«БЖЗҚ» АҚ ЗЕЙНЕТАҚЫ АКТИВТЕРІН ИНВЕСТИЦИЯЛЫҚ БАСҚАРУ БОЙЫНША АҚПАРАТ

2024 жылғы 1 желтоқсандағы жағдай бойынша Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкінің (бұдан әрі – ҚРҰБ) сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ зейнетақы активтері[1] (бұдан әрі – ЗА) 21 838,31 млрд.[2] 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

млрд. теңге

Атауы	01.01.2024 жылға ағымдағы құны	01.01.2024 жылға үлесі	01.12.2024 жылға ағымдағы құны	01.12.2024 жылға үлесі	Жыл басынан өсуі/төмендеуі
ҚР ҚМ МБҚ	8 289,48	46,55%	9 018,13	41,29%	8,79%
Шетелдік мемлекеттердің МБҚ	22,36	0,13%	97,09	0,44%	334,22%
ХҚҰ	359,46	2,02%	288,49	1,32%	-19,74%
ҚР эмитенттерінің корпоративтік облигациялары	14,01	0,08%	12,08	0,06%	-13,80%
ҚР квазимемлекеттік ұйымдарының облигациялары	1 619,89	9,10%	2 006,49	9,19%	23,87%
ҚР ЕДБ облигациялары	848,05	4,76%	857,65	3,93%	1,13%
PPN (құрылымдық ноттар)	7,23	0,04%	8,40	0,04%	16,10%
ҚР эмитенттерінің акциялары және депозитарлық қолхаттары	350,53	1,97%	386,94	1,77%	10,39%
Депозиттер	197,21	1,11%	-	0,00%	-100,00%
ҚРҰБ депозиттері	876,66	4,92%	685,62	3,14%	-21,79%
Инвестициялық шоттардағы ақшалай қаражат	48,34	0,27%	18,49	0,08%	-61,75%
РЕПО операциялары	26,71	0,15%	100,13	0,46%	274,93%
Активтерді индекстік басқару, оның ішінде:	5 146,10	28,90%	8 358,83	38,28%	62,43%
дамыған елдердің активтері	1 644,24	9,23%	2 460,13	11,27%	49,62%
дамушы елдердің активтері	1 122,87	6,31%	1 349,77	6,18%	20,21%
сыртқы басқарудағы активтер	**2 378,99**	**13,36%**	4 548,92	20,83%	91,21%
дамушы елдер облигацияларының мандаты бойынша:					
Aviva Investors Global Services Limited	173,41	0,97%	259,18	1,19%	49,46%
TCW Asset Management Company LLC	-	-	127,41	0,58%	100%
PIMCO Asia Pte Ltd	-	-	223,24	1,02%	100%
ғаламдық акциялар мандаты бойынша:					
Invesco Asset Management Deutschland GmbH	170,5	0,96%	328,77	1,51%	92,83%
HSBC Global Asset Management (UK) Limited	311,96	1,75%	535,44	2,45%	71,64%
UBS Asset Management (UK) Ltd	226,16	1,27%	425,76	1,95%	88,25%
Blackrock Financial Management	176,62	0,99%	374,82	1,72%	112,22%
BlackRock Investment Management	116,41	0,65%	217,36	1,00%	86,72%

[1] *Міндетті зейнетақы жарналары, міндетті кәсіптік зейнетақы жарналары және ерікті зейнетақы жарналары есебінен қалыптастырылған*

[2] *зейнетақы жарналары мен төлемдері шоттарындағы ақшаны есепке алмағанда*

Robeco Institutional Asset Management B.V.	219,38	1,23%	334,94	1,53%	52,67%
инвестициялық деңгейдегі корпоративтік облигациялар мандаты бойынша:					
Principal Global Investors (Europe) Limited	489,75	2,75%	589,75	2,70%	20,42%
PGIM Limited	494,79	2,78%	599,30	2,74%	21,12%
PIMCO Asia Pte Ltd	-	-	532,97	2,44%	100%
ҚРҰБ басқаруындағы ЗА жиынтығы	**17 806,03**	**100,00%**	**21 838,31**	**100,00%**	**22,65%**
Зейнетақы жарналары мен төлемдері шоттарындағы ақша	38,97		5,23		
Зейнетақы активтерінің жиынтығы	**17 845,01**		**21 843,55**		

БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфеліндегі борыштық қаржы құралдарын өтеуге орташа алынған кірістілік (YTM) 01.12.2024 жылғы жағдай бойынша жылдық 10,05% құрады, оның ішінде теңгеге номинирленген – жылдық 11,55%, шетелдік валютада – жылдық 4,92%.

Қазақстан Республикасы Қаржы министрлігінің мемлекеттік бағалы қағаздары

БЖЗҚ ЗА портфелінде негізгі үлесті ҚР Қаржы министрлігінің МБҚ құрайды, олардың есептік айдағы ағымдағы құны 75,95 млрд. теңгеге ұлғайды және 9 018,13 млрд. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 41,29% құрады.

Қарастырылып отырған кезеңде орташа алынған кірістілігі жылдық 13,20% құрайтын номиналды құны бойынша 48,00 млрд.теңге көлемінде ҚР Қаржы министрлігінің МБҚ сатып алынды, сондай-ақ 21,92 млрд.теңге көлемінде ҚР МБҚ бөлігі сатылды.

Есептік күнге ҚР Қаржы министрлігінің МБҚ бойынша өтеуге орташа алынған кірістілік жылдық 11,59% құрады.

Өтімділіктің қосалқы портфеліндегі шетелдік мемлекеттердің мемлекеттік бағалы қағаздары

Есептік ай үшін өтімділіктің қосалқы портфеліндегі шетелдік мемлекеттердің мемлекеттік бағалы қағаздарының ағымдағы құны 440,11 млрд. теңгеге азайды және 97,09 млрд. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 0,44% құрады.

Қарастырылып отырған кезеңде орташа алынған кірістілігі жылдық 4,62% құрайтын номиналды құны бойынша 68,45 млрд.теңге көлемінде АҚШ МБҚ сатып алынды.

Есептік айда 301,85 млрд.теңге көлемінде АҚШ МБҚ сатылды, сондай-ақ 217,75 млрд.теңге көлемінде АҚШ МБҚ өтелді.

Есептік күнге БЖЗҚ ЗА валюталық портфелінің өтімділіктің қосалқы портфеліндегі шетелдік мемлекеттердің МБҚ өтеуге орташа алынған кірістілігі жылдық 4,41% құрады.

Халықаралық қаржы ұйымдарының облигациялары

Есептік айда халықаралық қаржы ұйымдары облигацияларының ағымдағы құны 62,66 млрд. теңгеге азайды және 288,49 млрд. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 1,32% құрады.

Есептік айда 60,00 млрд.теңге көлемінде ЕҚДБ облигациялары өтелді.

Халықаралық қаржы ұйымдарының бағалы қағаздары сатып алынбады және сатылмады.

Халықаралық қаржы ұйымдарының облигацияларын өтеуге орташа алынған кірістілік теңгеге номинирленген сыйақының белгіленген мөлшерлемесімен жылдық 12,26%, сыйақының индекстелген мөлшерлемесі – инфляция және сыйлықақы құрады.

Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банктеріндегі депозиттер

Есептік айда 20,00 млрд.теңге көлемінде «Kaspi Bank» АҚ депозиттері өтелді. Есептік айда ҚР ЕДБ салымдары орналастырылмады.

ҚР Ұлттық Банкіндегі депозиттер

Есептік күнге ҚР Ұлттық Банкіндегі депозиттердің ағымдағы құны 685,62 млрд.теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 3,14%.

Есептік айда ағымдағы өтімділікті басқару аясында зейнетақы активтері бойынша табыстылықты ұстап тұру мақсатында ҚР Ұлттық Банкінің депозиттеріне инвестиция салынды. Мәмілелердің орташа көлемі жылдық 13,88% орташа алынған кірістілікпен 161,40 млрд. теңгені құрады.

