

«БЖЗҚ» АҚ ЗЕЙНЕТАҚЫ АКТИВТЕРІН ИНВЕСТИЦИЯЛЫҚ БАСҚАРУ БОЙЫНША АҚПАРАТ

2019 жылғы 1 қарашадағы жағдай бойынша Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкінің басқаруындағы (бұдан әрі – ҚРҰБ) БЖЗҚ зейнетақы активтері (бұдан әрі – ЗА) 10 564,43 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	01.01.2019 жылға ағымдағы құны	01.01.2019 жылға үлесі	01.11.2019 жылға ағымдағы құны	01.11.2019 жылға үлесі	Жыл басынан осуі/төмендеуі
ҚР МБҚ	4 057,98	43,27%	4 037,83	38,22%	-0,50%
Шетелдік мемлекеттердің МБҚ	1 191,92	12,71%	1 534,55	14,53%	28,75%
ХҚҰ	170,96	1,82%	304,94	2,89%	78,37%
ҚР эмитенттерінің корпоративтік облигациялары	42,06	0,45%	29,73	0,28%	-29,31%
ҚР квазимемлекеттік ұйымдардың облигациялары	1 299,90	13,86%	1 643,08	15,55%	26,40%
ҚР ЕДБ облигациялары	1 264,78	13,49%	1 266,27	11,99%	0,12%
Шетелдік эмитенттердің корпоративтік облигациялары	8,85	0,09%	9,60	0,09%	8,45%
Квазимемлекеттік сектордың шетелдік эмитенттердің облигациялары	232,92	2,48%	236,31	2,24%	1,45%
PPN (құрылымдық ноттар)	33,95	0,36%	31,86	0,30%	-6,16%
ҚР эмитенттерінің акциялары және депозитарлық қолхаттары	224,40	2,39%	239,91	2,27%	6,91%
Шетелдік эмитенттердің акциялары және депозитарлық қолхаттары	20,42	0,22%	27,05	0,26%	32,44%
Депозиттер	277,65	2,96%	254,90	2,41%	-8,19%
ҚРҰБ депозиттері	154,07	1,64%	189,00	1,79%	22,67%
Шетелдік банктердегі депозиттер	343,16	3,66%	300,81	2,85%	-12,34%
Своп	-	-	1,89	0,02%	
Инвестициялық шоттардағы ақшалай қаражат	126,69	1,35%	302,95	2,87%	
Басқа активтер (дебиторлық берешек ² , мерзімі өткен берешек, провизиялар)	15,23	0,16%	55,86	0,53%	
Aviva Investors Global Services Limited* сыртқы басқаруындағы активтер	82,80	0,88%	97,89	0,93%	18,22%
ҚРҰБ басқаруындағы ЗА жиынтығы	9 378,03**	100,00%	10 564,43	100,00%	12,65%
Жасалған мәмілелер бойынша төлемге міндеттемелер	169,71				
Зейнетақы жарналары мен төлемдері шоттарындағы ақша	7,12		2,06		
Зейнетақы активтерінің жиыны	9 554,86		10 566,49		10,59

* - «Дамушы нарықтардың жаһандық облигациялары» мандатының аясында

** - 169,71 млрд. теңге сомасына жасалған мәмілелер бойынша төлемге міндеттемелер есебімен

БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфеліндегі борыштық қаржы құралдарын өтеуге орташа алынған кірістілік (ҮТМ) 01.11.2019 жылғы жағдай бойынша жылдық 7,04% құрады, оның ішінде теңгеге номинирленген – жылдық 8,7%, шетелдік валютада – жылдық 3,4%.

Қазақстан Республикасының мемлекеттік бағалы қағаздары

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.

БЖЗК ЗА портфелінде негізгі үлесті ҚР МБҚ құрайды, олардың есептік айдағы ағымдағы құны 103,48 млрд. теңгеге ұлғайды және 4 037,83 млрд. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 38,22% құрады.

Есепті кезеңде мынадай қаржы құралдары сатып алынды:

- орташа алынған кірістілігі жылдық 9,50% құрайтын 161,97 млрд. теңге көлемінде ҚРҰБ қысқа мерзімді дисконт ноттары;

- кірістілігі жылдық 9,57% құрайтын 12,88 млрд. теңге көлемінде теңгеге номинирленген ҚР Қаржы министрлігінің МБҚ.

