

«БЖЗҚ» АҚ ЗЕЙНЕТАҚЫ АКТИВТЕРІН ИНВЕСТИЦИЯЛЫҚ БАСҚАРУ БОЙЫНША АҚПАРАТ

2018 жылғы 1 тамыздағы жағдай бойынша Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкінің басқаруындағы (бұдан әрі – ҚРҰБ) БЖЗҚ зейнетақы активтері (бұдан әрі – ЗА) 8 576,23 млрд. теңгені¹ 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	01.01.2018 жылға ағымдағы құны	01.01.2018 жылға үлесі	01.08.2018 жылға ағымдағы құны	01.08.2018 жылға үлесі	Жыл басынан өсуі/төмендеуі
ҚР МБҚ	3 587,63	46,14%	4 071,71	47,48%	13,49%
Шетелдік мемлекеттердің МБҚ	948,84	12,20%	964,87	11,25%	1,69%
ХҚҰ	172,55	2,22%	160,49	1,87%	-6,99%
ҚР эмитенттерінің корпоративтік облигациялары	58,30	0,75%	54,70	0,64%	-6,18%
ҚР квазимемлекеттік ұйымдардың облигациялары	791,68	10,18%	699,24	8,15%	-11,68%
ҚР ЕДБ облигациялары	1 246, 49	16,03%	1 188,83	13,86%	-4,63%
Шетелдік эмитенттердің корпоративтік облигациялары	9,35	0,12%	9,48	0,11%	1,35%
Квазимемлекеттік сектордың шетелдік эмитенттердің облигациялары	53,39	0,69%	135,23	1,58%	153,26%
PPN (құрылымдық ноттар)	35,00	0,45%	29,25	0,34%	-16,42%
ҚР эмитенттерінің акциялары және депозитарлық қолхаттары	184,14	2,37%	156,46	1,82%	-15,03%
Шетелдік эмитенттердің акциялары және депозитарлық қолхаттары	23,68	0,30%	23,14	0,27%	-2,29%
Депозиттер	325,82	4,19%	306,11	3,57%	-6,05%
ҚРҰБ-дағы депозиттер	-	-	13,90	0,16%	
Шетелдік банктердегі депозиттер	277,41	3,57%	572,53	6,68%	106,38%
РЕПО	11,02	0,14%	-	0,00%	
Инвестициялық шоттардағы ақшалай қаражат (ҚҚ-мен мәмілелер бойынша міндеттемелер шегерілген)	20,88	0,27%	97,50	1,14%	
Басқа активтер (дебиторлық берешек ² , мерзімі өткен берешек, провизиялар)	28,62	0,37%	17,42	0,20%	-39,12%
Aviva Investors Global Services Limited* сыртқы басқаруындағы активтер	-	-	75,37	0,88%	
ҚРҰБ басқаруындағы ЗА жиынтығы	7 774,82	100,00%	8 576,23	100,00%	10,31%
Жасалған мәмілелер бойынша есеп айырысу үшін инвестициялық шоттардағы ақша қаражаты			7,12		
Зейнетақы жарналары мен төлемдері шоттарындағы ақша	9,51		2,30		
Зейнетақы активтерінің жиыны	7 784,33		8 585,65		10,29%

* - «Дамушы нарықтардың жаһандық облигациялары» мандатының аясында

БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфеліндегі борыштық қаржы құралдарын өтеуге орташа алынған кірістілік (ҮТМ) 01.08.2018 жылғы жағдай бойынша жылдық 6,9% құрады, оның ішінде теңгеге номинирленген – жылдық 8,3%, шетелдік валютада – жылдық 3,7%.

¹ Зейнетақы жарналары мен төлемдері шоттарындағы ақша есебінсіз.

² Дебиторлық берешекке қаржы құралдары шығарылымы проспектісінің талаптарына сәйкес эмитент тарапынан берешекті өтеу күні келіп жеткен сыйақы және/немесе негізгі борыш бойынша алынатын сома кіреді.

Қазақстан Республикасының мемлекеттік бағалы қағаздары

БЖЗҚ ЗА портфелінде негізгі үлесті ҚР МБҚ құрайды, олардың есептік айдағы ағымдағы құны 121,83 млрд. теңгеге ұлғайды және 4 071,71 млрд. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 47,48% құрады.

Есептік кезеңде мынадай қаржы құралдары сатып алынды:

- 1 274,64 млрд. теңге көлеміндегі ҚРҰБ қысқа мерзімді дисконт ноттарының орташа алынған кірістілігі жылдық 8,14%;
- 93,00 млрд. теңге көлеміндегі теңгеге номинирленген ҚР Қаржы министрлігінің МБҚ-ның орташа алынған кірістілігі жылдық 8,44%.

Есептік кезеңде 1 236,83 млрд. теңге сомасына және 1,28 млрд. теңге сомасына сәйкесінше ҚРҰБ-тың дисконт ноттары өтелді және сатылды.

