жалпы құны 600,50 млн. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 11,67%. «Кері РЕПО» ашық позициялары бойынша орташа алынған кірістілік есепті кезеңнің аяғында жылдық 15,00%-ды құрды.

Шетелдік эмитенттердің корпоративтік облигациялары

Есепті кезеңде Инвестициялық портфельге шетелдік эмитенттердің корпоративтік облигациялары сатып алынбады.

Есепті кезеңде шетелдік эмитенттердің корпоративтік облигацияларының құны 20,99 млн. теңгеге төмендеп, есепті кезеңнің аяғында 754,15 млн. теңгені құрады. Шетелдік эмитенттердің корпоративтік облигацияларының портфельдегі үлесі 2025 жылғы 1 наурыздағы жағдай бойынша 14,66% -ды құрды.

Есепті кезеңнің соңында шетелдік эмитенттердің корпоративтік облигацияларын өтеудің орташа алынған кірістілігі жылдық 5,44%-ды құрады.

Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банктерінің облигациялары

Есепті кезеңде Инвестициялық портфельге екінші деңгейдегі банктердің (бұдан әрі - ҚР ЕДБ) облигациялары сатып алынған жоқ.

ҚР ЕДБ облигацияларының құны есепті кезеңде 19,60 млн. теңгеге төмендеп, есепті кезеңнің аяғында 603,00 млн. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 2025 жылғы 1 наурыздағы жағдай бойынша 11,72% -ды құрады.

ҚР ЕДБ облигацияларын өтеудің орташа алынған кірістілігі есепті кезеңнің аяғында жылдық 12,26% -ды құрады.

Халықаралық қаржы ұйымдарының облигациялары

Есепті кезеңде Инвестициялық портфельге 125,80 млн. теңге көлемінде Азия даму банкінің облигациялары сатып алынды.

Халықаралық қаржы ұйымдары (бұдан әрі - ХҚҰ) облигацияларының құны есепті кезеңде 126,39 млн. теңгеге ұлғайды және есепті кезеңнің аяғында 264,26 млн. теңгені құрады. 2025 жылғы 1 наурыздағы жағдай бойынша портфельдегі ХҚҰ облигацияларының үлесі 5,14% -ды құрады.

Белгіленген сыйақы мөлшерлемесімен, теңгемен көрсетілген, ХҚҰ облигациялары бойынша өтеуге орташа алынған кірістілік есепті кезеңнің соңында жылдық 14,19%-ды құрады.

Белгіленген сыйақы мөлшерлемесімен АҚШ долларымен көрсетілген ХҚҰ облигациялары бойынша өтеуге орташа алынған кірістілік есепті кезеңнің соңында жылдық 4,47%-ды құрады.

Қазақстан Республикасы эмитенттерінің корпоративтік облигациялары

Есепті кезеңде Инвестициялық портфельге Қазақстан Республикасы эмитенттерінің корпоративтік облигациялары сатып алынбады.

Қазақстан Республикасы эмитенттерінің корпоративтік облигацияларының құны есепті кезеңде 4,90 млн. теңгеге өсіп, есепті кезеңнің аяғында 567,88 млн. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 2025 жылғы 1 наурыздағы жағдай бойынша 11,04%-ды құрады.

Қазақстан Республикасы эмитенттерінің теңгемен көрсетілген корпоративтік облигацияларын өтеуге орташа алынған кірістілік есепті кезеңнің аяғында жылдық 10,23% -ды құрады.

Есепті кезеңнің соңында Қазақстан Республикасы эмитенттерінің АҚШ долларымен көрсетілген корпоративтік облигацияларын өтеуге орташа алынған кірістілік жылдық 7,49% -ды құрды.

Қазақстан Республикасы Қаржы министрлігінің мемлекеттік бағалы қағаздары

Есепті кезеңде Инвестициялық портфельге Қазақстан Республикасы Қаржы министрлігінің мемлекеттік бағалы қағаздары (бұдан әрі - ҚР ҚМ МБҚ) сатып алынбады.