Қарастырылып отырған кезеңде жалпы сомасы 60,00 млрд. теңге ҚРҰБ дисконт ноттары өтелді.

Қазақстан Республикасының мемлекеттік бағалы қағаздары сатылмады.

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

Шетелдік мемлекеттердің мемлекеттік бағалы қағаздары

Есепті ай үшін шетелдік мемлекеттердің мемлекеттік бағалы қағаздарының ағымдағы құны 78,34 млрд. теңгеге кеміді және 1 534,55 млрд. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 14,53% құрады.

Есепті кезеңде жылдық 1,65% орташа алынған табыстылықпен 238,45 млрд. теңге көлемінде қысқа мерзімді АҚШ МБҚ сатып алынды.

Есепті айда мынадай елдермен МБҚ сатып алу-сату мәмілелері жасалды: Ресей Федерациясы, Филиппин, Перу, Индонезия, Мексика, Бразилия. Қарастырылып отырған кезеңге нетто-сату көлемі 131,0 млрд.теңгені құрады.

Қарастырылып отырған кезеңде жалпы сомасы 208,27 млрд. теңге қысқа мерзімді АҚШ МБҚ өтемі жүзеге асырылды.

Есепті күнге БЖЗК ЗА портфеліндегі шетелдік мемлекеттердің МБҚ өтеуге орташа алынған кірістілігі жылдық 2,6% құрады.

Халықаралық қаржы ұйымдарының облигациялары

Есепті айда халықаралық қаржы ұйымдары облигацияларының ағымдағы құны 0,01 млрд. теңгеге кеміді және 304,94 млрд. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 2,89% құрады.

Есепті айда 19,98 млрд. теңге сомасына Еуразиялық даму банкінің облигациялары бойынша негізгі борыш төлемі жүзеге асырылды (ағымдағы құн алдыңғы айда төмендеді).

Халықаралық қаржы ұйымдарының бағалы қағаздарын сату және сатып алу болған жоқ.

Халықаралық қаржы ұйымдарының облигацияларын өтеуге теңгеге номинирленген орташа алынған кірістілік жылдық 6,4% құрады, АҚШ долларына – жылдық 5,0% құрады.

Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банктеріндегі депозиттер

Орташа алынған өтеу мерзімі 4,76 жыл болатын ҚР ЕДБ салымдарының ағымдағы құны есептік айда 2,01 млрд. теңгеге кеміді және 254,90 млрд. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 2,41% құрады.

Банктік салым шарттарында белгіленген талаптарға сәйкес негізгі борыш өтелді және ҚР ЕДБ депозиттері бойынша жалпы сомасы 2,55 млрд.теңге негізгі борыш ішінара мерзімінен бұрын өтелді.

ҚР ЕДБ салымдарына орналастырылмады.

Есепті күнге ҚР ЕДБ салымдарын өтеуге орташа алынған кірістілік жылдық 9,2% құрады.

Шетелдік банктердегі депозиттер

Орташа алынған өтеу мерзімі 1,91 ай болатын есепті айда шетелдік банктердегі салымдардың ағымдағы құны 17,67 млрд. теңгеге артты және 300,81 млрд. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 2,85% құрады.

Есепті айда шетелдік банкте орташа алынған кірістілік жылдық 1,95 % құрайтын 138,80 млрд.теңге сомасына және тиісінше кірістілік жылдық 6,60% құрайтын 5,99 млрд.теңге сомасына АҚШ долларына және ресей рубліне номинирленген салымдар орналастырылды.

Есепті кезеңде 128,43 млрд.теңге сомасына салым өтелді.

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

ҚР Ұлттық Банкіндегі депозиттер

ҚР Ұлттық Банкіндегі депозиттердің ағымдағы құны 189,00 млрд. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 1,79%.

Есепті айда ағымдағы өтімділікті басқару аясында зейнетақы активтері бойынша табыстылықты ұстап тұру мақсатында жылына 8,25% орташа алынған табыстылықпен жалпы сомасы 6 258,00 млрд. теңгеге ҚР Ұлттық Банкінің бір күндік депозиттеріне инвестиция салынды. Есепті кезеңде жалпы сомасы 6 418,00 млрд. теңгеге депозиттер өтелді.

Есепті күнде ҚР Ұлттық Банкіндегі салымдарды өтеуге орташа алынған табыстылық – жылына 8,25%.