Есептік күнге теңгеге номинирленген ҚР МБҚ бойынша өтеуге орташа алынған кірістілік жылдық 7,3%, АҚШ долларымен – жылдық 4,4% құрады.

Шетелдік мемлекеттердің мемлекеттік бағалы қағаздары

Есептік ай үшін шетелдік мемлекеттердің мемлекеттік бағалы қағаздарының ағымдағы құны 101,62 млрд. теңгеге ұлғайды және 964,87 млрд. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 11,25% құрады.

Есептік кезеңде жылына 2,00% орташа өлшенген табыстылықпен номинал құны бойынша 218,40 млрд. теңге көлемінде қысқа мерзімді АҚШ МБҚ, сондай-ақ жылына 5,24% орташа өлшенген табыстылықпен номинал құны бойынша 13,47 млрд. теңге көлемінде ұзақ мерзімді Ресей МБҚ сатып алынды.

Есептік кезеңде 145,66 млрд. теңге сомасына шетелдік мемлекеттердің мемлекеттік бағалы қағаздары өтелді.

Қарастырылып отырған кезеңде шетелдік мемлекеттердің мемлекеттік бағалы қағаздары сатылмады.

Есептік күнге БЖЗҚ ЗА портфеліндегі шетелдік мемлекеттердің МБҚ өтеуге орташа алынған кірістілігі жылдық 3,5% құрады.

Халықаралық қаржы ұйымдарының облигациялары

Есептік айда Халықаралық қаржы ұйымдары облигацияларының ағымдағы құны 0,57 млрд. теңгеге ұлғайды және 160,49 млрд. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 1,87% құрады.

Есептік кезеңде Халықаралық қаржы ұйымдарының облигацияларын сату, сатып алу және өтеу болған жоқ.

Халықаралық қаржы ұйымдарының облигацияларын өтеуге орташа алынған кірістілік теңгеге номинирленген жылдық 6,7% құрады, АҚШ долларына номинирленгені – жылдық 5,0% құрады.

Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банктеріндегі депозиттер

Орташа алынған өтеу мерзімі 5,2 жыл болатын ҚР ЕДБ салымдарының ағымдағы құны есептік айда 7,29 млрд. теңгеге кеміді және 306,11 млрд. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 3,57% құрады.

Есептік кезеңде сомасы 8,24 млрд.теңге ҚР ЕДБ салымдары мерзімінен бұрын өтелді. Есептік кезеңде БЖЗҚ ЗА ЕДБ салымдарға орналастырылмады.

Есептік күнге ҚР ЕДБ салымдарын өтеуге орташа алынған кірістілік жылдық 10,2% құрады.

Шетелдік банктердегі депозиттер

Орташа алынған өтеу мерзімі 1,49 ай болатын есептік айда шетелдік банктердегі салымдардың ағымдағы құны 31,07 млрд. теңгеге ұлғайды және 572,53 млрд. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 6,68% құрады.

Есептік айда орташа алынған кірістілігі жылдық 2,36% шетелдік банктерге 181,06 млрд. теңге сомасына салымдар салынды. Есептік кезеңде 160,72 млрд. теңге сомасына салым өтелді.

Есептік күнде шетелдік банктердегі салымдарды өтеуге орташа алынған кірістілік жылдық 2,4% құрады.

ҚР Ұлттық Банкіндегі депозиттер

ҚР Ұлттық Банкіндегі депозиттердің ағымдағы құны 13,90 млрд. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 0,16%.

Есептік айда ағымдағы өтімділікті басқару аясында зейнетақы активтері бойынша табыстылықты ұстап тұру мақсатында жылына 8,0% орташа өлшенген табыстылықпен 202,50 млрд. теңге сомасына ҚР Ұлттық Банкінің бір күндік депозиттеріне инвестиция салынды. Есептік кезеңде 188,60 млрд. теңге сомасына депозиттер өтелді.

Есептік күнде ҚР Ұлттық Банкіндегі салымдарды өтеуге орташа өлшенген табыстылық – жылына 8,0%.

Қазақстан Республикасы эмитенттерінің корпоративтік облигациялары

Есептік айда ҚР эмитенттерінің корпоративтік облигацияларының ағымдағы құны 6,44 млрд. теңгеге азайды және 54,70 млрд. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 0,64% құрады.

Есептік айда «AMF Group» АҚ облигациялары бойынша айналым мерзімі аяқталды. Аталған облигацияларды шығару проспектісіне сай 0,73 млрд. теңге сомасындағы төлем 26.07.2018ж. бастап 07.09.2018ж. дейінгі кезеңде күтілуде.

Есептік кезеңде ҚР эмитенттерінің корпоративтік облигациялары сатып алынбады және сатылмады.

