

Инвестициялау мақсаты

Зейнетақы активтерінің сақталуын және ықтималдығы жоғары деңгейдегі зейнетақы активтері құнының сақталуын қамтамасыз етуге мүмкіндік беретін тәуекел деңгейі кезінде ұзақ мерзімді келешекте нақты табыс алуды қамтамасыз ету

Портфель параметрлері

Негізгі валюта: Қазақстан теңгесі

Зейнетақы активтерінің инвестициялық портфель құны – 17 209 776 449 мың теңге

ИПБ зейнетақы активтері бойынша инвестициялық қызметі 01.04.2021ж. бастап қарастырылды.

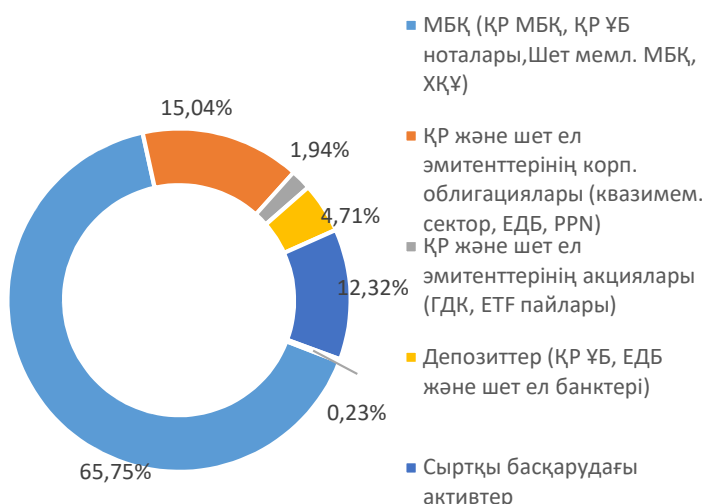
Halyk Finance зейнетақы активтері бойынша ИПБ инвестициялық қызметін 15.12.2022ж. бастады

Сенімгерлік басқаруыға берілген зейнетақы активтері:

	ЗА Активтері, млрд теңге, 01.11.23ж.	Инвестициялық табыс, млрд теңге 01.01.22ж-дан бастап.	ЗА кірістілігі, % 01.01.22ж.- дан бастап
BCC Invest	2,13	0,16	10,24%
Halyk Global Markets	2,79	0,36	14,17%
Jusan Invest	4,70	0,38	9,01%
Сентрас Секьюритиз	0,94	0,08	7,89%
Halyk Finance	2,73	0,07	12,74%
ҚР Ұлттық Банкі	17 196,49	1 257,56	7,98%

«БЖЗҚ» АҚ зейнетақы активтерінің инвестициялық портфеліне шолу¹

Зейнетақы активтері порфелінің құрылымы, %

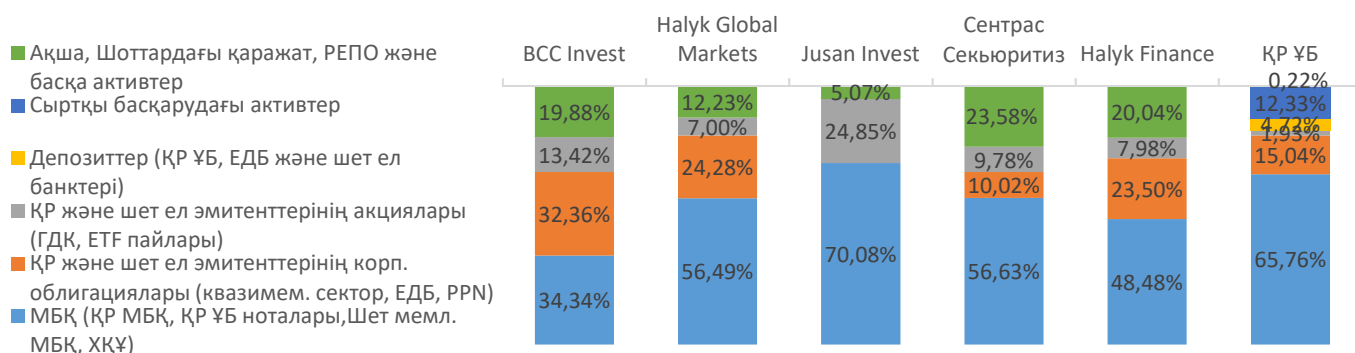


Инвестициялық қызмет нәтижесі

Инвестициялық қызмет нәтижесінде, сондай-ақ шетелдік валюта бағамының және қаржы құралдарының нарықтық құнының өзгеруі салдарынан 01.01.2023 жылдан бастап 30.10.2023 жылға дейінгі кезеңге есептелген инвестициялық кіріс мөлшері 1 258,62 млрд теңгені құрады, оның ішінде:

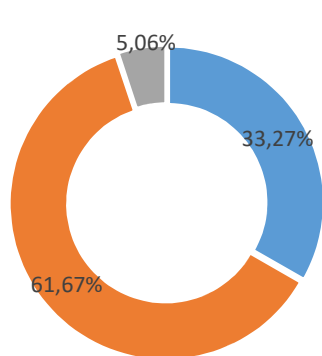
Атауы	инвестициялық кіріс млрд. теңге
Бағалы қағаздар бойынша (оның ішінде орналастырылған салымдар және «кері РЕПО» операциялары) сыйақы түріндегі және нарықтық қайта бағалаудан түскен кірістер	1 094,78
Шетел валютасын қайта бағалаудан түскен кірістер (шығындар)	59,29
Сыртқы басқарудан түскен кірістер (шығындар)	100,25
Басқа кірістер (шығындар)	4,29
Жиынтығы:	1 258,62

Сенімгерлік басқарудағы компаниялар бойынша зейнетақы активтері портфелінің құрылымы, %

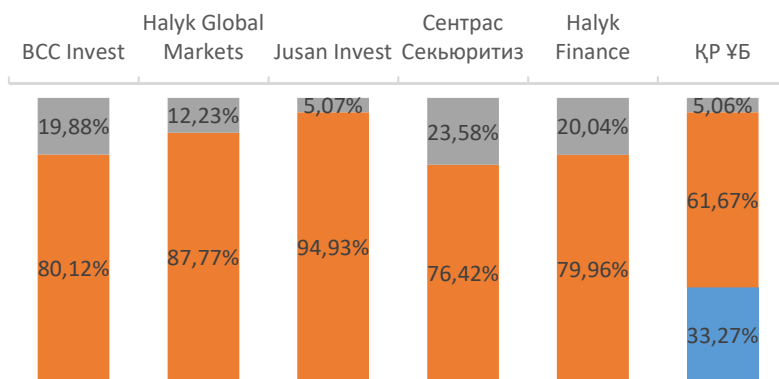


¹ Материалдар АО «BCC Invest» (14.11.23 жылғы шығыс №0952/23 хат), АО «Halyk Global Markets» (07.11.2023 жылғы шығыс №071123/1 хат), АО «Jusan Invest» (15.11.2023 жылғы шығыс №05/693 хат), АО «Сентрас Секьюритиз» (сайттан), АО «Halyk Finance» (07.11.2023 жылғы шығыс №09-21916 хат), НБРК (20.11.2023 жылғы шығыс №05-4-02/611 хат)

Сенімгерлік басқарудағы компаниялардың бағалы қағаздарды есепке алу санаты бойынша зейнетақы активтері портфелінің құрылымы, %

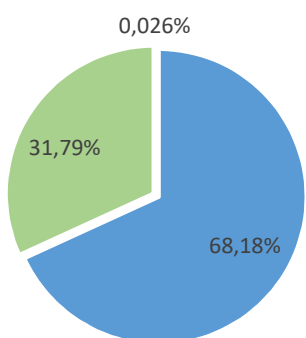


- Амортизацияланған құны бойынша бағаланатын қаржы құралдары
- Әділ құны бойынша бағаланатын қаржы құралдары
- Шоттардағы қаражат, РЕПО, Депозит, Басқалар