Қазақстан Республикасы эмитенттерінің корпоративтік облигациялары

ҚР эмитенттерінің корпоративтік облигацияларының ағымдағы құны 12,08 млрд. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 0,06% құрады.

Есептік айда 99,98 млрд.теңге көлемінде «Қазақстан Халық Банкі» АҚ облигациялары өтелді. ҚР эмитенттерінің корпоративтік облигациялары сатып алынбады және сатылмады.

Қазақстан Республикасы квазимемлекеттік ұйымдардың облигациялары

Есептік айда ҚР квазимемлекеттік ұйымдардың облигацияларының ағымдағы құны 66,68 млрд. теңгеге ұлғайды және 2 006,49 млрд. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 9,19% құрады.

Қарастырылып отырған кезеңде орташа алынған кірістілік жылдық 13,89% құрайтын номинал құны бойынша 50,00 млрд.теңге көлемінде «Бәйтерек» ҰБХ» АҚ облигациялары сатып алынды. ҚР квазимемлекеттік ұйымдарының бағалы қағаздары 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 92,62 млрд.теңгеге азайды және 857,65 млрд.теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 3,93% құрады.

Қарастырылып отырған кезеңде 99,98 млрд.теңге көлемінде «Қазақстан Халық Банкі» АҚ облигациялары өтелді. ҚР ЕДБ облигациялары сатып алынбады және сатылмады.

Есептік күнге ҚР ЕДБ облигациялары бойынша өтеуге орташа алынған кірістілік жылдық 10,48% құрады.

Шетелдік эмитенттердің PPN (құрылымдық ноттары)

Есептік айда шетелдік эмитенттердің PPN (құрылымдық ноттар) ағымдағы құны 8,40 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 3,59 млрд. теңгеге ұлғайды және 386,94 млрд. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 1,77% құрады.

Қарастырылып отырған кезеңде 14,48 млрд.теңге көлемінде «Қазатомпром» ҰАК» АҚ депозитарлық қолхаттарының бөлігі 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 395,23 млрд.теңгеге ұлғайды және 2 460,13 млрд.теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 11,27%. Есептік кезеңде 600,00 млн. АҚШ доллары көлемінде БЖЗҚ зейнетақы активтерінің бөлігі дербес басқарудағы дамыған елдердің облигацияларының субпортфеліне аударылды.

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 желтоқсандағы аталған индекстің құрамына облигациялардың 205 шығарылымы кіреді.

Дамушы елдер облигацияларының субпортфелі

Есептік айда дамушы елдер облигациялары субпортфелінің ағымдағы құны 111,61 млрд.теңгеге ұлғайды және 1 959,60 млрд.теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 8,97%. Есептік кезеңде TCW Asset Management Company LLC басқаруына 100,00 млн. АҚШ доллары сомасына БЖЗҚ зейнетақы активтерінің бөлігі тапсырылды.

Дамушы елдер облигацияларының субпортфелі үшін эмитенттері «BB» 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 желтоқсандағы аталған индекстің құрамына 29 дамушы елдер шығарған АҚШ долларына номиналданған облигациялардың 420 шығарылымы кіреді.

Корпоративтік облигациялардың субпортфелі

Есептік айда корпоративтік облигациялары субпортфелінің ағымдағы құны 187,37 млрд.теңгеге ұлғайды және 1 722,02 млрд.теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 7,89%. Есептік кезеңде PIMCO Asia Pte Ltd басқаруына 300,00 млн. АҚШ доллары сомасына БЖЗҚ зейнетақы активтерінің бөлігі тапсырылды.

Корпоративтік облигацияларының субпортфелі үшін эмитенттері «BBB» 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 желтоқсандағы аталған индекстің құрамына 1 311 эмитент шығарған облигациялардың 7 464 шығарылымы кіреді.

