

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

2024 жылғы 1 қарашадағы жағдай бойынша Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкінің (бұдан әрі – ҚРҰБ) сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ зейнетақы активтері<sup>1</sup> (бұдан әрі – ЗА) 21 309,33 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	01.11.2024 жылға ағымдағы құны	01.11.2024 жылға үлесі	млрд. теңге Жыл басынан өсуі/төмендеуі
ҚР ҚМ МБҚ	8 289,48	46,55%	8 942,18	41,96%	7,9%
Шетелдік мемлекеттердің МБҚ	22,36	0,13%	537,20	2,52%	2302,6%
ХҚҰ	359,46	2,02%	351,15	1,65%	-2,3%
ҚР эмитенттерінің корпоративтік облигациялары	14,01	0,08%	11,90	0,06%	-15,1%
ҚР квазимемлекеттік ұйымдарының облигациялары	1 619,89	9,10%	1 939,81	9,10%	19,7%
ҚР ЕДБ облигациялары	848,05	4,76%	950,27	4,46%	12,1%
PPN (құрылымдық ноттар)	7,23	0,04%	8,02	0,04%	10,8%
ҚР эмитенттерінің акциялары және депозитарлық қолхаттары	350,53	1,97%	383,35	1,80%	9,8%
Депозиттер	197,21	1,11%	20,94	0,10%	-89,4%
ҚРҰБ депозиттері	876,66	4,92%	399,21	1,87%	-54,5%
Инвестициялық шоттардағы ақшалай қаражат	48,34	0,27%	46,11	0,22%	-4,6%
РЕПО операциялары	26,71	0,15%	112,59	0,53%	321,6%
Басқа активтер (дебиторлық берешек, мерзімі өткен берешек, провизиялар)	-	-	1,55	0,01%	100%
<b>Активтерді индекстік басқару, оның ішінде:</b>	5 146,10	28,90%	7 605,04	35,69%	47,8%
дамыған елдердің активтері	1 644,24	9,23%	2 064,90	9,69%	25,6%
дамушы елдердің активтері	1 122,87	6,31%	1 300,11	6,10%	15,8%
<b>сыртқы басқарудағы активтер</b>	<b>2 378,99</b>	<b>13,36%</b>	<b>4 240,02</b>	<b>19,90%</b>	<b>78,2%</b>
<b>дамушы елдер облигацияларының мандаты бойынша:</b>					
Aviva Investors Global Services Limited	173,41	0,97%	255,11	1,20%	47,12%
TCW Asset Management Company LLC	-	-	73,24	0,34%	100,00%
PIMCO Asia Pte Ltd	-	-	219,53	1,03%	100,00%
<b>ғаламдық акциялар мандаты бойынша:</b>					
Invesco Asset Management Deutschland GmbH	170,5	0,96%	318,63	1,50%	86,88%
HSBC Global Asset Management (UK) Limited	311,96	1,75%	522,11	2,45%	67,37%
UBS Asset Management (UK) Ltd	226,16	1,27%	416,77	1,96%	84,28%
Blackrock Financial Management	176,62	0,99%	364,53	1,71%	106,39%

<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

BlackRock Investment Management	116,41	0,65%	211,77	0,99%	81,92%
Robeco Institutional Asset Management B.V.	219,38	1,23%	323,67	1,52%	47,54%
<b>инвестициялық деңгейдегі корпоративтік облигациялар мандаты бойынша:</b>					
Principal Global Investors (Europe) Limited	489,75	2,75%	575,76	2,70%	17,56%
PGIM Limited	494,79	2,78%	583,91	2,74%	18,01%
PIMCO Asia Pte Ltd	-	-	374,98	1,76%	100,00%
<b>ҚРҰБ басқаруындағы ЗА жиынтығы</b>	<b>17 806,03</b>	<b>100,00%</b>	<b>21 309,33</b>	<b>100,00%</b>	<b>19,67%</b>
Зейнетақы жарналары мен төлемдері шоттарындағы ақша	38,97		26,14		
<b>Зейнетақы активтерінің жиынтығы</b>	<b>17 845,01</b>		<b>21 335,48</b>		

БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфеліндегі борыштық қаржы құралдарын өтеуге орташа алынған кірістілік (ҮТМ) 01.11.2024 жылғы жағдай бойынша жылдық 9,81% құрады, оның ішінде теңгеге номинирленген – жылдық 11,41%, шетелдік валютада – жылдық 4,60%.