ҚР ҚМ МБҚ құны есепті кезеңде 13,79 млн. теңгеге төмендеп, есепті кезеңнің аяғында 921,51 млн. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 2025 жылғы 1 наурыздағы жағдай бойынша 17,91%-ды құрды.

Теңгемен көрсетілген ҚР ҚМ МБҚ өтеуге орташа алынған кірістілік есепті кезеңнің аяғында жылдық 13,08% -ды құрады.

Шет мемлекеттердің орталық үкіметтері шығарған мемлекеттік мәртебесі бар бағалы қағаздар

Есепті кезеңде Инвестициялық портфельге 385,11 млн. теңге көлемінде АҚШ қазынашылық облигациялары сатып алынды. Шет мемлекеттердің орталық үкіметтері шығарған мемлекеттік мәртебесі бар бағалы қағаздардың ағымдағы құны есепті күнге 383,49 млн. теңгені құрды. Олардың портфельдегі үлесі 2025 жылғы 1 наурыздағы жағдай бойынша 7,45% -ды құрады.

Шет мемлекеттердің орталық үкіметтері шығарған мемлекеттік мәртебесі бар бағалы қағаздарды өтеуге орташа алынған кірістілік есепті кезеңнің аяғында жылдық 5,67% құрады.

Қазақстан Республикасы эмитенттерінің акциялары мен депозитарлық қолхаттары

Есепті кезеңде Инвестициялық портфельге Қазақстан Республикасы эмитенттерінің акциялары мен депозитарлық қолхаттары сатып алынбады.

Қазақстан Республикасы эмитенттерінің акциялары мен депозитарлық қолхаттарының құны есепті кезеңде 3,22 млн. теңгеге төмендеп, есепті кезеңнің аяғында 145,90 млн. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 2025 жылғы 1 наурыздағы жағдай бойынша 2,84%-ды құрады.

Шетелдік эмитенттердің үлестік құралдары (ETF пайлары)

Есепті кезеңде Инвестициялық портфельге 255,14 млн. теңге көлемінде SPDR® Portfolio S&P 500® Value сатып алынды және 78,65 млн. теңге сомасына SPDR Portfolio S&P 500 Growth ETF толығымен сатылды.

Шетелдік эмитенттердің үлестік құралдарының құны (ETF пайлары) есепті кезеңде 168,37 млн. теңгеге ұлғайды және есепті кезеңнің аяғында 300,65 млн. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 2025 жылғы 1 наурыздағы жағдай бойынша 5,84% -ды құрады.

Қазақстан Республикасы квазимемлекеттік ұйымдарының облигациялары

Есепті кезеңде Инвестициялық портфельге Қазақстан Республикасы квазимемлекеттік ұйымдарының облигациялары сатып алынбады.

Қазақстан Республикасының квазимемлекеттік ұйымдары облигацияларының құны есепті кезеңде 1,22 млн. теңгеге азайып, есепті кезеңнің аяғында 592,68 млн. теңгені құрады. Қазақстан Республикасының квазимемлекеттік ұйымдары облигацияларының портфельдегі үлесі 2025 жылғы 1 наурыздағы жағдай бойынша 11,52%-ды құрады.

Қазақстан Республикасының квазимемлекеттік ұйымдарының облигацияларын өтеуге орташа алынған, теңгемен көрсетілген, кірістілік есепті кезеңнің аяғында жылдық 3,11%-ды құрады.

Валюталық құрылым

Есепті кезеңнің соңындағы валюталар бөлінісіндегі Инвестициялық портфель құрылымы 2-кестеде берілген.

