

2013 жылға «БЖЗҚ» АҚ және ҚРҰБ арасында зейнетақы активтерін сенімгерлік басқару бойынша шарттарға сәйкес «БЖЗҚ» АҚ инвестициялық қызметі және зейнетақы активтерінің инвестициялық портфелі бойынша ақпарат

2013 жылғы 1 қазанға БЖЗҚ (бұдан әрі - Қор) зейнетақы активтері 741,29 млрд. теңгені құрады:

Инвестициялық портфель

1-кесте. Үлестер бойынша ЗА инвестициялық портфелінің құрылымы.

Портфельдегі қаржы құралының түрі	01.09.2013 үлесі	01.10.2013 үлесі
ҚР МБҚ	38.52%	40.72%
Шетелдік мемлекеттердің МБҚ	2.85%	2.89%
ХҚҰ	2.44%	2.43%
ҚР эмитенттерінің корпоративтік облигациялары	16.91%	16.81%
Шетелдік эмитенттердің корпоративтік облигациялары	0.14%	0.14%
PPN (құрылымдық ноттар)	1.05%	1.03%
ҚР эмитенттерінің акциялары мен депозитарлық қолхаттары	1.79%	1.72%
Шетелдік эмитенттердің акциялары мен депозитарлық қолхаттары	0.86%	0.91%
Асыл металдар (алтын)	8.94%	8.61%
Депозиттер	18.86%	17.51%
РЕПО	5.51%	3.66%
Ақша және өзге де активтер	2.13%	3.56%
ЗА (қалыпты) барлығы:	100,00%	100,00%

Қазақстан Республикасының мемлекеттік бағалы қағаздары

1-кестеге сәйкес, 2013 жылғы 1 қазандағы жағдай бойынша зейнетақы активтері инвестицияларының портфелі негізінде Қазақстан Республикасының мемлекеттік бағалы қағаздарымен ұсынылған. Портфельдегі осы қағаздардың үлесі 38,52%-дан 40,72%-ға артты. 01.10.2013 жылғы жағдай бойынша Қордың портфеліндегі ҚР МБҚ көлемі 301,8 млрд. теңгені құрады. ҚР МБҚ үлесінің артуы бағалы қағаздардың бастапқы нарығында 949,5 млн. теңге және сәйкесінше 19,5 млрд. теңге көлемінде МЕУКАМ-156 және МЕУЖКАМ-156 сатып алумен байланысты болды. Портфельдегі ҚР МБҚ бойынша өтеуге орташа алынған кірістілік жылына 4,80% құрады.

Шетелдік мемлекеттердің мемлекеттік бағалы қағаздары және Халықаралық қаржы ұйымдарының облигациялары

Шетелдік мемлекеттердің мемлекеттік бағалы қағаздарына және Халықаралық қаржы ұйымдарының облигацияларына инвестициялардың үлесі 2013 жылғы 1 қазандағы жағдай бойынша 2,89% және сәйкесінше 2,43% құрады. Портфельдегі шетел мемлекеттерінің мемлекеттік бағалы қағаздары және Халықаралық қаржы ұйымдарының облигациялары бойынша өтеуге орташа алынған кірістілік жылына 3,66% және сәйкесінше 5,23% құрайды.

Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банктеріндегі депозиттер

01.09.2013 жылдан бастап 01.10.2013 жылға дейінгі кезең үшін портфельдегі депозиттер үлесі төмендеді, және зейнетақы активтерінің 17,51% құрады. Мұндай төмендеу «Еуразиялық Банк» АҚ депозиттерді өтеумен байланысты болды.

Есептік күнге депозиттер Қазақстан Республикасының келесі банктеріне орналастырылды:

2-кесте. Екінші деңгейдегі банктердегі салымдар

№	Банктің атауы	Салым валютасы	Салымға енгізілген сома		сыйақы мөлшерлемесі жылдық пайызда
			шетел валютасында	теңге	
1	«АТФ Банк» АҚ	KZT	0,00	400 000 000,00	6,30
2	«АТФ Банк» АҚ	KZT	0,00	3 500 000 000,00	6,30
3	«АТФ Банк» АҚ	USD	25 000 000,00	3 685 000 000,00	7,00
4	«АТФ Банк» АҚ	USD	25 000 000,00	3 685 000 000,00	7,00
5	«Банк «РВК» АҚ	KZT	0,00	1 000 000 000,00	7,00
6	«Банк ВТБ» АҚ ЕБ	KZT	0,00	2 000 000 000,00	6,00
7	«Банк ВТБ» АҚ ЕБ	KZT	0,00	2 000 000 000,00	6,50
8	«Банк ВТБ» АҚ ЕБ	KZT	0,00	400 000 000,00	6,50
9	«Банк ЦентрКредит» АҚ	KZT	0,00	5 000 000 000,00	6,90
10	«Банк ЦентрКредит» АҚ	KZT	0,00	10 000 000 000,00	6,00
11	«Банк ЦентрКредит» АҚ	KZT	0,00	700 000 000,00	6,00
12	«Банк ЦентрКредит» АҚ	KZT	0,00	5 000 000 000,00	6,00
13	«Банк ЦентрКредит» АҚ	KZT	0,00	5 000 000 000,00	6,50
14	«Еуразиялық банк» АҚ	KZT	0,00	700 000 000,00	9,00
15	«Еуразиялық банк» АҚ	KZT	0,00	800 000 000,00	7,30
16	«Еуразиялық банк» АҚ	KZT	0,00	3 000 000 000,00	7,00
17	«Еуразиялық банк» АҚ	KZT	0,00	2 500 000 000,00	9,00
18	«Еуразиялық банк» АҚ	KZT	0,00	3 000 000 000,00	9,00
19	«Еуразиялық банк» АҚ	KZT	0,00	1 300 000 000,00	9,05
20	«Еуразиялық банк» АҚ	KZT	0,00	140 000 000,00	8,30
21	«Казкоммерцбанк» АҚ	USD	100 000 000,00	15 103 000 000,00	4,50
22	«Цеснабанк» АҚ	KZT	0,00	100 000 000,00	8,30
23	«Цеснабанк» АҚ	KZT	0,00	400 000 000,00	8,00
24	«Цеснабанк» АҚ	KZT	0,00	1 000 000 000,00	8,50
25	«Цеснабанк» АҚ	KZT	0,00	5 000 000 000,00	7,50
26	«Цеснабанк» АҚ	KZT	0,00	4 000 000 000,00	8,00
27	«Цеснабанк» АҚ	KZT	0,00	3 000 000 000,00	8,50
28	«Цеснабанк» АҚ	KZT	0,00	300 000 000,00	8,50
29	«KaspiBank» АҚ	KZT	0,00	3 500 000 000,00	7,00
30	«KaspiBank» АҚ	KZT	0,00	5 000 000 000,00	8,00
31	«KaspiBank» АҚ	KZT	0,00	1 000 000 000,00	7,50
32	«KaspiBank» АҚ	KZT	0,00	200 000 000,00	8,00
33	«KaspiBank» АҚ	KZT	0,00	600 000 000,00	8,00
34	«KaspiBank» АҚ	KZT	0,00	2 000 000 000,00	8,00
35	«Альфа-Банк» АҚ ЕБ	KZT	0,00	2 000 000 000,00	7,50
36	«Ресей Жинақбанкі» АҚ ЕБ	KZT	0,00	500 000 000,00	5,50
37	«Ресей Жинақбанкі» АҚ ЕБ	KZT	0,00	3 500 000 000,00	6,00
38	«Ресей Жинақбанкі» АҚ ЕБ	KZT	0,00	1 000 000 000,00	7,00
39	«Ресей Жинақбанкі» АҚ ЕБ	KZT	0,00	2 000 000 000,00	6,50
40	«Ресей Жинақбанкі» АҚ ЕБ	KZT	0,00	5 200 000 000,00	6,50
41	«Ресей Жинақбанкі» АҚ ЕБ	KZT	0,00	5 000 000 000,00	6,50
42	«Ресей Жинақбанкі» АҚ ЕБ	KZT	0,00	1 000 000 000,00	6,00
43	«Ресей Жинақбанкі» АҚ ЕБ	KZT	0,00	6 000 000 000,00	6,50
Барлығы:			150 000 000,00	121 213 000 000,00	

2-кестеден байқайтындарыңыздай, 01.10.2013 жылғы жағдай бойынша Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банктеріндегі ұлттық валютадағы салымдар сомасы 98,74 млрд. теңгені, шетелдік валютада 150,00 млн. АҚШ долларын құрады. Портфельдегі депозиттер бойынша өтеуге орташа алынған кірістілік жылына 6,69% құрады.