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

БЖЗҚ ЗА портфелінде негізгі үлесті ҚР Қаржы министрлігінің МБҚ құрайды, олардың есептік айдағы ағымдағы құны 83,10 млрд. теңгеге ұлғайды және 8 942,18 млрд. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 41,96% құрады.

Есептік айда 42,47 млрд.теңге көлемінде ҚР МБҚ өтелді. ҚР Қаржы министрлігінің бағалы қағаздары сатылмады.

Қарастырылып отырған кезеңде орташа алынған кірістілігі жылдық 13,10% құрайтын номиналды құны бойынша 49,20 млрд.теңге көлемінде ҚР Қаржы министрлігінің МБҚ сатып алынды.

Есептік күнге ҚР Қаржы министрлігінің МБҚ бойынша өтеуге орташа алынған кірістілік жылдық 11,66% құрады.

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

Есептік ай үшін өтімділіктің қосалқы портфеліндегі шетелдік мемлекеттердің мемлекеттік бағалы қағаздарының ағымдағы құны 353,66 млрд. теңгеге азайды және 537,20 млрд. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 2,52% құрады.

Қарастырылып отырған кезеңде орташа алынған кірістілігі жылдық 4,52% құрайтын номиналды құны бойынша 77,09 млрд.теңге көлемінде АҚШ МБҚ сатып алынды.

Есептік айда 218,80 млрд.теңге көлемінде АҚШ МБҚ сатылды, сондай-ақ 194,79 млрд.теңге көлемінде АҚШ МБҚ өтелді.

Есептік күнге БЖЗҚ ЗА валюталық портфелінің өтімділіктің қосалқы портфеліндегі шетелдік мемлекеттердің МБҚ өтеуге орташа алынған кірістілігі жылдық 5,41% құрады.

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

Есептік айда халықаралық қаржы ұйымдары облигацияларының ағымдағы құны 2,94 млрд. теңгеге ұлғайды және 351,15 млрд. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 1,65% 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 12,57%, сыйақының индекстелген мөлшерлемесі – инфляция және сыйлықақы құрады.

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

Орташа алынған өтеу мерзімі 0,10 жыл болатын ҚР ЕДБ салымдарының ағымдағы құны есептік айда 5,04 млрд. теңгеге азайды және 20,94 млрд. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 0,10% құрады.

Есептік айда 5,00 млрд.теңге көлемінде «Еуразиялық банк» 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 399,21 млрд.теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 1,87%.

Есептік айда ағымдағы өтімділікті басқару аясында зейнетақы активтері бойынша табыстылықты ұстап тұру мақсатында ҚР Ұлттық Банкінің депозиттеріне инвестиция салынды. Мәмілелердің орташа көлемі жылдық 13,81% орташа алынған кірістілікпен 73,46 млрд. теңгені құрады.

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

ҚР эмитенттерінің корпоративтік облигацияларының ағымдағы құны 11,90 млрд. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 0,06% құрады.

Қарастырылып отырған кезеңде қайта сатып алу аясында 2,04 млрд.теңге сомасына «ДТJ» АҚ облигацияларының бөлігі сатылды. ҚР эмитенттерінің корпоративтік облигациялары сатып алынбады және өтелмеді.

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

Есептік айда ҚР квазимемлекеттік ұйымдардың облигацияларының ағымдағы құны 10,96 млрд. теңгеге азайды және 1 939,81 млрд. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 9,10% 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 11,02%, АҚШ долларына – жылдық 5,49% құрады.