Акциялардың субпортфелі

Есептік айда акциялардың субпортфелінің ағымдағы құны 59,60 млрд.теңгеге ұлғайды және 2 217,08 млрд.теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 10,15%.

Акциялардың субпортфелі үшін әлемнің дамыған елдері компанияларының акцияларынан тұратын Custom MSCI World Index индекс эталон портфель болып табылады. 2024 жылғы 1 желтоқсандағы аталған индекстің құрамына 23 дамыған елдерге жататын жоғары және орташа капитализациясымен компаниялардың 1 354 акциясы кіреді. Индекстің 72,7% 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 АҚШ доллары сатып алынбады.

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

млрд. теңге

Валюта	01.01.2024 жылға ағымдағы құны	01.01.2024 жылға үлесі	01.12.2024 ж. ағымдағы құны	01.12.2024 ж. үлесі	Жыл басынан өсуі/төмендеуі
Ұлттық валюта	12 161,38	68,30%	13 099,36	59,98%	7,71%
АҚШ доллары	5 639,89	31,67%	8 737,62	40,01%	54,93%
Басқа валюталар	4,76	0,03%	1,34	0,01%	-71,94%
Жиыны:	**17 806,03**	**100,00%**	**21 838,31**	**100,00%**	**22,65%**

Инвестициялық қызметтің нәтижелері

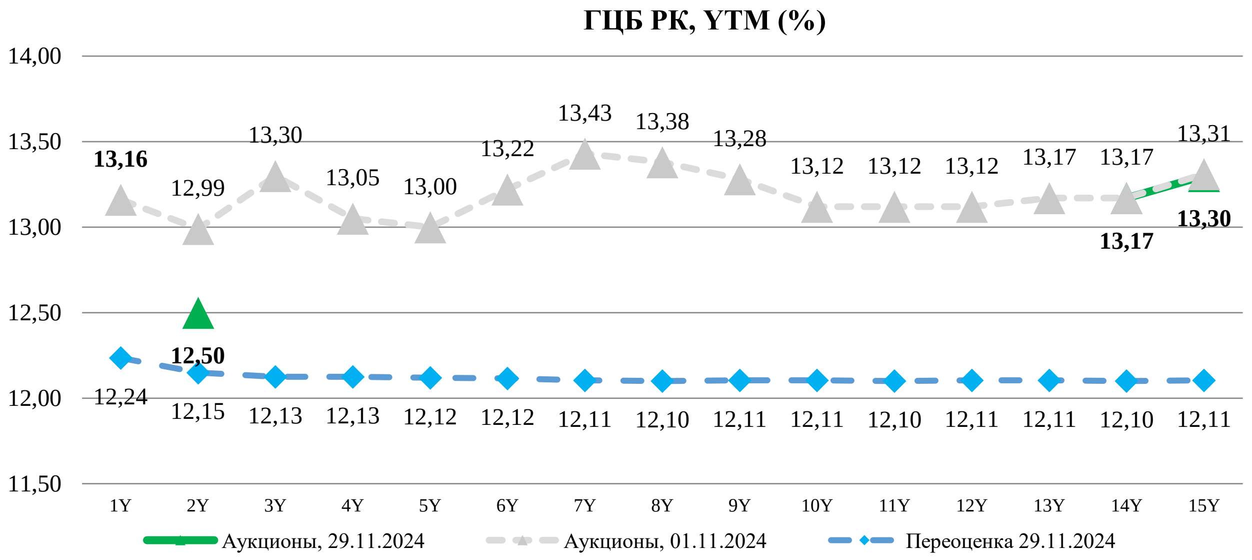
Инвестициялық қызметтің нәтижесінде, сондай-ақ шетелдік валюталар бағамының құбылмалылығы және қаржы құралдарының нарықтық құнының өзгеруі салдарынан 2024 жылдың басынан бері есептелген инвестициялық кіріс көлемі 2,82 трлн. теңгені құрады.