2-кесте. Валюталар бөлігінде Инвестициялық портфель құрылымы

млн. теңге

Валюта	01.01.2025 жылға ағымдағы құны	01.01.2025 жылға үлесі	01.03.2025 ж. ағымдағы құны	01.03.2025 жылға үлесі	01.01.2025 ж. бастап өсуі/төмендеуі
Ұлттық валюта	3 864,17	79,72%	3 515,98	68,34%	-9,01%
АҚШ доллары	982,79	20,28%	1 629,15	31,66%	65,77%
Евро	0,034	0,0007%	0,033	0,0006%	-5,05%
Жиыны:	**4 846,99**	**100,00%**	**5 145,17**	**100,00%**	**6,15%**

Инвестициялық қызмет нәтижелері

Инвестициялық қызмет нәтижесінде 2025 жылғы 1 наурыздағы жағдай бойынша есептелген инвестициялық кіріс 2021 жылғы 15 наурыздан бастап 1 337,57 млн. теңгені және 2025 жылдың басынан бастап есептелген инвестициялық кіріс мөлшері 7,93 млн. теңгені құрады. Зейнетақы активтерінің кірістілігі қызмет басталғанан бері 52,55% -ды және 2025 жылдың басынан бері 0,14% -ды құрады.

Есептелген инвестициялық табыс құрылымы

Есептелген инвестициялық табыстың құрылымы 3-кестеде көрсетілген.

3-кесте. Инвестициялық портфель бойынша нвестициялық кіріс құрылымы

млн. теңге

Атауы	2025 жыдың басынан бергі инвестициялық кіріс
Бағалы қағаздар бойынша, оның ішінде орналастырылған салымдар және «кері РЕПО» операциялары бойынша сыйақы түріндегі кірістер	93,11
Бағалы қағаздарды нарықтық қайта бағалаудан түскен кірістер (шығындар)	-34,57
Шетел валюталарын қайта бағалаудан түскен кірістер (шығындар)	-49,60
Басқа кірістер (шығындар)	-1,01
Жиыны:	**7,93**

Шартты бірлік құны туралы ақпарат

Инвестициялық портфельдің шартты бірлігі құнының динамикасы 4-кестеде көрсетілген.

4-кесте. Инвестициялық портфельдің бір шартты бірлігінің құны

№	Күні	Бір шартты бірлік құны
1	01.02.2025	1 374,0069860
2	02.02.2025	1 374,0069860
3	03.02.2025	1 378,4687889
4	04.02.2025	1 378,4687889
5	05.02.2025	1 378,4687889
6	06.02.2025	1 378,4687889
7	07.02.2025	1 378,4687889
8	08.02.2025	1 378,4687889
9	09.02.2025	1 378,4687889
10	10.02.2025	1 371,8355779
11	11.02.2025	1 371,8355779
12	12.02.2025	1 371,8355779
13	13.02.2025	1 371,8355779
14	14.02.2025	1 371,8355779
15	15.02.2025	1 371,8355779
16	16.02.2025	1 371,8355779
17	17.02.2025	1 367,1068463

№	Күні	Бір шартты бірлік құны
18	18.02.2025	1 367,1068463
19	19.02.2025	1 367,1068463
20	20.02.2025	1 367,1068463
21	21.02.2025	1 367,1068463
22	22.02.2025	1 367,1068463
23	23.02.2025	1 367,1068463
24	24.02.2025	1 372,7841400
25	25.02.2025	1 372,7841400
26	26.02.2025	1 372,7841400
27	27.02.2025	1 372,7841400
28	28.02.2025	1 372,1468697

Инвестициялық декларация параметрлерін сақтау туралы ақпарат

Инвестициялық портфельді құрылымдық бөлу қаржы құралдарының портфеліне қойылатын Инвестициялық декларация талаптарына сәйкес келеді[1]. Валюталық позициялар үлесі етілген деңгей шегінде қалады және қаржы құралдарының портфеліне қойылатын Инвестициялық декларация талаптарын бұзбайды. 2025 жылғы 1 наурыздағы жағдай бойынша инвестициялау лимиттерін сақтау туралы мәліметтер 5-кестеде берілген.