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

Есептік айда ҚР ЕДБ облигацияларының ағымдағы құны 3,62 млрд.теңгеге азайды және 950,27 млрд.теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 4,46% құрады.

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

Есептік күнге ҚР ЕДБ облигациялары бойынша өтеуге орташа алынған кірістілік жылдық 9,56% құрады.

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

Есептік айда шетелдік эмитенттердің PPN (құрылымдық ноттар) ағымдағы құны 8,02 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 7,69 млрд. теңгеге ұлғайды және 383,35 млрд. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 1,80% құрады.

Қарастырылып отырған кезеңде «Қазатомпром» ҰАК» АҚ депозитарлық қолхаттарының бөлігі 9,65 млрд. теңге сомасында сатылды. ҚР эмитенттерінің акциялары мен депозитарлық қолхаттары сатып алынбады.

### **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 240,80 млрд.теңгеге ұлғайды және 2 064,90 млрд.теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 9,69%. Есептік кезеңде 500,00 млн. АҚШ доллары көлемінде БЖЗҚ зейнетақы активтерінің бөлігі дамыған елдердің облигацияларының субпортфеліне берілді.

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 қарашаға аталған индекстің құрамына облигациялардың 205 шығарылымы кіреді.

#### *Дамушы елдер облигацияларының субпортфелі*

Есептік айда дамушы елдер облигациялары субпортфелінің ағымдағы құны 120,38 млрд.теңгеге ұлғайды және 1 848,00 млрд.теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 8,67%. Есептік кезеңде БЖЗҚ зейнетақы активтерінің бөлігі PIMCO Asia Pte Ltd және TCW Asset Management Company LLC басқаруына, сондай-ақ 150,00 млн. АҚШ доллары және 50,00 млн. АҚШ доллары көлемінде дамушы елдердің облигацияларының субпортфеліне тапсырылды, сондай-ақ дербес басқарылатын дамушы елдердің қосалқы портфеліне 60,00 млн. АҚШ доллары сомасындағы облигациялар берілді.

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 қарашадағы аталған индекстің құрамына 29 дамушы елдер шығарған АҚШ долларына номиналданған облигациялардың 413 шығарылымы кіреді.

#### *Корпоративтік облигациялардың субпортфелі*

Есептік айда корпоративтік облигациялары субпортфелінің ағымдағы құны 43,50 млрд.теңгеге ұлғайды және 1 534,65 млрд.теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 7,20%.

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 қарашадағы аталған индекснің құрамына 1308 эмитент шығарған облигациялардың 7 431 шығарылымы кіреді.

#### *Акциялардың субпортфелі*

Есептік айда акциялардың субпортфелінің ағымдағы құны 143,28 млрд.теңгеге ұлғайды және 2 157,48 млрд.теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 10,12%. Есептік кезеңде БЖЗҚ зейнетақы активтерінің бөлігі 125,00 млн АҚШ доллары және 45,00 млн АҚШ доллары көлемінде Blackrock Financial Management және HSBC Global Asset Management (UK) Limited басқаруына тапсырылды.

Акциялардың субпортфелі үшін әлемнің дамыған елдері компанияларының акцияларынан тұратын Custom MSCI World Index индекс эталон портфель болып табылады. 2024 жылғы 1 қарашадағы аталған индекснің құрамына 23 дамыған елдерге жататын жоғары және орташа капитализациясымен компаниялардың 1 365 акциясы кіреді. Индекснің 74,8% 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 228,00 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	01.11.2024 ж. ағымдағы құны	01.11.2024 ж. үлесі	Жыл басынан өсуі/төмендеуі
Ұлттық валюта	12 161,38	68,30%	12 856,52	60,33%	5,72%
АҚШ доллары	5 639,89	31,67%	8 451,45	39,66%	49,85%
Басқа валюталар	4,76	0,03%	1,363280	0,01%	-71,38%
<b>Жиыны:</b>	<b>17 806,03</b>	<b>100,00%</b>	<b>21 309,33</b>	<b>100,00%</b>	<b>19,67%</b>

*млрд. теңге*

#### **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 2,39 трлн. теңгені құрады.

2024 жылғы 1 қарашадағы жағдай бойынша салымшылардың (алушылардың) шоттарына бөлінген соңғы 12 ай үшін БЖЗҚ зейнетақы активтерінің кірістілігі инфляция 8,50% болғанда 14,88% құрады. 2024 жылдың басынан бастап салымшылардың (алушылардың) шоттарына бөлінген БЖЗҚ зейнетақы активтерінің кірістілігі 12,67% құрады.