Қазақстан Республикасы эмитенттерінің корпоративтік облигациялары

Есепті айда ҚР эмитенттерінің корпоративтік облигацияларының ағымдағы құны 0,16 млрд. теңгеге ұлғайды және 29,73 млрд. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 0,28% құрады.

ҚР эмитенттерінің корпоративтік облигациялары сатып алынбады, сатылмады және өтелмеді.

Қазақстан Республикасы квазимемлекеттік ұйымдардың облигациялары

Есепті айда ҚР квазимемлекеттік ұйымдардың облигацияларының ағымдағы құны 172,78 млрд. теңгеге ұлғайды және 1 643,08 млрд. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 15,55% құрады.

Есепті айда жылдық 11,50% кірістілігімен 170,00 млрд. теңге сомасына «ҚТЖ» ҰК» АҚ облигациялары, сондай-ақ басымды жобаларды несиелеу механизмі аясында ҚР ЕДБ арқылы жылдық 10,75% кірістілігімен 1,65 млрд. теңге сомасына «Аграрлық несие корпорациясы» АҚ облигациялары 600 млрд.теңге сомасына сатып алынды.

Есепті кезеңде эмиссия проспектісінде белгіленген өтеу мерзіміне сәйкес «Баспана» Ипотекалық ұйымы» АҚ облигациялары бойынша негізгі борыш 10,00 млрд.теңге сомасында өтелді.

ҚР квазимемлекеттік ұйымдардың облигациялары сатылмады.

Есепті күнге ҚР квазимемлекеттік ұйымдарының облигациялары бойынша өтеуге орташа алынған кірістілік теңгеге номинирленген жылдық 10,4%, АҚШ долларына – жылдық 5,0% құрады.

Қазақстан Республикасы екінші деңгейдегі банктерінің облигациялары

Есепті айда ҚР ЕДБ облигацияларының ағымдағы құны 6,41 млрд.теңгеге ұлғайды және 1 266,27 млрд.теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 11,99% құрады.

Есепті кезеңде ҚР ЕДБ арқылы басымды жобаларды несиелеу механизмі аясында 600 млрд. теңге сомаға жылдық 10,75% кірістілігімен 7,5 млрд. теңге сомасына «Альфа-Банк» ЕБ» АҚ облигациялары сатып алынды.

ҚР ЕДБ облигациялары сатылмады.

Есепті күнге ҚР ЕДБ облигациялары бойынша өтеуге орташа алынған кірістілік теңгеге номинирленген жылдық 9,9%, АҚШ долларына – жылдық 6,4% құрады.

Шетелдік эмитенттердің корпоративтік облигациялары

Есепті айда шетелдік эмитенттердің корпоративтік облигацияларының ағымдағы құны 0,25 млрд. теңгеге ұлғайды және 9,60 млрд. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 0,09% құрады.

Есепті кезеңде шетелдік эмитенттердің корпоративтік облигациялары сатып алынбады, сатылмады және өтелмеді.

Есепті күнге БЖЗҚ ЗА портфелінде шетелдік эмитенттердің корпоративтік облигацияларын өтеуге орташа алынған кірістілік жылдық 7,9% құрады.

Квзимемлекеттік сектордың шетелдік эмитенттерінің облигациялары

Есепті айда квазимемлекеттік сектордың шетелдік эмитенттері облигацияларының ағымдағы құны 0,59 млрд. теңгеге ұлғайды және 236,31 млрд. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 2,24 % құрады.

Есепті кезеңде квазимемлекеттік сектордың шетелдік эмитенттерінің облигацияларын сатып алу, сату және өтеу болған жоқ.

БЖЗҚ ЗА портфелінде квазимемлекеттік сектордың шетелдік эмитенттерінің облигацияларын өтеуге орташа алынған кірістілігі есептік күнге жылдық 4,6% құрады.

Шетелдік эмитенттердің PPN (құрылымдық ноттар)

Есепті айда шетелдік эмитенттердің PPN (құрылымдық ноттар) ағымдағы құны 31,86 млрд. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 0,30% құрады.

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

Қазақстан Республикасы эмитенттерінің акциялары және депозитарлық қолхаттары

Есепті айда ҚР эмитенттері акцияларының және депозитарлық қолхаттарының ағымдағы құны 9,20 млрд. теңгеге артты және 239,91 млрд. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 2,27% құрады.