Есептік күнге БЖЗҚ ЗА портфелінде ҚР эмитенттерінің корпоративтік облигацияларын өтеуге орташа алынған кірістілік жылдық 10,2% құрады.

Қазақстан Республикасы квазимемлекеттік ұйымдардың облигациялары

Есептік айда ҚР квазимемлекеттік ұйымдардың облигацияларының ағымдағы құны 32,32 млрд. теңгеге кеміді және 699,24 млрд. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 8,15% құрады.

Қаралып отырған кезеңде 31,71 млрд. теңге сомасына «Қазақстан Даму банкі» АҚ облигациялары іске асырылды, сондай-ақ 7,5 млрд. теңге сомасына «ҚИК» АҚ облигациялары өтелді (облигациялар шығару проспектісіне сай төлем 26.07.2018ж. бастап 08.08.2018ж. дейінгі кезеңде күтілуде).

Есептік кезеңде ҚР квазимемлекеттік ұйымдарының облигациялары сатып алынбады.

Есептік күнге ҚР квазимемлекеттік ұйымдарының облигациялары бойынша өтеуге орташа алынған кірістілік теңгеге номинирленген жылдық 10,7%, АҚШ долларына – жылдық 5,0% құрады.

Қазақстан Республикасы екінші деңгейдегі банктерінің облигациялары

Есептік айда ҚР ЕДБ облигацияларының ағымдағы құны 12,86 млрд. теңгеге кеміді және 1 188,83 млрд. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 13,86% құрады.

ҚР ЕДБ облигациялары сатылмады, өтелмеді және сатып алынбады.

Есептік күнге теңгеге номинирленген ҚР ЕДБ облигациялары бойынша орташа алынған кірістілік жылдық 9,9%, АҚШ долларына – жылдық 6,6% құрады.

Шетелдік эмитенттердің корпоративтік облигациялары

Есептік кезеңде шетелдік эмитенттердің корпоративтік облигацияларының ағымдағы құны 0,32 млрд. теңгеге ұлғайды және 9,48 млрд. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 0,11% құрады.

Есептік кезеңде БЖЗҚ ЗА портфелінде шетелдік эмитенттердің корпоративтік облигациялары сатып алынбады, сатылмады және өтелмеді.

Есептік күнге БЖЗҚ ЗА портфелінде шетелдік эмитенттердің корпоративтік облигацияларын өтеуге орташа алынған кірістілік жылдық 7,5% құрады.

Квазимемлекеттік сектордың шетелдік эмитенттерінің облигациялары

Есептік айда квазимемлекеттік сектордың шетелдік эмитенттерінің облигацияларының ағымдағы құны 12,31 млрд. теңгеге ұлғайды және 135,23 млрд. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 1,58% құрады.

БЖЗҚ Инвестициялық декларациясында көзделген ЗА портфелінің валюталық бөлігін жаңа стратегиялық бөлу шеңберінде орташа алынған кірістілігі жылдық 4,46% номиналдық құны бойынша 13,16 млрд. теңге көлемінде АҚШ долларына номинирленген Индонезияның квазимемлекеттік секторының шетелдік эмитенттерінің облигациялары сатып алынды.

Есептік айда 3,29 млрд. теңге сомасына «Россельхозбанк» ААҚ облигациялары өтелді. Есептік айда квазимемлекеттік сектордың шетелдік эмитенттерінің облигациялары сатылмады.

БЖЗҚ ЗА портфелінде квазимемлекеттік сектордың шетелдік эмитенттерінің өтеуге орташа алынған кірістілігі есептік күнге жылдық 4,7% құрады.

Шетелдік эмитенттердің PPN (құрылымдық ноттар)

Есептік айда шетелдік эмитенттердің PPN (құрылымдық ноттар) ағымдағы құны 5,89 млрд. теңгеге кеміді және 29,25 млрд. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 0,34% құрады.

Есептік кезеңде шетелдік эмитенттердің PPN (құрылымдық ноттар) 6,37 млрд. теңге сомасына өтелді.

Шетелдік эмитенттердің PPN (құрылымдық ноттар) сатылмады және сатып алынбады.

Қазақстан Республикасы эмитенттерінің акциялары және депозитарлық қолхаттары

Есептік айда ҚР эмитенттері акцияларының және депозитарлық қолхаттарының ағымдағы құны 5,79 млрд. теңгеге ұлғайды және 156,46 млрд. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 1,82% құрады.

Есептік кезеңде «Қазкоммерцбанк» АҚ-ны «Қазақстан Халық банкі» АҚ-ға қосу қорытындысы бойынша БЖЗҚ ЗА портфелінде «Қазкоммерцбанк» АҚ қарапайым акциялары «Қазақстан Халық банкі» АҚ қарапайым акцияларына алмастырылды, сондай-ақ ҚР ЕДБ салымдары бойынша міндеттемелердің бір бөлігін өтеу есебіне 4,49 млрд. теңге сомасында «KCELL» АҚ қарапайым акциялары мен депозитарлық қолхаттары алынды.

