

2016 жылғы шілде айы үшін «БЖЗҚ» АҚ зейнетақы активтерін инвестициялық басқару бойынша ақпарат

2016 жылғы 1 тамыздағы жағдай бойынша Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкінің басқаруындағы (бұдан әрі - ҚРҰБ) БЖЗҚ зейнетақы активтері (бұдан әрі - ЗА) 6 385,50 млрд. теңгені құрады¹.

Зейнетақы активтерінің құрылымы

1-кесте. Зейнетақы активтері

Атауы	01.07.2016 жылғы млрд.теңгемен ағымдағы құны	01.07.2016 ж. үлесі	01.08.2016 жылғы млрд.теңгемен ағымдағы құны	01.08.2016 ж. үлесі	өсімі/төмендеуі
ҚР МБҚ	2 742,60	44,07%	2 822,46	44,20%	2,91%
Шетелдік мемлекеттердің МБҚ	289,29	4,65%	217,47	3,41%	-24,83%
ХҚҰ	85,30	1,37%	85,91	1,35%	0,72%
ҚР эмитенттерінің корпоративтік облигациялары	107,73	1,73%	107,43	1,68%	-0,28%
ҚР квазимемлекеттік ұйымдардың облигациялары	663,19	10,66%	713,97	11,18%	7,66%
ҚР ЕДБ облигациялары	1 516,37	24,36%	1 505,31	23,57%	-0,73%
Шетелдік эмитенттердің корпоративтік облигациялары	149,78	2,41%	159,46	2,50%	6,47%
PPN (құрылымдық ноталар)	43,43	0,70%	42,81	0,67%	-1,43%
ҚР эмитенттерінің акциялары және депозитарлық қолхаттары	111,16	1,79%	122,33	1,92%	10,05%
Шетелдік эмитенттердің акциялары және депозитарлық қолхаттары	15,92	0,25%	17,34	0,27%	8,96%
Депозиттер	429,05	6,89%	415,93	6,51%	-3,06%
РЕПО	5,00	0,08%	-	0,00%	-
Инвестициялық шоттағы ақшалар	53,42	0,86%	150,01	2,35%	180,83%
Басқа активтер (дебиторлық берешек, мерзімі өткен берешек, провизиялар) ²	11,28	0,18%	25,07	0,39%	122,13%
ҚРҰБ басқаруындағы ЗА жиынтығы	6 223,52	100,00%	6 385,50	100,00%	2,60%
Зейнетақы жарналары және төлемдері шоттарындағы ақшалар	1,35		2,21		64,51%
зейнетақы активтерінің жиыны	6 224,87		6 387,71		2,62%

01.01.2016 жылдан 31.07.2016 жылғы кезең үшін салымшылардың шоттарына (шартты зейнетақы бірлігі - ШЗБ) бөлінген БЖЗҚ зейнетақы активтерінің табыстылығы 6,4 % құрады.

¹ Зейнетақы жарналары мен төлемдері шоттарындағы ақшалар есебінсіз.

² Дебиторлық берешекке шығарылым перспектісіне сәйкес өтеу кезеңі аяқталмаған, купондық күні келіп жеткен сыйақы және/немесе негізгі борыш бойынша алынатын сома енеді.

2-кесте. ҚРҰБ басқаруындағы БЖЗҚ зейнетақы активтерін үлестік бөлу

Қаржы құралының түрі	01.08.2016 жылға үлесі
Борыштық қаржы құралдары	95,07%
Үлестік қаржы құралдары	2,19%
Ақшалар	2,35%
Басқа активтер (дебиторлық берешек және мерзімі өткен берешек, провизиялар)	0,39%
ҚРҰБ басқаруындағы ЗА жиыны	100,00%

БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфеліндегі борыштық қаржы құралдарын өтеуге орташа алынған табыстылық (УТМ) 01.08.2016 жылғы жағдай бойынша жылына 10,8% құрады.