5-кесте. Инвестициялық портфель бойынша инвестициялау лимиттері

№	Қаржы құралының түрі	Нақты мәні (ЗА-ның пайызы)	Орындалуы (иә/жоқ)
1	Банктік шоттардағы қалдықтарды қосқандағы ақшалай қаражат	0,11%	иә
2	Кері репо	11,67%	иә
3	Қазақстан Республикасының Қаржы министрлігі мен Қазақстан Республикасының Ұлттық Банкі шығарған Қазақстан Республикасының мемлекеттік бағалы қағаздары (оның ішінде шет мемлекеттердің заңнамасына сәйкес эмитенттелген), сондай-ақ Қазақстан Республикасы Үкіметінің кепілдігімен және (немесе) кепілгерлігімен шығарылған бағалы қағаздар	17,91%	иә
4	Қазақстан Республикасының жергілікті атқарушы органдары шығарған борыштық бағалы қағаздар	0,00%	иә
5	Акцияларының жүз пайызы Қазақстан Республикасының Ұлттық Банкіне тиесілі заңды тұлға шығарған борыштық бағалы қағаздар	2,19%	иә
6	Қазақстан Республикасының және басқа мемлекеттердің заңнамасына сәйкес «Қазақстанның Даму Банкі», «Самұрық-Қазына» ұлттық әл-ауқат қоры», «Бәйтерек» ұлттық басқару холдингі», «Проблемалы кредиттер қоры» акционерлік қорлары шығарған борыштық бағалы қағаздар	7,01%	иә
7	Төмендегі талаптардың біріне сәйкес келсе, Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банктеріне салымдар: - банктердің «Standard&Poor's» (Стандард энд Пурс) агенттігінің халықаралық шәкілі бойынша «ВВ-» төмен емес ұзақ мерзімді кредиттік рейтингісі немесе Moody's Investors Service (Мудис Инвесторс Сервис) немесе Fitch (Фич) агенттіктерінің осыған ұқсас деңгейінің рейтингілік бағасы бар, немесе Standard & Poor's (Стандард	0,00%	иә

[1] *Halyk Global Markets сенімгерлік басқаруындағы зейнетақы активтері есебінен қалыптастырылған қаржы құралдарының портфеліне Инвестициялық декларация «Halyk Global Markets» АҚ Директорлар кеңесінің шешімімен бекітілді. 2021 жылғы 18 ақпандағы №4 сырттай дауыс беру қорытындылары туралы хаттама*