ҚР эмитенттерінің корпоративтік облигациялары

«БЖЗҚ» АҚ инвестициялық портфельіндегі зейнетақы активтері мемлекеттің қатысуы бар қазақстандық компаниялардың облигацияларына салынған:

«САМҰРЫҚ ҚАЗЫНА» ҰӘҚ» АҚ – үкіметтің бақылауындағы Қазақстан Республикасының мемлекеттік активтерін басқару бойынша холдинг;

«Қазмұнайгаз» АҚ – қазақстан ұлттық мұнай компаниясы;

«Қазақстан Даму Банкі» АҚ – Қазақстанның мемлекеттік банкі;

«Қазақстан ипотекалық компаниясы» АҚ – ипотекалық кредиттердің қайталама нарығының операторы болып табылады және халыққа ұзақ мерзімді ипотекалық кредит беретін кредиторларды қайта қаржыландыруды жүзеге асырады;

«Азық-түлік келісім-шарт корпорациясы» ҰК» АҚ – негізгі қызметі астықтың мемлекеттік қорларын және оның өнімдерін сатып алу, қалыптастыру, есепке алу, сақтауын ұйымдастыру, жаңарту, ауыстырылуын жүзеге асыруды қамтамасыз ету, сонымен қатар Қазақстан Республикасының Үкіметімен айқындалған басқа да қызметтер болып табылатын ұлттық компания;

«Маңғыстау электртораптық бөлу компаниясы» АҚ – электрмен қамдау аясындағы ірі компаниялардың бірі.

«Қазақстан Инжиниринг» АҚ – қорғаныс-өнеркәсіптік бөлік бойынша мәселелерді шешуге арналған Қазақстан Республикасының ұлттық компаниясы.

«Самрұқ-Энерго» АҚ – Қазақстандағы электрэнергиялық активтерді басқару жөніндегі мемлекеттік холдинг.

ҚР корпоративтік облигацияларының үлесі 16,81 % құрады.

Шетелдік эмитенттердің корпоративтік облигациялары, PPN (құрылымдық ноттар)

Инвестициялық портфельдегі шетелдік эмитенттердің корпоративтік облигациялары үлесі 0,14% құрады. Портфельдегі құрылымдық ноттардың үлесі портфельдегі зейнетақы активтерінен 1,03% құрады.

Инвестициялар ішінде мынадай шетелдік компаниялардың облигациялары бар:

JP Morgan Chase Bank – әлемдегі көне және ең беделді қаржы компанияларының бірі. Нью-Йоркте орналастырылған қаржы институты, инвестициялық және коммерциялық банктік қызметтер аясында көшбасшы болып саналады.

Bank of America Merrill Lynch - Bank of America бөлімшесі болып табылатын ірі корпоративтік және инвестициялық банк.

ҚР эмитенттерінің акциялары және депозитарлық қолхаттары

Есептік кезең үшін Қор портфельіндегі акциялар мен ҚР эмитенттерінің депозитарлық қолхаттарының үлесі 1,72 % құрады.

Инвестициялар ішінде мынадай ҚР компанияларының акциялары және депозитарлық қолхаттары бар:

«Қазақстанның Халықтық Жинақ банкі» АҚ – еліміздің ірі активтер көлемі бойынша екінші жүйекұраушы әмбебап коммерциялық банкі;

«Қазмұнайгаз БӨ» АҚ – қазақстан мұнай компаниясы. Акционерлік қоғам «ҚазМұнайГаз» Ұлттық компаниясы» АҚ еншілес банкі болып табылады;

«Қазақтелеком» АҚ – ұлттық байланыс операторы мәртебесі бар Қазақстанның ең ірі телекоммуникациялық компанияларының бірі;

«КазТрансОйл» - «Қазмұнайгаз» АҚ еншілес кәсіпорны, мұнай тасымалдаумен айналысады;

«Kcell» АҚ – ҚР ең ірі ұялы байланыс операторларының бірі.

Шетелдік эмитенттердің акциялары және депозитарлық қолхаттары

Есептік кезеңге портфельдегі шетелдік эмитенттердің акциялары үлесі 0,91% құрады. Инвестициялар ішінде мынадай шетелдік компаниялардың акциялары бар:

- Freeport-McMoRan Copper & Gold Inc. – әлемдегі ең төменгі шығасыларымен мыс өндіруші американдық компания, сонымен қатар әлемдегі ең ірі алтын өндірушілердің бірі;

- Deutsche bank – Германияның ірі банктік концерні. Банк негізінде инвестициялық – банктік және коммерциялық қызметтермен айналысады;
 - Deutsche Telekom – Еуропадағы ең ірі және көлемі жағынан әлемдегі үшінші германиялық телекоммуникация компаниясы;
 - Rio Tinto PLC – көлемі жағынан әлемде екінші трансұлттық кен ісі тобы болып табылатын австралия-британдық Rio Tinto Group концерніне енетін операциялық компанияның бірі;
 - Ресей Жинақбанкі – қызмет ауқымы бойынша да, филиалдық желі мөлшері бойынша да Ресейдегі ірі банк.
- «ВТБ Банк» БАҚ – ресейлік коммерциялық банкі. Активтер шамасы бойынша елдегі екінші банк (Жинақбанктен кейінгі) және жарғылық капитал мөлшері бойынша бірінші банк.