Есептік кезеңде БЖЗҚ ЗА портфелінде ҚР эмитенттерінің акциялары мен депозитарлық қолхаттары сатып алынбады.

Шетелдік эмитенттердің акциялары және депозитарлық қолхаттары

Есептік айда шетелдік эмитенттердің акциялары мен депозитарлық қолхаттарының ағымдағы құны 0,02 млрд. теңгеге кеміді және 23,14 млрд. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 0,27% құрады.

Есептік кезеңде шетелдік эмитенттердің акциялары мен депозитарлық қолхаттары сатылмады, сондай-ақ сатып алынбады.

Валюталық құрылым

БЖЗҚ зейнетақы активтерінің есебінен сатып алынған қаржы құралдары номиналданған валюталар бөлігінде қаржы құралдарының инвестициялық портфелі 2-кестеде келтірілген.

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

Валюта	<i>млрд. теңге</i>				
	01.01.2018 жылға ағымдағы құны	01.01.2018 жылға үлесі	01.08.2018 ж. ағымдағы құны	01.08.2018 ж. үлесі	Жыл басынан өсуі/төмендеуі
Ұлттық валюта	5 619,71	72,28%	5 803,45	67,67%	3,27%
АҚШ доллары	2 110,34	27,14%	2 734,19	31,88%	29,56%
Ресей рублі	36,90	0,47%	30,37	0,35%	-17,69%
Басқа валюта	7,88	0,10%	8,21	0,10%	4,28%
Жиыны:	7 774,82	100,00%	8 576,23	100,00%	10,31%

Инвестициялық қызметтің нәтижелері

Инвестициялық қызметтің нәтижесінде, сондай-ақ шетелдік валюталар бағамының құбылмалылығы салдарынан және қаржы құралдарының нарықтық құнының өзгеруі нәтижесінде 2018 жылдың басынан есептелген инвестициялық табыс көлемі 449,70 млрд. теңгені құрады. Салымшылардың (алушылардың) шоттарына бөлінген БЖЗҚ зейнетақы активтерінің табыстылығы 2018 жылдың басынан бастап 5,3% құрады.

Көрсетілген кезеңге есептелген инвестициялық табыс құрылымы 3-кестеде көрсетілген.

3-кесте. ҚРҰБ сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА бойынша алынған инвестициялық табыс құрылымы

Атауы	2018 жыл үшін инвестициялық табыс
Бағалы қағаздар, орналастырылған салымдар және «кері РЕПО» операциялары бойынша сыйақы түріндегі табыстар	312,87
Бағалы қағаздарды нарықтық қайта бағалаудан табыстар (шығындар)	12,66
Шетелдік валютаны қайта бағалаудан табыстар (шығындар)	119,34
Сыртқы басқарудан табыстар (шығындар)	4,85
Басқа табыстар (шығындар)	- 0,02
Жиыны:	449,70

Инвестициялық декларация параметрлерін сақтау туралы ақпарат

Сенімгерлік басқарудағы БЖЗҚ³ ЗА құрылымдық үлестіруі БЖЗҚ Инвестициялық декларациясының талаптарына сәйкес келеді. Валюталық позициялар үлесі рұқсат етілген деңгей шегінде қалады және БЖЗҚ Инвестициялық декларациясының талаптарын бұзбайды. 01.08.2018 жылғы жағдай бойынша БЖЗҚ ЗА бойынша инвестициялау лимиттерін сақтау туралы деректер 4-кестеде көрсетілген.

4-кесте. БЖЗҚ ЗА бойынша инвестициялау лимиттері

№	Қаржы құралдарының түрі	Нақты мәні (зейнетақы активтерінен пайызбен)	Орындалуы (иә/жоқ)
1	Шетелдік эмитенттер:	22,10%	иә
1.1	Мемлекеттік, агенттік және халықаралық қаржы ұйымдарының (ХҚҰ) бағалы қағаздары:	13,12%	иә
1)	«Standard&Poor's» агенттігінің халықаралық шәкілі бойынша «BBB-» төмен емес рейтинг бағасы бар немесе басқа рейтинг агенттіктерінің бірінің осыған ұқсас деңгейінің рейтинг бағасы бар	9,25%	иә
2)	«Standard&Poor's» агенттігінің халықаралық шәкілі бойынша «BB+»-дан «BB-» дейін рейтинг бағасы бар немесе басқа рейтинг агенттіктерінің бірінің осыған ұқсас деңгейінің рейтинг бағасы бар	3,87%	иә
1.2	Корпоративтік борыштық бағалы қағаздар:	1,69%	иә

³ БЖЗҚ Инвестициялық декларациясы Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкінің Басқармасының 2016 жылғы 17 наурыздағы №86 қаулысымен бекітілген