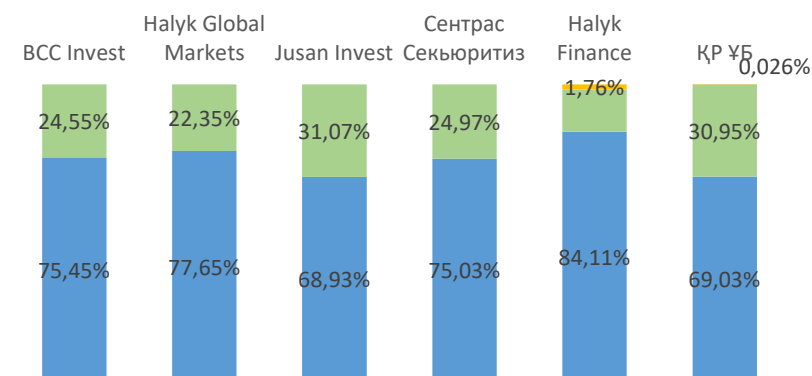


БЖЗҚ инвестициялық портфелінің зейнетақы активтерінің 33,27% - ын амортизацияланған құны бойынша ескерілетін бағалы қағаздар құрайды. Әділ құны бойынша бағаланатын есепке алу санатындағы бағалы қағаздардың үлес салмағы зейнетақы активтерінің 61,67% - ын құрады. Ақша қаражаты, РЕПО бойынша операциялар, Депозиттер және өзгелері қалған бөлікті - 5,06% құрайды.

Сенімгерлік басқарудағы компаниялар бойынша валюталар бөлігіндегі зейнетақы активтері портфелінің құрылымы, %

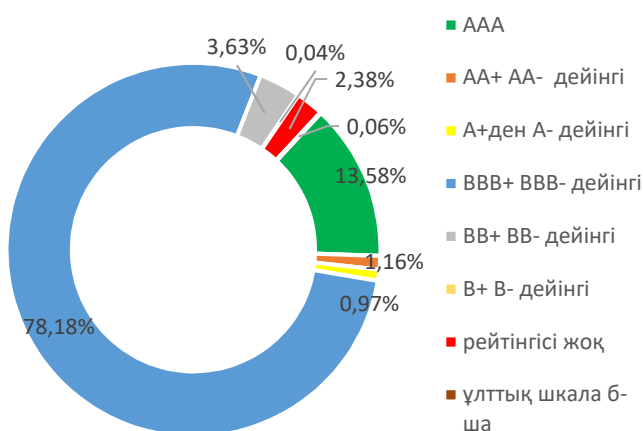


- Ұлттық валюта
- АҚШ доллары
- Ресей рублі
- Басқа валюталар

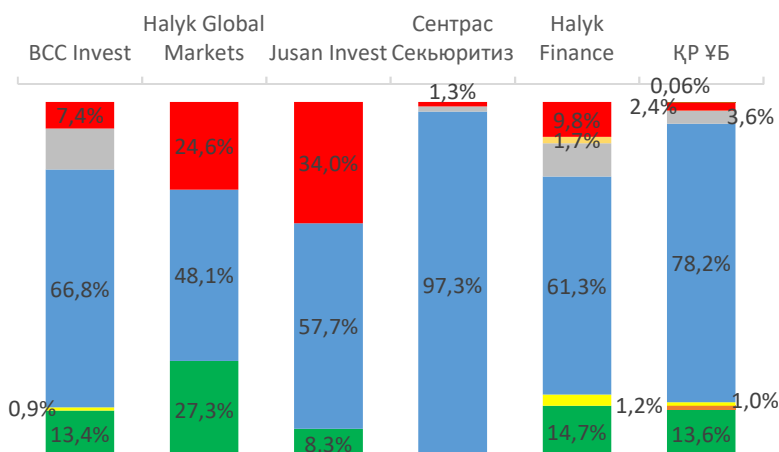


NBRK Инвестициялық декларациясында белгіленген ENPF сенімгерлік басқарудағы зейнетақы активтерінің валюталық портфелін нысаналы бөлуге сәйкес жыл 01.11.2023 жағдай бойынша индекстік инвестициялау шеңберінде шетелдік басқарушы компаниялардың сыртқы басқаруындағы активтер 2 120,81 млрд. теңгені (инвестициялық портфельдің 12,32% және доллар құралдарының 39,83%) құрайды.

Сенімгерлік басқарудағы компаниялардың кредиттік сапа бойынша зейнетақы активтері портфелінің құрылымы, %