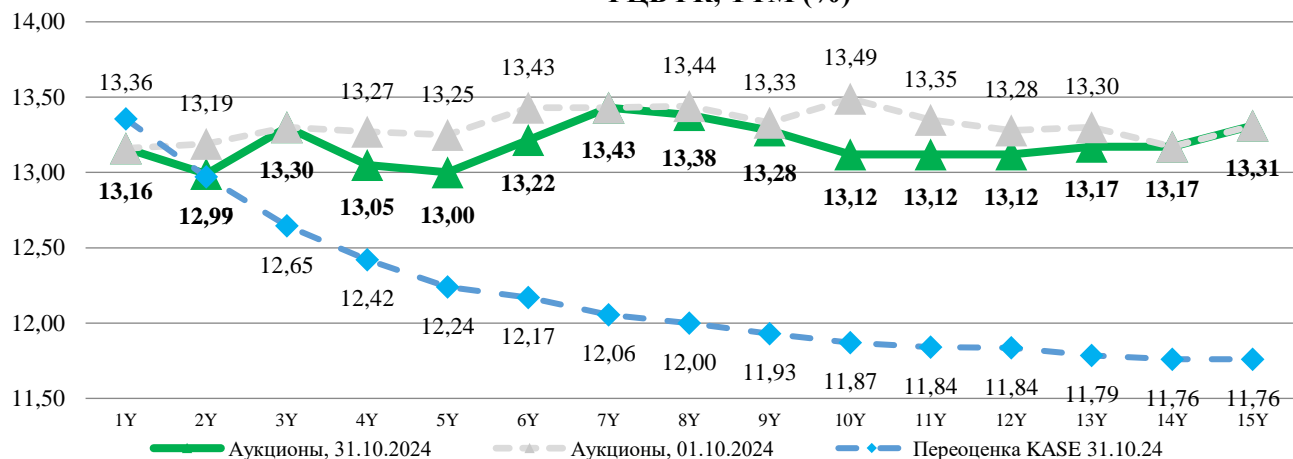
2024 жылғы қазанда АҚШ-тағы президенттік сайлауда Дональд Трамптың жеңіске жетуіне және Сенат пен Өкілдер палатасына сайлауда республикашылдардың жеңіске жетуіне үміт артқан жағдайда нарық жоғары құбылмалылықты көрсетті. Қазан айының соңында АҚШ-тың базалық мөлшерлемесін төмендетуге қатысты нарықтық күтулер 25 базалық тармақ үш еседен екі есеге дейін төмендеді. Құрама Штаттардағы инфляцияның динамикасы қазанда аздап өскенін көрсетті – қыркүйектегі 2,4%-ға қарсы жылдық 2,6%, ал ай сайынғы инфляцияның өсуі 0,2% деңгейінде сақталды. Қазан айында шаруашылықтан тыс жалақы өсімі Милтон дауылы мен Боинг ереуіліне байланысты күтілген 113-мыңнан 12-мыңға әлдеқайда төмен болды. Бұл ретте жұмыссыздық деңгейі 4,1% деңгейінде сақталды.

Нәтижесінде АҚШ-тың эталондық 10 жылдық қазынашылық облигацияларының кірістілігі қазанда 50 базалық тармаққа көбейді. Дамушы елдердің облигациялары бойынша

спредтер 20 базалық тармаққа азайды, ал корпоративтік облигациялар бойынша спредтер 5 базалық тармаққа азайды. Мұнымен бірге, MSCI World акцияларының индексі 2,04%-ға азайды.