Зейнетақы активтерінің инвестициялануы

Қазақстан Республикасының Ұлттық қорды басқару кеңесі отырысының 2016 жылғы 20 ақпандағы № 01-9.2 хаттамасына сәйкес БЖЗҚ зейнетақы активтері 2016 жылы келесідей бағыттар бойынша инвестицияланатын болады:

- республикалық бюджеттің тапшылығын қаржыландыру үшін Қазақстан Республикасының мемлекеттік бағалы қағаздарын алу;
- шетелдік қаржы нарықтарында инвестициялау үшін шетел валютасын сатып алу;
- кіші және орта кәсіпкерлік субъектілерін қаржыландыру үшін екінші деңгейдегі банктердің негізделген қаржы құралдарына инвестициялау;
- квазимемлекеттік сектор субъектілерінің негізделген борыштық бағалы қағаздарға инвестициялау.

Қазақстан Республикасының мемлекеттік бағалы қағаздары

БЖЗҚ ЗА портфелінде негізгі үлесті ҚР МБҚ құрайды, олардың көлемі есепті айда 79,86 млрд. теңгеге ұлғайды және 2 822,46 млрд. теңгені құрады. Олардың портфелдегі үлесі 44,20% құрады.

Есепті кезеңде орташа алынған кірістілігі жылына 13,98% құрайтын 533,78 млрд.теңге көлемінде ҚРҰБ қысқамерзімді дисконтты ноттары, орташа алынған кірістілігі жылына 3,66% құрайтын 26,69 млрд.теңге көлемінде ҚР Қаржы министрлігінің еурооблигациялары сатып алынған болатын.

Есепті күнге 483,08 млрд.теңге сомасына ҚРҰБ дисконтты ноттары өтелді. Сату болған жоқ.

Есепті кезеңде БЖЗҚ ЗА портфелінде ҚР МБҚ өтеуге орташа алынған кірістілік жылына 12,7% құрады.

Шетелдік мемлекеттердің мемлекеттік бағалы қағаздары

Есепті айда шетелдік мемлекеттердің мемлекеттік бағалы қағаздар көлемі 217,47 млрд. теңгені құрады. Олардың портфелдегі үлесі 3,41% құрады.

Есепті кезеңде орташа алынған кірістілігі жылына 1,61% құрайтын 10,99 млрд.теңге көлемінде АҚШ долларына номинацияланған, орташа алынған кірістілігі жылына 10,26 % құрайтын 4,06 млрд.теңге көлемінде рубльге номинацияланған РФ Қаржы министрлігінің облигациялары сатып алынды.

Есепті күнде 95,32 млрд.теңге сомасына АҚШ Қазынашылығы облигацияларының негізгі борышы өтелді.

Есепті кезеңде БЖЗҚ ЗА портфеліндегі шетелдік мемлекеттердің МБҚ өтеуге орташа алынған кірістілік жылына 2,2% құрады.

Халықаралық қаржы ұйымдарының облигациялары

Есепті айда Халықаралық қаржы ұйымдарының облигацияларының көлемі 0,61 млрд. теңгеге артты және 85,91 млрд. теңгені құрады. Олардың портфелдегі үлесі 1,35 % құрады.

Есепті кезеңде Халықаралық қаржы ұйымдарының бағалы қағаздарын сатып алулар, сатулар және өтеулер болған жоқ.

Есепті кезеңде БЖЗҚ ЗА портфелінде Халықаралық қаржы ұйымдарының облигацияларын өтеуге орташа алынған кірістілік жылына 7,3 % құрады.

Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банктеріндегі депозиттер

Есепті айда ЕДБ салымдарының көлемі 13,12 млрд. теңгеге азайды және 415,93 млрд. теңгені құрады. Портфелдегі олардың үлесі 6,51% құрады.

Есепті кезеңде БЖЗҚ ЗА портфелінде шамамен 13,20 млрд.теңге сомасына ҚР ЕДБ салымдарының негізгі борышы өтелді.

Есепті кезеңде БЖЗҚ ЗА портфелінде ЕДБ салымдарын өтеуге орташа алынған кірістілік жылына 10,7% құрады.

ҚР эмитенттерінің корпоративтік облигациялары

Есепті айда ҚР эмитенттерінің корпоративтік облигацияларының көлемі 0,30 млрд. теңгеге азайды және 107,43 млрд. теңгені құрады. Олардың портфелдегі үлесі 1,68% құрады.