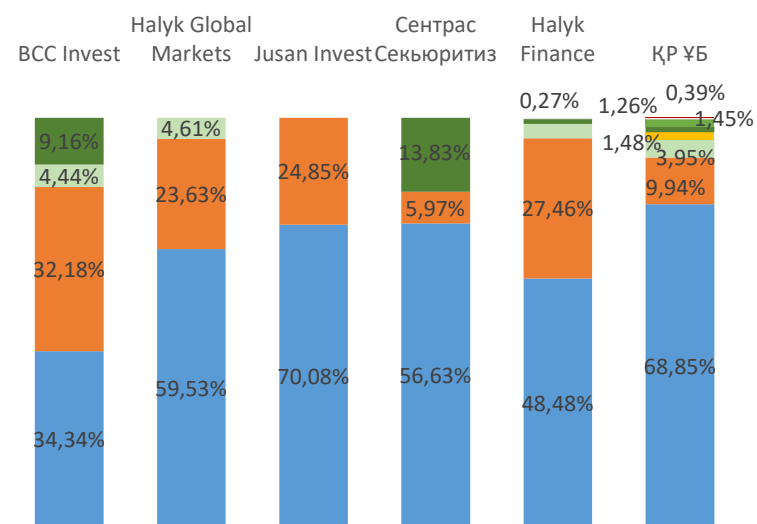
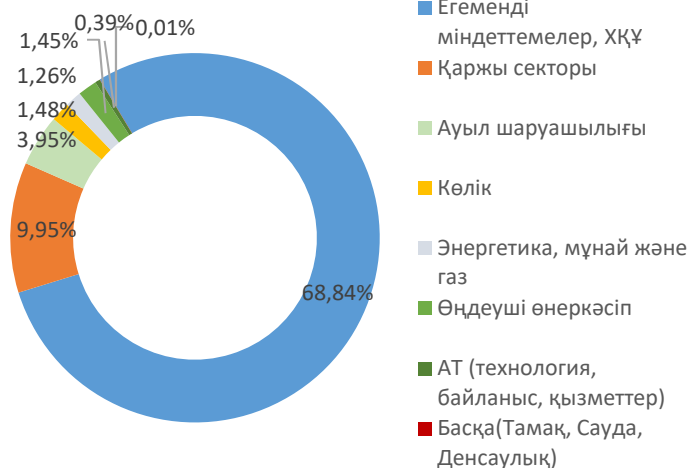
- AAA
- AA+ AA- дейінгі
- A+ден A- дейінгі
- BB+ BB- дейінгі
- BB+ BB- дейінгі
- V+ V- дейінгі
- рейтингісі жоқ
- ұлттық шкала б-ша



Халықаралық шәкіл бойынша «AAA»-дан «BBB»-дейінгі бағалы қағаздар/эмитент рейтингісі бар барынша төмен тәуекел деңгейдегі қаржы құралдары инвестициялық портфельдің **93,90%**-ын құрайды. Халықаралық шәкіл бойынша «BB+»-дан «B-» дейінгі және ұлттық шәкіл бойынша «kzBB+» рейтингісі бар қаржы құралдары **3,72%**-ды құрайды. Рейтингтік бағасы жоқ қаржы құралдардың үлесі - **2,38%**.

² Сыртқы басқарудағы активтер, шоттардағы қалдық, жолдағы ақша және пай қорларын қоспағанда.

Сенімгерлік басқарудағы компаниялар бойынша экономика секторы бөлігіндегі зейнетақы активтері портфелінің құрылымы, %



* –сыртқы басқарудағы активтер, дебиторлық берешек және ақша нарығының құралдары есепке алынбады.

Сенімгерлік басқарудағы компаниялар бойынша елдер бөлігіндегі зейнетақы активтері портфелінің құрылымы, %

Мемлекет/Басқарушы	BCC Invest	Halyk Global Markets	Jusan Invest	Сентрас Секьюритиз	Halyk Finance	ҚР ҰБ
АҚШ	20,39%	14,59%	30,89%	0,96%	12,59%	9,69%
ХҚҰ	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	2,04%
Индонезия	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	1,00%
Мексика	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,80%
Филиппины	2,97%	5,14%	0,00%	0,00%	0,69%	0,65%
Катар	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,52%
Сауд Арабиясы	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,50%
Колумбия	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,45%
Панама	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,40%
Оман	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,27%
Румыния	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,26%
Швеция	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,24%
БАӘ	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,20%
Марокко	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,16%
Ресей	1,23%	4,50%	0,00%	0,00%	0,00%	0,15%
Жапония	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,13%
Кувейт	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,13%
Перу	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,12%
Польша	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,11%
Чили	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,09%
Израиль мемлекеті	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,07%
Венгрия	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,06%
Бразилия	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,05676%
Бермуды	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,0005%
Нидерланды	0,00%	3,04%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00024%
Финляндия	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	1,49%	0,00004%
Барлығы	0,00%	28,88%	38,23%	1,05%	29,29%	19,17%