№	Қаржы құралының түрі	Нақты мәні (ЗА-ның пайызы)	Орындалуы (иә/жоқ)
	энд Пурс) ұлттық шкаласы бойынша «kzA-»-дан төмен емес рейтингтік бағасы бар; - банктер резидент еншілес банктер болып табылады, олардың бас бейрезидент банкінің «Standard&Poor's» (Стандард энд Пурс) агенттігінің халықаралық шкаласы бойынша «А-» төмен емес ұзақ мерзімді кредиттік рейтингісі немесе Moody's Investors Service (Мудис Инвесторс Сервис) немесе Fitch (Фич) агенттіктерінің бірінің осыған ұқсас деңгейінің рейтингілік бағасы бар.		
8	«Standard&Poor's» (Стандард энд Пурс) агенттігінің халықаралық шкаласы бойынша «А-» төмен емес ұзақ мерзімді рейтингісі немесе Moody's Investors Service (Мудис Инвесторс Сервис) немесе Fitch (Фич) агенттіктерінің бірінің осыған ұқсас деңгейінің рейтингтік бағасы бар бейрезидент банктерге салымдар.	0,00%	иә
9	«Standard&Poor's» (Стандард энд Пурс) агенттігінің халықаралық шкаласы бойынша «ВВ+» төмен емес рейтингтік бағасы немесе Moody's Investors Service (Мудис Инвесторс Сервис) немесе Fitch (Фич) агенттіктерінің бірінің осыған ұқсас деңгейінің рейтингтік бағасы бар келесі халықаралық қаржы ұйымдары шығарған борыштық бағалы қағаздар: - Азия даму банкі (the Asian Development Bank); - Америкааралық даму банкі (the Inter-American Development Bank); - Африка даму банкі (the African Development Bank); - Еуропа қайта құру және даму банкі (the European Bank for Reconstruction and Development); - Еуропа инвестициялық банкі (the European Investment Bank); - Еуропалық Кеңестің Даму банкі (the Council of Europe Development Bank); - Жеке секторды дамыту бойынша ислам корпорациясы (the Islamic Corporation for the Development of the Private Sector); - Ислам Даму банкі (the Islamic Development Bank); - Инвестициялар кепілдігінің көпжақты агенттігі (the Multilateral Investment Guarantee Agency); - Скандинавия инвестиция банкі (the Nordic Investment Bank); - Халықаралық валюта қоры (the International Monetary Fund); - Халықаралық даму қауымдастығы (the International Development Association); - Инвестициялық дауларды реттеу жөніндегі халықаралық орталық (the International Centre for Settlement of Investment Disputes); - Халықаралық қайта құру және даму банкі (the International Bank for Reconstruction and Development); - Халықаралық қаржы корпорациясы (the International Finance Corporation). сондай-ақ жарғылық капиталындағы Қазақстан Республикасының үлесі кемінде 25 % құрайтын халықаралық қаржы ұйымы шығарған бағалы қағаздар	5,14%	иә
10	Standard & Poor's (Стандард энд Пурс) агенттігінің халықаралық шкаласы бойынша "ВВ+" -тен төмен емес тәуелсіз рейтингі немесе Moody's Investors Service (Мудис Инвесторс Сервис) немесе Fitch (Фич) агенттіктерінің осыған ұқсас деңгейдегі рейтингтік бағасы бар шет мемлекеттердің орталық үкіметтері шығарған мемлекеттік мәртебесі бар бағалы қағаздар	7,45%	иә
11	Morningstar (Морнинстар) рейтингтік агенттігінің «3 жұлдыз» төмен емес рейтингілік бағасы бар Exchange Traded Funds (Эксчейндж Трэйдэд Фандс), Exchange Traded Commodities (Эксчейндж Трэйдэд Коммодитис), Exchange Traded Notes (Эксчейндж Трэйдэд Ноутс)	5,84%	иә