Есепті кезеңде орташа алынған кірістілігі жылына 4,75% құрайтын 0,10 млрд.теңге көлемінде ҚР корпоративтік облигациялары сатылған болатын.

ҚР эмитенттерінің корпоративтік облигацияларын сатып алулар және өтеулер болған жоқ.

Есепті кезеңде БЖЗҚ ЗА портфелінде ҚР эмитенттерінің корпоративтік облигацияларын өтеуге орташа алынған кірістілік жылына 7,0 % құрады.

ҚР квазимемлекеттік ұйымдардың облигациялары

Есепті айда ҚР квазимемлекеттік ұйымдардың облигацияларының көлемі 50,78 млрд.теңгеге артты және 713,97 млрд.теңгені құрады. Олардың портфелдегі үлесі 11,18% құрады.

Есепті кезеңде орташа алынған кірістілігі жылына 17,20% құрайтын 38,50 млрд.теңге көлемінде ҚР квазимемлекеттік ұйымдардың облигациялары сатып алынды.

Қарастырылып отырған кезеңде БЖЗҚ ЗА портфелінде ҚР квазимемлекеттік ұйымдардың облигацияларын сату және өтеу болған жоқ.

Есепті кезеңде БЖЗҚ ЗА портфелінде ҚР квазимемлекеттік ұйымдардың облигацияларын өтеуге орташа алынған кірістілік жылына 9,0% құрады.

ҚР екінші деңгейдегі банктерінің облигациялары

Есепті айда ҚР ЕДБ облигацияларының көлемі 11,06 млрд.теңгеге кеміді және 1 505,31 млрд.теңгені құрады. Олардың портфелдегі үлесі 23,57% құрады.

Қарастырылып отырған кезеңде БЖЗҚ ЗА портфелінде 22,46 млрд.теңге сомасына ЕДБ облигацияларының негізгі борышы өтелді.

Есепті кезеңдеБЖЗҚ ЗА портфелінде ЕДБ облигацияларын сатып алу және сату болған жоқ.

Есепті кезеңде БЖЗҚ ЗА портфелінде ҚР ЕДБ облигацияларын өтеуге орташа алынған кірістілік жылына 9,6% құрады.

Шетелдік эмитенттердің корпоративтік облигациялары

Есепті айда шетелдік эмитенттердің корпоративтік облигацияларының көлемі 9,68 млрд. теңгеге артты және 159,46 млрд. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 2,50% құрады.

Қарастырылып отырған кезеңде БЖЗҚ ЗА портфелінде шетелдік эмитенттердің корпоративтік облигацияларын сатып алу, сату және өтеу болған жоқ.

Есепті кезеңде БЖЗҚ ЗА портфелінде шетелдік эмитенттердің корпоративтік облигацияларын өтеуге орташа алынған кірістілік жылына 7,7% құрады.

Шетелдік эмитенттердің PPN (құрылымдық ноталар)

Есепті айда шетелдік эмитенттердің PPN (құрылымдық ноталар) көлемі 42,81 млрд. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 0,67% құрады.

Есепті кезеңде БЖЗҚ ЗА портфелінде шетелдік эмитенттердің PPN (құрылымдық ноталар) өтеулер, сатып алулар және сатулар болған жоқ.

ҚР эмитенттерінің акциялары және депозитарлық қолхаттары

Есепті айда ҚР эмитенттерінің акциялары мен депозитарлық қолхаттарының көлемі 11,17 млрд. теңгеге артты және 122,33 млрд. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 1,92 % құрады.

Есепті кезеңде ҚР эмитенттерінің акцияларын сату және сатып алу болған жоқ.

Шетелдік эмитенттердің акциялары және депозитарлық қолхаттары

Есепті айда шетелдік эмитенттердің акциялары мен депозитарлық қолхаттарының көлемі 17,34 млрд. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 0,27% құрады.

Есепті кезеңде шетелдік эмитенттердің акциялары мен депозитарлық қолхаттарын сату және сатып алу болған жоқ.

Туынды қаржы құралдары

Есепті кезеңде БЖЗҚ ЗА портфелінде жалпы сомасы 252,80 млн. АҚШ долларына «валюталық своп» операциясы жүзеге асырылды.