1)	«Standard&Poor's» агенттігінің халықаралық шәкілі бойынша «BBB-» төмен емес бағалы қағаздар және/немесе эмитент рейтинг бағасы бар немесе басқа рейтинг агенттіктерінің бірінің осыған ұқсас деңгейінің рейтингтік бағасы бар	1,28%	иә
2)	Standard&Poor's» агенттігінің халықаралық шәкілі бойынша «BB+»-дан «BB-» дейін бағалы қағаздар және/немесе эмитент рейтинг бағасы бар немесе басқа рейтинг агенттіктерінің бірінің осыған ұқсас деңгейінің рейтингтік бағасы бар	0,41%	иә
1.3	Ценные бумаги под залог недвижимости (MBS) и активов (ABS) с рейтинговой оценкой ценной бумаги и/или эмитента не ниже «BBB-» по международной шкале агентства «Standard & Poor's» или рейтинговой оценкой аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств	0,00%	иә
1.4	Акциялар, акцияларға депозитарлық қолхаттар	0,27%	иә
1.5	«Standard&Poor's» агенттігінің халықаралық шәкілі бойынша «A-» төмен емес рейтингтік бағасы бар немесе басқа рейтинг агенттіктерінің бірінің осыған ұқсас деңгейінің рейтингтік бағасы бар шетелдік банктердегі депозиттер (салымдар)	6,68%	иә
1.6	«Standard&Poor's» агенттігінің халықаралық шәкілі бойынша «BBB-» төмен емес рейтинг бағасы бар немесе басқа рейтинг агенттіктерінің бірінің осыған ұқсас деңгейінің рейтингтік бағасы бар ұйымдар шығарған құрылымдық өнімдер	0,34%	иә
1.7	Ислам қаржыландыру құралдары:	0,00%	иә
1)	«Standard&Poor's» агенттігінің халықаралық шәкілі бойынша «BBB-» төмен емес бағалы қағаздар және/немесе эмитент рейтинг бағасы бар немесе басқа рейтинг агенттіктерінің бірінің осыған ұқсас деңгейінің рейтингтік бағасы бар	0,00%	иә
2)	«Standard&Poor's» агенттігінің халықаралық шәкілі бойынша «BB+»-дан «BB-» дейін бағалы қағаздар және/немесе эмитент рейтинг бағасы бар немесе басқа рейтинг агенттіктерінің бірінің осыған ұқсас деңгейінің рейтингтік бағасы бар	0,00%	иә
2	Қазақстандық эмитенттер:	75,10%	иә
2.1	Қазақстан Республикасының Қаржы министрлігі, Қазақстан Республикасының Ұлттық Банкі шығарған Қазақстан Республикасының мемлекеттік бағалы қағаздары	47,48%	иә
2.1-1	Қазақстан Республикасының жергілікті атқарушы органдары шығарған Қазақстан Республикасының мемлекеттік бағалы қағаздары	0,00%	иә
2.1-2	Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкінің депозиттері	0,16%	иә
2.2	Квзимемлекеттік сектор субъектілерінің бағалы қағаздары	8,62%	иә
2.3	Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банктерінің қаржы құралдары	18,49%	иә
2.4	«Standard&Poor's» агенттігінің халықаралық шәкілі бойынша «B-» төмен емес бағалы қағаздар және/немесе эмитент рейтинг 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	0,10%	иә
2.4-1	Қазақстан Республикасы Үкіметінің кепілдігі және/немесе кепілдемесімен шығарылған мемлекеттік емес борышты бағалы қағаздары	0,00%	иә
2.5	Қазақстан қор биржасының ресми тізімінің бірінші санатына кіретін Қазақстан Республикасының квазимемлекеттік секторы мен екінші деңгейдегі банктері субъектілерінің үлесті бағалы қағаздарын қоспағанда мемлекеттік емес үлесті бағалы қағаздары	0,26%	иә
2.6	Қазақстан қор биржасының ресми тізіміне енгізілген ислам қаржыландыру құралдары	0,00%	иә

5-кесте. Қаржы құралдарының жекелеген түрлеріне БЖЗҚ ЗА бойынша инвестициялау лимиттері

№	Қаржы құралының түрі	Нақты мәні (зейнетақы активтерінен пайызбен)	Орындалуы (иә/жоқ)
1	Стандартты туынды қаржы құралдары	0,00%	иә
1)	егер туынды қаржы құралдары инвестициялық тәуекелді хеджирлеуге пайдаланылған жағдайда	0,00%	иә
2	Құймадағы және металл шоттардағы алтын	0,00%	иә

БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфеліндегі қаржы құралдарды сатып алу, сату және өтеу бойынша ақпарат