№	Қаржы құралының түрі	Нақты мәні (ЗА-ның пайызы)	Орындалуы (иә/жоқ)
	пайлары, бұған Exchange Traded Funds (Эксчейндж Трэйдэд Фандс) пайлары кірмейді, олардың активтерінің құрылымы негізгі қор индекстерінің бірінің құрылымын немесе пайлары негізгі қор индекстеріне байлаулы баға құрушыны қайталайды.		
12	Активтерінің құрылымы негізгі қор индекстерінің бірінің құрылымын қайталайтын немесе пайлары бойынша баға белгілеу негізгі қор индекстеріне байланыстырылған Exchange Traded Funds (ETF) пайлары	0,00%	иә
13	Басқарушы компаниясы Қазақстан Республикасының заңнамасына сәйкес құрылған заңды тұлға болып табылатын, қор биржасының ресми тізіміне енгізілген, қор биржасының ресми тізімінің «Аралас» алаңының «инвестициялық қорлардың бағалы қағаздары» секторының талаптарына сәйкес келетін аралық инвестициялық пай қорларының пайлары	0,00%	иә
14	Шетелдік ұйымдар шығарған мемлекеттік емес бағалы қағаздар: 1) «Standard&Poor's» (Стандард энд Пурс) агенттігінің халықаралық шкаласы бойынша «BB» төмен емес рейтингтік бағасы немесе Moody's Investors Service (Мудис Инвесторс Сервис) немесе Fitch (Фич) агенттіктерінің бірінің осыған ұқсас деңгейінің рейтингтк бағасы бар шетелдік эмитенттердің акциялары және базалық активтері аталған акциялар болып табылатын депозитарлық қолхаттар; 2) негізгі қор индекстерінің құрамына кіретін шетелдік эмитенттердің акциялары және базалық активтері аталған акциялар болып табылатын депозитарлық қолхаттар;	0,00%	иә
	«Standard&Poor's» (Стандард энд Пурс) агенттігінің халықаралық шәкілі бойынша «BB» төмен емес рейтингілік бағасы немесе Moody's Investors Service (Мудис Инвесторс Сервис) немесе Fitch (Фич) агенттіктерінің бірінің осыған ұқсас деңгейінің рейтингілік бағасы бар борыштық бағалы қағаздар.	14,6%	иә
15	Қазақстан Республикасы мен басқа мемлекеттердің заңнамасына сәйкес Қазақстан Республикасының ұйымдары шығарған мемлекеттік емес бағалы қағаздар: 1) қор биржасында кең ауқымды инвесторлар арасында жария ұсыныс (сату) аясында орналастырылған (орналастырылатын) Қазақстан Республикасының квазимемлекеттік секторы эмитенттерінің акциялары және (немесе) базалық активтері аталған акциялар болып табылатын депозитарлық қолхаттар; 2) қор биржасының ресми тізімінің «Негізгі» алаңының «акциялар» секторының «премиум» санатының талаптарына сәйкес келетін қор биржасының ресми тізіміне енгізілген заңды тұлғалардың акциялары және базалық активтері аталған акциялар болып табылатын депозитарлық қолхаттар; 3) негізгі қор индекстерінің құрамына кіретін заңды тұлғалардың акциялары;	2,84%	иә
	4) «Standard&Poor's» (Стандард энд Пурс) агенттігінің халықаралық шәкілі бойынша «B+» төмен емес рейтингілік бағасы немесе Moody's Investors Service (Мудис Инвесторс Сервис) немесе Fitch (Фич) агенттіктерінің бірінің осыған ұқсас деңгейінің рейтингтік бағасы бар, немесе Standard & Poor's (Стандард энд Пурс) ұлттық шкаласы бойынша «kzBBB» төмен емес рейтингтік бағасы бар борыштық бағалы қағаздар; 5) бұрын шығарылған бағалы қағаздарға немесе аталған эмитенттің басқа міндеттемелеріне айырбастау мақсатында эмитенттің міндеттемелерін қайта құрылымдау аясында шығарылған бағалы қағаздар.	25,07%	иә