3-кесте. Валюталар бөлігінде ҚРҰБ басқаруындағы БЖЗҚ ЗА құрылымы

Валюта	01.07.16 жылға ағымдағы күн, млрд. теңге	01.07.16 ж. үлесі	01.08.16 жылға ағымдағы күн, млрд. теңге	01.08.16ж. үлесі	Соңғы айда өсуі/төмендеуі %
Ұлттық валюта	4 952,02	79,57%	5 139,88	80,49%	3,79%
АҚШ доллары	1 226,99	19,72%	1 200,62	18,80%	-2,15%
Ресей рублі	33,53	0,54%	33,53	0,54%	-0,02%
Малазия ринггиттері	5,11	0,08%	5,28	0,08%	3,36%
Бразилия реалдары	3,21	0,05%	3,31	0,05%	3,21%
Ағылшын фунт стерлингі	1,80	0,03%	2,01	0,03%	11,16%
Еуро	0,86	0,01%	0,87	0,01%	1,56%
Жиыны	6 223,52	100,00%	6 385,50	100,00%	2,60%

Инвестициялық қызметтің нәтижелері

2016 жылғы шілде айы үшін БЖЗҚ зейнетақы активтері бойынша есептелген инвестициялық табыс 117,40 млрд. теңгені құрады.

Инвестициялық табыс/шығын құрылымы:

- ✓ Бағалы қағаздар, орналастырылған салымдар және «кері РЕПО» операциялары бойынша есептелген сыйақыдан инвестициялық табыс 54,39 млрд. теңгені құрады.
- ✓ Бағалы қағаздарды қайта бағалаудан инвестициялық табыс 15,44 млрд.теңгені құрады.
- ✓ Валюта бағамдарының өзгерісінен инвестициялық табыс 47,57 млрд. теңгені құрады.

2016 жылғы шілде айы үшін БЖЗҚ шартты зейнетақы бірлігінің өсу қарқыны 1,79 % құрады.

Инвестициялық декларация параметрлерін сақтау туралы ақпарат

Сенімгерлік басқарудағы БЖЗҚ ЗА құрылымдық үйлестіруі БЖЗҚ Инвестициялық декларациясының талаптарына сәйкес келеді. Валюталық позициялар үлесі ұйғарынды деңгей шегінде қалады және БЖЗҚ Инвестициялық декларациясының талаптарын бұзбайды.

4-кесте. 01.08.2016 жылғы жағдай бойынша БЖЗҚ зейнетақы активтерін инвестициялау лимиттері

№ п/п	Қаржы құралдарының түрі	Нақты мәні (зейнетақы активтерінен пайызда)	Талаптардың орындалуы (иә/жоқ)
1	Шетелдік эмитенттер:	8,18%	иә
1.1	мемлекеттік, агенттік және халықаралық қаржы ұйымдарының бағалы қағаздары:	4,76%	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;	3,72%	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;	1,05%	иә
1.2	Корпоративтік борыштық бағалы қағаздар	2,49%	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	0,15%	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;	2,34%	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) пен активтерге (ABS) салынған бағалы қағаздар	0,00%	иә
1.4	Акциялар, акцияларға депозитарлық колхаттар	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	0,00%	иә

	деңгейінің рейтингтік бағасы бар шетелдік банктердегі депозиттер (салымдар)		
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	0,67%	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 рейтингі 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:	87,38%	иә
2.1	Қазақстан Республикасының мемлекеттік бағалы қағаздары	44,20%	иә иә
2.2	Квазимемлекеттік сектор субъектілерінің бағалы қағаздары	12,06%	иә
2.3	Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банктерінің қаржы құралдары	30,82%	иә
2.4	«Standard&Poor's» агенттігінің халықаралық шәкілі бойынша «B-» 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	0,10%	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	0,21%	иә
2.6	Қазақстан қор биржасының ресми тізіміне енгізілген ислам қаржыландыру құралдары	0,08%	иә

5-кесте. Қаржы құралдарының жекелеген түрлеріне БЖЗҚ зейнетақы активтерін инвестициялау лимиттері

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