Есепті кезеңде ҚР эмитенттерінің акциялары және депозитарлық қолхаттары сатылмады, өтелмеді және сатып алынбады.

Шетелдік эмитенттердің акциялары және депозитарлық қолхаттары

Есепті айда шетелдік эмитенттердің акциялары мен депозитарлық қолхаттарының ағымдағы құны 1,58 млрд. теңгеге артты және 27,05 млрд. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 0,26% құрады.

Есепті кезеңде шетелдік эмитенттерінің акциялары және депозитарлық қолхаттары сатылмады, сондай-ақ сатып алынбады.

Туынды қаржы құралдары

Қарастырылып отырған кезеңде кредиттік рейтингісі «А» және одан жоғары ірі халықаралық инвестициялық банктермен қатар 6 айдан 9 айға дейінгі мерзімге 327,00 млн. АҚШ доллары көлемінде USD/JPY валюталық своптың мәмілелері жасалды. Бұл мәмілелер қысқа мерзімді өтімділікті басқару аясында зейнетақы активтерінің кірістілігін арттыру мақсатында нарық талабында жасалды. Аталған мәмілелер аясында БЖЗҚ зейнетақы активтерінің портфеліне 35,29 млрд. жапон иені алынды.

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

млрд. теңге

Валюта	01.01.2019 жылға ағымдағы құны	01.01.2019 жылға үлесі	01.11.2019 ж. ағымдағы құны	01.11.2019 ж. үлесі	Жыл басынан өсуі/төмендеуі
Ұлттық валюта	6 304,73	67,23%	6 949,8	65,79%	10,23%
АҚШ доллары	3 035,86	32,37%	3 275,0	31,00%	7,88%

Ресей рублі	30,28	0,32%	33,9	0,32%	11,79%
Басқа валюта	7,16	0,08%	305,8	2,89%	4170,44%
Жиынтығы:	9 378,03	100,00%	10 564,43	100,00%	12,65%

Инвестициялық қызметтің нәтижелері

Инвестициялық қызметтің нәтижесінде, сондай-ақ шетелдік валюталар бағамының құбылмалылығы салдарынан және қаржы құралдарының нарықтық құнының өзгеруі нәтижесінде 2019 жылдың басынан есептелген инвестициялық табыс көлемі 599,35 млрд. теңгені құрады. Салымшылардың (алушылардың) шоттарына бөлінген БЖЗҚ зейнетақы активтерінің табыстылығы 2019 жылдың басынан бастап 5,67% құрады.

Бұл ретте БЖЗҚ салымшылары (алушылары) үшін 2019 жылғы 1 қарашадағы жағдай бойынша зейнетақы активтерінің кірістілігі соңғы 12 ай ішінде (2018 жылғы қарашадан 2019 жылғы қазанға дейін) 5,50% мөлшеріндегі инфляция кезінде 8,00% құрады. Осылайша, соңғы 12 айға БЖЗҚ зейнетақы активтері бойынша нақты кірістілік 2,50% құрады.

Көрсетілген кезеңге есептелген инвестициялық табыс құрылымы 3-кестеде көрсетілген.

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

Атауы	2019 жыл үшін инвестициялық табыс
Бағалы қағаздар, орналастырылған салымдар және «кері РЕПО» операциялары бойынша сыйақы түріндегі табыстар	548,72
Бағалы қағаздарды нарықтық қайта бағалаудан табыстар (шығындар)	-38,29
Шетелдік валютаны қайта бағалаудан табыстар (шығындар)	46,68
Сыртқы басқарудан табыстар (шығындар)	15,09
Басқа табыстар (шығындар)	27,15
Жиынтығы:	599,35

Инвестициялық декларация параметрлерін сақтау туралы ақпарат

Сенімгерлік басқарудағы БЖЗҚ ЗА құрылымдық үлестіруі БЖЗҚ Инвестициялық декларациясының талаптарына сәйкес келеді. Валюталық позициялар үлесі рұқсат етілген деңгей шегінде қалады және БЖЗҚ³ Инвестициялық декларациясының талаптарын бұзбайды. 2019 жылғы 01 қарашадағы 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:	24,03	иә
1.1	Мемлекеттік, агенттік және халықаралық қаржы ұйымдарының (ХҚҰ) бағалы қағаздары:	18,27%	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	17,86%	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	0,41%	иә
1.2	Корпоративтік борыштық бағалы қағаздар:	2,35%	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	2,32%	иә