2024 жылғы 1 желтоқсандағы жағдай бойынша салымшылардың (алушылардың) шоттарына бөлінген соңғы 12 ай үшін БЖЗҚ зейнетақы активтерінің кірістілігі инфляция 8,40% болғанда 16,97% құрады. 2024 жылдың басынан бастап салымшылардың (алушылардың) шоттарына бөлінген БЖЗҚ зейнетақы активтерінің кірістілігі 14,85% құрады.

2024 жылғы қарашада АҚШ-тағы президенттік сайлауда Дональд Трамптың және Сенат пен Өкілдер палатасына сайлауда республикашылдардың жеңісі аясында нарық құбылмалылықты көрсетті. Бұл ретте АҚШ-тың Федералды резервтік жүйесі 5,00%-дан 4,75%-ға дейін базалық мөлшерлемені 25 базалық тармаққа төмендету туралы шешім қабылдады. Нарық 2024 жылдың соңына қарай мөлшерлеменің тағы 25 базалық тармаққа төмендеуін күтуде. Америка Құрама Штаттарындағы инфляцияның динамикасы қарашада шамалы өсуді көрсетті – қазандағы жылдық 2,6%-ға қарсы жылдық 2,7%, ал айлық инфляция қазандағы 0,2%-дан қарашада 0,3%-ға дейін өсті. Қараша айында ауылшаруашылық емес сектордағы жұмыс орындарының саны 227 мың жұмыс орнына айтарлықтай өсуді көрсетті, ал жұмыссыздық деңгейі қазандағы 4,1%-дан қарашада 4,2%-ға көтерілді.

Нәтижесінде қарашада АҚШ-тың 10 жылдық қазынашылық нотасының кірістілігі 12 базалық тармаққа төмендеді. Дамушы нарықтағы облигациялардың спрэдтері өзгеріссіз қалды, ал корпоративтік облигациялардың спрэдтері 6 базалық тармаққа қысқарды. Бұл ретте MSCI World акцияларының индексі 4,47%-ға өсті.

Қарашадағы Қазақстан Республикасының мемлекеттік бағалы қағаздарын орналастыру бойынша аукциондарда ҚРҰБ базалық мөлшерлемені 14,25% деңгейінде ұстап тұру туралы шешімі аясында қысқа мерзімді орналастырулар бойынша кірістілік төмендеді. Бұл ретте қарашада инфляция жылдық 8,4%-ға (қазанда 8,5%) немесе қарашада 0,9%-ға (қазанда 0,9%) баяулады. Қазақстан Республикасының мемлекеттік бағалы қағаздарының аукциондарында орташа сұраныс ұсыныстан 2 есе асып түсті, мұнда негізгі сұраныс Қазақстан Республикасының қысқа мерзімді мемлекеттік бағалы қағаздарын орналастыруға шоғырланған. Бұл ретте ҚР ҚМ қарыз алу көлемінің қазандағы 600 млрд теңгеден қарашадағы 57 млрд теңгеге дейін төмендеуі байқалады.



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	1433,06
Бағалы қағаздарды нарықтық қайта бағалаудан кірістер (шығындар)	65,37
Шетелдік валютаны қайта бағалаудан кірістер (шығындар)	471,14
Сыртқы басқарудағы активтер бойынша кірістер (шығындар)	840,10
Басқа кірістер (шығындар)	6,22
Жиыны:	**2 815,887**

Инвестициялық декларация параметрлерін сақтау туралы ақпарат

Сенімгерлік басқарудағы БЖЗҚ ЗА құрылымдық үлестіруі БЖЗҚ Инвестициялық декларациясының[3] талаптарына сәйкес келеді. Валюталық позициялар үлесі рұқсат етілген деңгей шегінде қалады және БЖЗҚ Инвестициялық декларациясының талаптарын бұзбайды. 2024 жылғы 01 желтоқсандағы 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)
	KZT ақшалай қаражаты	0,00%	иә
	Шетелдік валютадағы ақшалай қаражат	**0,66%**	**иә**
1	**Қазақстандық қаржы құралдары:**	**58,96%**	**иә**
1.1	Қазақстан Республикасы Қаржы Министрлігі, Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкі шығарған Қазақстан Республикасының мемлекеттік бағалы қағаздары	41,29%	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	3,14%	иә
1.3	Квазимемлекеттік сектор субъектілерінің бағалы қағаздары	10,51%	иә