6-кесте. Есептік айда сатып алынған қаржы құралдары жөніндегі мәліметтер

Мәміле жасалған күн	Өтеу күні	Құрал түрі	Бағалы қағаз эмитенті	ҮСН (ISIN))	Тенгемен номиналды құны
02.07.2018	23.04.2033	ҚР МБҚ	ҚР Үкіметі	KZKDKY150149	6 000 000 000
02.07.2018	09.07.2018	ҚР МБҚ	ҚР Ұлттық Банкі	KZW1KD073156	6 800 000 000
03.07.2018	25.10.2018	АҚШ МБҚ	АҚШ Үкіметі	US912796QE26	43 561 000 000
03.07.2018	10.07.2018	ҚР МБҚ	ҚР Ұлттық Банкі	KZW1KD073164	15 000 000 000
05.07.2018	12.07.2018	ҚР МБҚ	ҚР Ұлттық Банкі	KZW1KD073198	94 000 000 000
09.07.2018	04.02.2030	ҚР МБҚ	ҚР Үкіметі	KZKDKY150123	30 000 000 000
09.07.2018	01.11.2018	АҚШ МБҚ	АҚШ Үкіметі	US912796QF90	57 704 640 000
09.07.2018	08.11.2018	АҚШ МБҚ	АҚШ Үкіметі	US912796PD51	58 391 600 000
09.07.2018	16.07.2018	ҚР МБҚ	ҚР Ұлттық Банкі	KZW1KD073206	65 000 000 000
10.07.2018	17.07.2018	ҚР МБҚ	ҚР Ұлттық Банкі	KZW1KD073214	30 000 000 000
11.07.2018	08.08.2018	ҚР МБҚ	ҚР Ұлттық Банкі	KZW1KD283235	85 300 000 000
12.07.2018	19.07.2018	ҚР МБҚ	ҚР Ұлттық Банкі	KZW1KD073248	95 000 000 000
16.07.2018	23.07.2018	ҚР МБҚ	ҚР Ұлттық Банкі	KZW1KD073271	37 000 000 000
16.07.2018	10.05.2031	ҚР МБҚ	ҚР Үкіметі	KZKDKY130067	30 000 000 000
17.07.2018	24.07.2018	ҚР МБҚ	ҚР Ұлттық Банкі	KZW1KD073289	35 000 000 000
18.07.2018	15.08.2018	ҚР МБҚ	ҚР Ұлттық Банкі	KZW1KD283300	100 000 000 000
19.07.2018	26.07.2018	ҚР МБҚ	ҚР Ұлттық Банкі	KZW1KD073313	70 000 000 000
19.07.2018	15.11.2018	АҚШ МБҚ	АҚШ Үкіметі	US912796QJ13	58 743 500 000
20.07.2018	27.07.2018	ҚР МБҚ	ҚР Ұлттық Банкі	KZW1KD073321	50 000 000 000
23.07.2018	30.07.2018	ҚР МБҚ	ҚР Ұлттық Банкі	KZW1KD073347	65 500 000 000
23.07.2018	16.04.2032	ҚР МБҚ	ҚР Үкіметі	KZKDKY140033	24 000 000 000
23.07.2018	02.05.2023	Еурооблигациялар	Pelabuhan Indonesia III	USY7140DAB65	1 037 040 000
24.07.2018	31.07.2018	ҚР МБҚ	ҚР Ұлттық Банкі	KZW1KD073354	63 000 000 000
24.07.2018	15.05.2027	Еурооблигациялар	Perusahaan Listrik Negar	US71568QAC15	1 723 200 000
24.07.2018		Акции простые*	«KCELL» АҚ	KZ1C59150017	1 838 698 920
24.07.2018	23.06.2047	РФ МБҚ	Ministry of Finance of the Russian Federation	RU000A0JXU14	6 203 520 000
25.07.2018	22.08.2018	ҚР МБҚ	ҚР Ұлттық Банкі	KZW1KD283375	80 000 000 000
25.07.2018	22.11.2021	Еурооблигациялар	Perusahaan Listrik Negar	US71568QAA58	1 731 550 000
25.07.2018	01.08.2018	ҚР МБҚ	ҚР Ұлттық Банкі	KZW1KD073362	68 520 207 300
26.07.2018		Деп. расписка*	«KCELL» АҚ	US48668G2057	2 650 510 442
26.07.2018	02.08.2018	ҚР МБҚ	ҚР Ұлттық Банкі	KZW1KD073388	80 000 000 000
26.07.2018	21.05.2028	Еурооблигациялар	Perusahaan Listrik Negar	US71568QAE70	1 729 550 000
27.07.2018	03.08.2018	ҚР МБҚ	ҚР Ұлттық Банкі	KZW1KD073396	74 517 098 500
27.07.2018	04.04.2042	РФ МБҚ	Ministry of Finance of the Russian Federation	XS0767473852	3 807 650 000
27.07.2018	23.06.2047	РФ МБҚ	Ministry of Finance of the Russian Federation	RU000A0JXU14	3 461 500 000
30.07.2018	30.07.2036	ҚР МБҚ	ҚР Үкіметі	KZKDKY180013	3 000 000 000
30.07.2018	06.08.2018	ҚР МБҚ	ҚР Ұлттық Банкі	KZW1KD073412	90 000 000 000
30.07.2018		Қарапайым акциялар**	«Қазақстан Халық банкі» АҚ	KZ1C33870011	179 976 621
30.07.2018	20.05.2023	Еурооблигациялар	Pertamina Persero PT	USY7138AAE02	1 735 300 000
30.07.2018	03.05.2022	Еурооблигациялар	Pertamina Persero PT	USY7138AAC46	1 735 300 000
31.07.2018	07.08.2018	ҚР МБҚ	ҚР Ұлттық Банкі	KZW1KD073420	70 000 000 000
31.07.2018	03.05.2022	Еурооблигациялар	Pertamina Persero PT	USY7138AAC46	1 733 500 000
31.07.2018	01.10.2024	Еурооблигациялар	Pelabuhan Indonesia III	USY7140DAA82	1 733 500 000
					1 617 338 841 783