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

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	0,03%	иә
1.3	«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 жылжымайтын мүлік (MBS) және активтері (ABS) кепілдігіне бағалы қағаздар	0,00%	иә
1.4	Акциялар, акцияларға депозитарлық қолхаттар	0,26%	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)	2,85%	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	0,30%	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	0,07%	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:	72,29%	иә
2.1	Қазақстан Республикасының Қаржы министрлігі, Қазақстан Республикасының Ұлттық Банкі шығарған Қазақстан Республикасының мемлекеттік бағалы қағаздары	38,22%	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	1,79%	иә
2.2	Квазимемлекеттік сектор субъектілерінің бағалы қағаздары	16,52%	иә
2.3	Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банктерінің қаржы құралдары	15,40%	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	0,08%	иә
2.4-1	Қазақстан Республикасы Үкіметінің кепілдігі және/немесе кепілдемесімен шығарылған мемлекеттік емес борыштық 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	0,28%	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	3,37%	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. Есепті айда сатып алынған қаржы құралдары жөніндегі мәліметтер

Құрал түрі	Валюта	Бағалы қағаздың эмитенті	Атаулы құны, теңгемен
АҚШ МБҚ	USD	АҚШ Үкіметі	238 454 510 000
Облигациялар	KZT	«ҚТЖ» ҰК» АҚ	170 000 000 000
ҚР МБҚ	KZT	ҚР Ұлттық Банкі	161 971 448 500
ҚР МБҚ	KZT	ҚР Үкіметі	12 875 000 000
МБҚ	USD	Индонезия Республикасының Үкіметі (нетто-сатып алу)	9 355 741 920
Облигациялар	KZT	«Альфа-Банк ЕБ» АҚ	7 500 000 000
Облигациялар	KZT	«Аграрлық несие корпорациясы» АҚ	1 650 000 000
Жиынтығы			601 806 700 420

7-кесте. Есепті айда қаржы құралдарын сату бойынша мәліметтер

Құрал түрі	Валюта	Бағалы қағаздың эмитенті	Мәміле сомасы теңгемен
РФ МБҚ	USD	Ресей Федерациясының Үкіметі	114 920 693 526
Перу МБҚ	USD	Перу Республикасының Үкіметі	5 339 032 488
Мексика МБҚ	USD	Мексика Үкіметі	8 987 053 870
Бразилия МБҚ	USD	Бразилия Республикасының Үкіметі	7 350 625 036
Филиппин МБҚ	USD	Филиппин Республикасының Үкіметі	3 766 846 969
Жиынтығы			140 364 251 890

8-кесте. Есепті айдағы салымдарға салынғандар бойынша мәліметтер

Құрал түрі	Валюта	Банк атауы	Мәміле сомасы теңгемен
Салым	KZT	ҚР Ұлттық Банкі	6 258 000 000 000
Салым	USD	Bank of Montreal	80 500 230 000
Салым	USD	Bank of Tokyo-Mitsubishi	38 854 000 000
Салым	USD	Credit Agricole	19 446 000 000
Салым	RUB	HSBC Bank	5 990 000 000
Жиынтығы			6 402 790 230 000

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

Құрал түрі	Валюта	Бағалы қағаздың эмитенті	Өтелетін сома теңгемен
АҚШ МБҚ	USD	АҚШ Үкіметі	208 270 450 000
ҚР МБҚ	KZT	ҚР Ұлттық Банкі	60 000 000 000
Облигациялар	KZT	Еуразия даму банкі	19 980 000 000
Облигациялар	KZT	«Баспана» Ипотекалық ұйымы» АҚ	10 000 000 000
Жиынтығы			298 250 450 000

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

Құрал түрі	Валюта	Банк атауы	Өтелетін сома теңгемен
Салым	KZT	ҚР Ұлттық Банкі	6 418 000 000 000
Салым	USD	DBS Bank	70 085 921 490
Салым	USD	Bank of Montreal	58 348 776 890
Салым	KZT	«Нұрбанк» АҚ	1 585 870 307
Салым	KZT	«Банк ЦентрКредит» АҚ	567 664 000
Салым	KZT	«Банк ВТБ (Қазақстан)» АҚ ЕҰ	234 927 474
Салым	KZT	«Банк Kassa Nova» АҚ	165 000 000
Жиынтығы			6 548 988 160 161