[3] *Қазақстан Республикасы Ұлттық Банк Басқармасының 2023 жылғы 23 қазандағы № 82 қаулысымен бекітілген БЖЗҚ Инвестициялық декларациясы*

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:	3,70%	иә
1)	реттелген борыштық бағалы қағаздарды қоспағанда, борыштық бағалы қағаздар	3,62%	иә
2)	үлестік бағалы қағаздар	0,08%	иә
3)	депозиттер	0,00%	иә
1.5	«Standard&Poor's» агенттігінің халықаралық шәкілі бойынша «В-» төмен емес бағалы қағаздар және/немесе эмитент рейтингі бағасы бар немесе басқа рейтинг агенттіктерінің бірінің осыған ұқсас деңгейінің рейтингтік бағасы бар Қазақстан Республикасының квазимемлекеттік секторы мен екінші деңгейдегі банктері субъектілерінің борыштық бағалы қағаздарын қоспағанда мемлекеттік емес борыштық бағалы қағаздары	0,00%	иә
1.5.1	Қазақстан Республикасы Үкіметінің кепілдігі және/немесе кепілдемесімен шығарылған мемлекеттік емес борышты бағалы қағаздары	0,00%	иә
1.6	Квазимемлекеттік сектор субъектілерінің және Қазақстан Республикасы Екінші деңгейдегі банктерінің инвестициялау сәтіндегі Қазақстан Республикасы қор биржасының ресми тізімінің "Премиум" санатына кіретін немесе оған ұқсас не нарықтық капиталдандырылуы үш триллион АҚШ долларынан асатын әлемдік қор биржаларында листингі бар үлестік емес үлестік бағалы қағаздарды қоспағанда, мемлекеттік емес үлестік бағалы қағаздар	0,31%	иә
1.7	Қазақстан Республикасы қор биржасының және (немесе) "Астана" халықаралық қаржы орталығының аумағында жұмыс істейтін қор биржасындағы ресми тізіміне енгізілген исламдық қаржыландыру құралдары	0,00%	иә
1.8	«Standard&Poor's» агенттігінің халықаралық шәкілі бойынша «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	**Шетелдік қаржы құралдары, оның ішінде шетелдік қаржы нарықтарында айналымда жүрген құралдар:**	**38,08%**	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	20,20%	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	7,75%	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	10,09%	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	0,53%	иә

№	Қаржы құралының түрі	Нақты мәні (ЗА 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	68 447 400 000
ҚР МБҚ	KZT	ҚР МБҚ	48 000 000 000
Облигациялар	KZT	«Бәйтерек» ҰБХ» АҚ	50 000 000 000
Жиыны			**166 447 400 000**

6-кесте. Есептік айда қаржы құралдарын сату бойынша мәліметтер

Құрал түрі	Валюта	Бағалы қағаз эмитенті	Мәміле сомасы теңгемен
АҚШ МБҚ	USD	АҚШ Үкіметі	301 850 729 258
ҚР МБҚ	KZT	ҚР МБҚ	21 915 940 667
Депозитарлық қолхаттар	USD	«Қазатомпром» ҰАК» АҚ	14 475 530 845
Жиыны			**338 242 200 770**

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	217 753 800 000
ЕДБ облигациялары	KZT	«Қазақстан Халық Банкі» АҚ	99 980 000 000
ХБҚ (ХҚҰ)	KZT	ЕҚДБ	60 000 000 000
Жиыны			**377 733 800 000**

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

Құрал түрі	Валюта	Бағалы қағаздар эмитенті	Өтеу сомасы теңгемен
Салым	KZT	«Kaspi Bank» АҚ	20 000 000 000
Жиыны			**20 000 000 000**