* - ҚР ЕДБ салымдары бойынша міндеттемелердің бір бөлігін өтеу есебіне алынды

** - «Қазкоммерцбанк» АҚ қарапайым акцияларына алмастыру нәтижесінде алынды

7-кесте. Есептік айда қаржы құралдарын сату бойынша мәлімет

Мәміле жасалған күн	Өтеу күні	Құрал түрі	Бағалы қағаз эмитенті	ҮСН (ISIN)	Мәміле сомасы теңгемен
02.07.2018	15.03.2019	ҚР МБҚ	ҚР Ұлттық Банкі	KZW1KY012227	1 275 686 550
20.07.2018	10.06.2019	Облигациялар	«Қазақстан Даму банкі» АҚ	KZP01Y03F261	31 713 196 667
30.07.2018		Қарапайым акциялар*	«Қазкоммерцбанк» АҚ	KZ1C00400016	185 167 247
Жыны					33 174 050 464

* - «Қазақстан Халық банкі» АҚ қарапайым акцияларына алмастыру қорытындысы бойынша есептен шығарылды

8-кесте. Есептік айдағы шетелдік банктердің салымдарына салу бойынша мәліметтер

Мәміле жасалған күн	Өтеу күні	Банк атауы	Мәміле сомасы тенгемен
02.07.2018	10.10.2018	Rabobank Nederland	78 572 600 000
02.07.2018	04.10.2018	Mizuho Corporate Bank	68 324 000 000
02.07.2018	15.10.2018	DBS BANK LTD	34 162 000 000
03.07.2018	04.07.2018	ҚР Ұлттық Банкі	1 000 000 000
04.07.2018	05.07.2018	ҚР Ұлттық Банкі	1 000 000 000
11.07.2018	12.07.2018	ҚР Ұлттық Банкі	20 000 000 000
12.07.2018	13.07.2018	ҚР Ұлттық Банкі	20 000 000 000
13.07.2018	16.07.2018	ҚР Ұлттық Банкі	20 000 000 000
16.07.2018	17.07.2018	ҚР Ұлттық Банкі	20 000 000 000
17.07.2018	18.07.2018	ҚР Ұлттық Банкі	20 000 000 000
18.07.2018	19.07.2018	ҚР Ұлттық Банкі	20 000 000 000
19.07.2018	20.07.2018	ҚР Ұлттық Банкі	16 400 000 000
20.07.2018	23.07.2018	ҚР Ұлттық Банкі	31 900 000 000
30.07.2018	31.07.2018	ҚР Ұлттық Банкі	18 300 000 000
31.07.2018	01.08.2018	ҚР Ұлттық Банкі	13 900 000 000
Жиыны			383 558 600 000

9-кесте. Есептік айдағы бағалы қағаздардың негізгі борышын өтеу жөніндегі мәліметтер