№	Қаржы құралының түрі	Нақты мәні (ЗА-ның пайызы)	Орындалуы (иә/жоқ)
16	Standard & Poor's (Стандард энд Пурс) агенттігінің халықаралық шкаласы бойынша "ВВВ" - дан төмен емес тәуелсіз рейтингі немесе Moody's Investors Service (Мудис Инвесторс Сервис) немесе Fitch (Фич)агенттіктерінің осыған ұқсас деңгейдегі рейтингтік бағасы бар елдердің шетел валютасы	0,11%	иә
17	Қазақстан Республикасының Кәсіпкерлік кодексіне сәйкес шағын немесе орта кәсіпкерлікке жатқызылған субъектілер шығарған, қор биржасының ресми тізімінің "Негізгі" немесе "Балама" алаңының "борыштық бағалы қағаздар" секторына енгізілген және "ДАМУ "кәсіпкерлікті дамыту қоры" акционерлік қоғамының және (немесе) "Қазақстанның Даму Банкі" акционерлік қоғамның кепілдігі бар мемлекеттік емес борыштық бағалы қағаздар, оның сомасы осы мемлекеттік емес борыштық бағалы қағаздардың номиналды құнының кемінде 50 (елу) пайызын жабады	0,00%	иә
18	Лондон қымбат металдар нарығының қауымдастығы (London bullion market association) қабылдаған халықаралық сапа стандарттарына сәйкес келетін тазартылған қымбат металдар және осы қауымдастықтың құжаттарында «Лондон сапалы жеткізілімі» стандарты ретінде белгіленген («London good delivery») халықаралық стандарттарға сәйкес келетін тазартылған бағалы металдар және металл депозиттері, оның ішінде Standard & Poor's (Стандард энд Пурс) агенттігінің «АА» -дан төмен емес рейтингтік бағасы немесе Moody's Investors Service (Мудис Инвесторс Сервис) немесе Fitch (Фич) агенттіктерінің осыған ұқсас деңгейдегі рейтингтік бағасы бар Қазақстан Республикасының резидент емес банктерінде, он екі айдан аспайтын мерзімге	0,00%	иә
19	Базалық активі осы қосымшаға сәйкес зейнетақы активтері есебінен сатып алуға рұқсат етілген қаржы құралдары болып табылатын хеджирлеу мақсатында жасалған келесідей туынды қаржы құралдары: опциондар - сатып алушыға аталған 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; форвардтар - бір тарап белгілі бір мерзімде келісімшарттың нысанасын беруге, ал екінші Тарап оны көрсетілген құн бойынша, көрсетілген уақытта және көрсетілген жерде қабылдауға міндеттенетін шарт; своптар - келісімшартта белгіленген шарттарға сәйкес болашақта төлемдерді айырбастау туралы екі контрагент арасындағы келісім; жоғарыда аталған туынды қаржы құралдарының жиынтығы болып табылатын туынды қаржы құралдары; жоғарыда аталған туынды қаржы құралдарының жиынтығы болып табылатын туынды қаржы құралдары	0,00%	иә
20	14-тармақтың 1) және 2) тармақшаларында және 15-тармақтың 1), 2) және 3) тармақшаларында, сондай-ақ 11,12 және 13-тармақтарда көрсетілген үлестік құралдар портфеліне зейнетақы активтері инвестицияларының жиынтық көлемі	8,68%	иә

Есепті кезеңдегі Инвестициялық портфельдегі қаржы құралдарын сатып алу, сату және өтеу бойынша ақпарат

6-кесте. Есепті кезеңде қаржы құралдарын сатып алу бойынша мәліметтер

Құрал түрі	Валюта	Бағалы қағаз эмитенті	Мәміле құны, теңгемен
Шет мемлекеттердің орталық үкіметтері шығарған мемлекеттік мәртебесі бар бағалы қағаздар	USD	АҚШ Үкіметінің атынан Қазынашылық	385 112 637,98
Шетелдік эмитенттердің үлестік құралдары (ETF пайлары)	USD	SPDR® Portfolio S&P 500® Value	255 137 469,17
ХҚҰ облигациялары	USD	Asian Development Bank	125 796 293,69
Жиыны			**766 046 400,84**

7-кесте. Есепті кезеңде қаржы құралдарын сату бойынша мәліметтер

Құрал түрі	Валюта	Бағалы қағаз эмитенті	Мәміле құны, теңгемен
Шетелдік эмитенттердің үлестік құралдары (ETF пайлары)	USD	SPDR Portfolio S&P 500 Growth ETF	78 646 766,79
Жиыны			**78 646 766,79**

8-кесте. Есепті айда бағалы қағаздар бойынша негізгі борышты өтеу жөніндегі мәліметтер

Құрал түрі	Валюта	Бағалы қағаз эмитенті	Мәміле сомасы, теңгемен
Есепті айда бағалы қағаздар бойынша өтемдер болған жоқ			
Жиыны			

9-кесте. Есепті айда шетелдік банктердің салымдарына орналастыру жөніндегі мәліметтер

Құрал түрі	Валюта	Банк атауы	Мәміле сомасы, теңгемен
Есепті айда шетелдік банктердің салымдарына орналастыру жүзеге асырылмады			
Жиыны			

10-кесте. Есепті айда салымдар бойынша негізгі борышты өтеу жөніндегі мәліметтер

Құрал түрі	Валюта	Банк атауы	Өтеу сомасы, теңгемен
Есепті айда салымдар бойынша негізгі борышты өтеу жүргізілмеді			
Жиыны			