ҚР МБҚ орналастыру бойынша аукциондарда қазанда ҚРҰБ-тың базалық мөлшерлемені 14,25%-ға дейінде сақтау туралы шешімі аясында қисықтың жақын ұшында кірістіліктіңздап төмендеуі байқалды. Бұл ретте қазанда инфляция жылдық 8,5%-ға (қыркүйекте 8,3%) немесе қазан ішінде 0,9%-ға (қыркүйекте 0,4%) дейін жеделдетілген. ҚР МБҚ аукциондарында орташа сұраныс ұсыныстан 4,4 ретке асып түсті, бұл ретте негізгі сұраныс қысқа мерзімді МБҚ орналастыруларына шоғырландырылды. Мұнымен бірге ҚР ҚМ қарыз алу көлемінің қыркүйекте 224 млрд.теңгеден қазанда 600 млрд. теңгеге дейін арттыру 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	1 299,53
Бағалы қағаздарды нарықтық қайта бағалаудан кірістер (шығындар)	70,69
Шетелдік валютаны қайта бағалаудан кірістер (шығындар)	286,65
Сыртқы басқарудағы активтер бойынша кірістер (шығындар)	734,41
Басқа кірістер (шығындар)	3,51
<b>Жыны:</b>	<b>2 394,79</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 қарашадағы 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	0,01%	иә
	Шетелдік валютадағы ақшалай қаражат	0,29%	иә
1	Қазақстандық қаржы құралдары:	58,93%	

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

1.1	Қазақстан Республикасы Қаржы Министрлігі, Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкі шығарған Қазақстан Республикасының мемлекеттік бағалы қағаздары	41,96%	иә
1.1.1	Қазақстан Республикасының жергілікті атқарушы органдары шығарған Қазақстан Республикасының мемлекеттік бағалы қағаздары	0,00%	иә
1.2	Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкінің депозиттері	1,87%	иә
1.3	Квазимемлекеттік сектор субъектілерінің бағалы қағаздары	10,47%	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:	4,32%	иә
1)	реттелген борыштық бағалы қағаздарды қоспағанда, борыштық бағалы қағаздар	4,15%	иә
2)	үлестік бағалы қағаздар	0,07%	иә
3)	депозиттер	0,10%	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 борыштық 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	0,30%	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 «ВВ» 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>37,88%</b>	иә
2.1	«Standard&Poor's» агенттігінің халықаралық шәкілі бойынша «ВВ» 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	21,06%	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 «ВВ» 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	7,10%	иә
2.4	«Standard&Poor's» агенттігінің халықаралық шәкілі бойынша «ВВВ» 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 «ВВ» 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	9,68%	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 «ВВВ» 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 «ВВ» төмен емес рейтинг бағасы бар немесе басқа рейтинг агенттіктерінің бірінің осыған ұқсас деңгейінің рейтингтік бағасы бар ислам қаржыландыру құралдары	0,52%	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	77 094 400 000
ҚР МБҚ	KZT	ҚР МБҚ	49 200 000 000
<b>Жиыны</b>			<b>126 294 400 000</b>

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

Құрал түрі	Валюта	Бағалы қағаз эмитенті	Мәміле сомасы теңгемен
АҚШ МБҚ	USD	АҚШ Үкіметі	218 799 785 228
Депозитарлық қолхаттар	USD	«Қазатомпром» ҰАК» АҚ	9 647 593 050
Облигациялар	KZT	«DTJ» АҚ	2 043 258 333
<b>Жиыны</b>			<b>230 490 636 611</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	194 790 660 000
ҚР МБҚ	KZT	ҚР Үкіметі	42 469 217 000
<b>Жиыны</b>			<b>237 259 877 000</b>

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

Құрал түрі	Валюта	Бағалы қағаздар эмитенті	Өтеу сомасы теңгемен
Салым	KZT	«Еуразиялық банк» АҚ	5 000 000 000
<b>Жиыны</b>			<b>5 000 000 000</b>