ҮСН (ISIN)	Құрал түрі	Бағалы қағаз эмитенті	Нақты өтелген күн	Тенгемен өтелетін сома
KZW1KD073099	ҚР МБҚ	ҚР Ұлттық Банкі	03.07.2018	19 600 000 000
KZW1KD073123	ҚР МБҚ	ҚР Ұлттық Банкі	05.07.2018	84 500 000 000
US912796PN34	АҚШ МБҚ	АҚШ Үкіметі	09.07.2018	58 391 600 000
KZW1KD073156	ҚР МБҚ	ҚР Ұлттық Банкі	09.07.2018	6 800 000 000
KZW1KD103136	ҚР МБҚ	ҚР Ұлттық Банкі	09.07.2018	83 826 675 100
KZW1KD073164	ҚР МБҚ	ҚР Ұлттық Банкі	10.07.2018	15 000 000 000
KZW1KD282989	ҚР МБҚ	ҚР Ұлттық Банкі	11.07.2018	101 000 000 000
KZW1KD073198	ҚР МБҚ	ҚР Ұлттық Банкі	12.07.2018	94 000 000 000
US912796PQ64	АҚШ МБҚ	АҚШ Үкіметі	13.07.2018	77 963 150 000
XS0374655693	Құрылымдық нота	Goldman Sachs International	16.07.2018	5 086 141 717
KZW1KD073206	ҚР МБҚ	ҚР Ұлттық Банкі	16.07.2018	65 000 000 000
KZW1KD073214	ҚР МБҚ	ҚР Ұлттық Банкі	17.07.2018	30 000 000 000
KZW1KD283052	ҚР МБҚ	ҚР Ұлттық Банкі	18.07.2018	129 577 074 200
KZW1KD073248	ҚР МБҚ	ҚР Ұлттық Банкі	19.07.2018	95 000 000 000
KZW1KD073271	ҚР МБҚ	ҚР Ұлттық Банкі	23.07.2018	37 000 000 000
KZW1KD073289	ҚР МБҚ	ҚР Ұлттық Банкі	24.07.2018	35 000 000 000
XS0089375249	РФ МБҚ	РФ Үкіметі	24.07.2018	9 305 280 000
KZW1KD283110	ҚР МБҚ	ҚР Ұлттық Банкі	25.07.2018	192 030 674 000
XS0955232854	Еуробондтар	Russian Agricultural Bank OJSC	25.07.2018	3 289 945 000
KZW1KD073313	ҚР МБҚ	ҚР Ұлттық Банкі	26.07.2018	70 000 000 000
KZW1KD073321	ҚР МБҚ	ҚР Ұлттық Банкі	27.07.2018	50 000 000 000
XS0376284849	Құрылымдық нота	JPMorgan Chase & Co.	27.07.2018	1 279 609 783
KZW1KD073347	ҚР МБҚ	ҚР Ұлттық Банкі	30.07.2018	65 500 000 000
KZW1KD073354	ҚР МБҚ	ҚР Ұлттық Банкі	31.07.2018	63 000 000 000
Жиыны				1 392 150 149 801

10-кесте. Есептік айдағы салымдар бойынша негізгі борышты өтеу жөніндегі мәліметтер

Мәміле жасалған күн	Өтеу күні	Банк атауы	Мәміле сомасы тенгемен
02.07.2018	20.10.2019	«Нұрбанк» АҚ	360 000 000
02.07.2018	08.12.2019	«Нұрбанк» АҚ	340 000 000
03.07.2018	03.07.2018	Credit Agricole	42 532 000 000
04.07.2018	04.07.2018	ҚР Ұлттық Банкі	1 000 000 000
05.07.2018	05.07.2018	ҚР Ұлттық Банкі	1 000 000 000
09.07.2018	09.07.2018	Ing Bank N.V.	55 987 240 000
11.07.2018	28.10.2019	Банк ВТБ АҚ ЕҰ(Қазақстан)	70 000 000
12.07.2018	26.10.2019	«Банк Kassa Nova» АҚ	195 000 000
12.07.2018	12.07.2018	ҚР Ұлттық Банкі	20 000 000 000
13.07.2018	13.07.2018	ҚР Ұлттық Банкі	20 000 000 000
16.07.2018	20.10.2019	«AsiaCredit Bank (АзияКредит Банк)» АҚ	217 000 000

16.07.2018	16.07.2018	ҚР Ұлттық Банкі	20 000 000 000
16.07.2018	15.12.2019	«AsiaCredit Bank (АзияКредит Банк)» АҚ	103 000 000
17.07.2018	29.12.2019	«ҚАЗКОММЕРЦБАНК» АҚ	1 200 000 000
17.07.2018	03.11.2019	«ҚАЗКОММЕРЦБАНК» АҚ	660 000 000
17.07.2018	17.07.2018	ҚР Ұлттық Банкі	20 000 000 000
18.07.2018	18.07.2018	ҚР Ұлттық Банкі	20 000 000 000
19.07.2018	19.07.2018	Credit Agricole	62 199 000 000
19.07.2018	19.07.2018	ҚР Ұлттық Банкі	20 000 000 000
20.07.2018	20.07.2018	ҚР Ұлттық Банкі	16 400 000 000
23.07.2018	23.07.2018	ҚР Ұлттық Банкі	31 900 000 000
24.07.2018	08.12.2019	«Астана банкі» АҚ	1 838 698 920
24.07.2018	28.10.2019	Банк ВТБ АҚ ЕҰ(Қазақстан)	110 000 000
26.07.2018	21.10.2019	«Астана банкі» АҚ	2 650 510 442
30.07.2018	10.12.2019	«Банк ЦентрКредит» АҚ	500 000 000
31.07.2018	31.07.2018	ҚР Ұлттық Банкі	18 300 000 000
			357 562 449 362