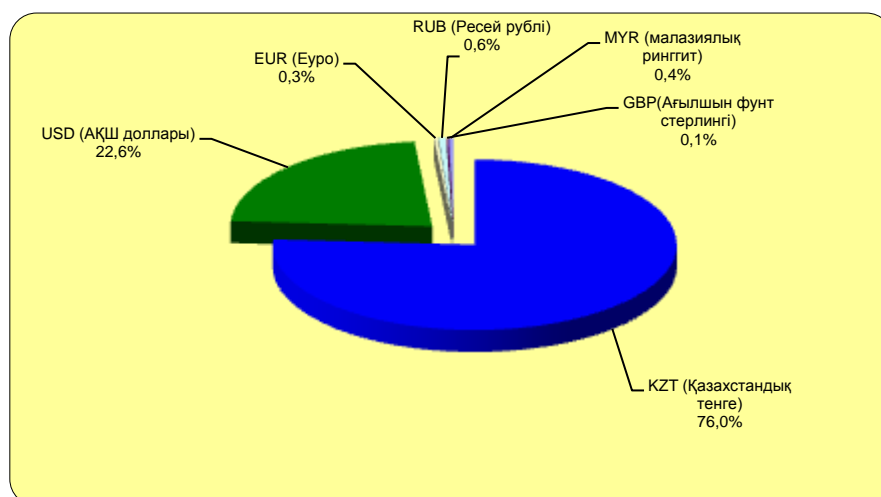
Бағалы металдар

Бағалы металдарға инвестициялар, алтынға инвестиция салу арқылы көрініс тапты. Инвестициялық портфельдегі алтынның үлесі 8,94 %-дан 8,61%-ға дейін төмендеді.

Ақшалар

Валюта тұрғысындағы зейнетақы активтерінің инвестициялық портфельдегі құрылымы ұлттық валютада 76,0 %, АҚШ доллары – 22,6%; ресей рублі – 0,6%; малазия рингит -0,4%; еуро -0,3%; ағылшын фунт стерлингi - 0,1% құрады.

1-сурет. Валюта тұрғысындағы ЗА портфелінің құрылымы



Инвестициялық қызметтің нәтижелері

2013 жылдың қыркүйек айы үшін зейнетақы активтері бойынша есептелген инвестициялық кіріс 3,62 млрд. теңгені құрады.

Уақытша инвестициялық декларацияның параметрлерін сақтау туралы ақпарат

Зейнетақы активтерін құрылымдық бөлу Қордың уақытша инвестициялық декларациясының талаптарына сәйкес келеді. Валюталық позициялардың үлестері ұйғарымды деңгей шеңберінде қалады және Қордың уақытша инвестициялық декларациясының талаптарын бұзбайды.

3-кесте. Инвестициялау нысандарының тізбесі және инвестициялау лимиттері

№№	Қаржы құралының түрі	Зейнетақы активтерінен инвестициялау лимиттері	Зейнетақы активтерінен үлес салмағы
Борышты құралдар		80 %-ға дейін	64,02 %-ға дейін
1	Қазақстан Республикасының Қаржы Министрлігі және Қазақстан	20 %-дан кем	43,87%

	Республикасының Ұлттық Банкі шығарған Қазақстан Республикасының мемлекеттік бағалы қағаздары (басқа мемлекеттің заңнамасына сәйкес эмитенттелген), сонымен қатар «кері РЕПО» операциясының мәні болып табылатын бағалы қағаздарды қосқанда Қазақстан Республикасы Үкіметінің кепілдігімен шығарылған бағалы қағаздар	емес	
2	Шетел мемлекеттерінің орталық үкіметімен шығарылған (берген) мемлекеттік мәртебесі бар бағалы қағаздар	35 %-дан кем емес	2,89%
3	Қор биржасының ресми тізіміне енген Қазақстан Республикасының жергілікті атқарушы органдары шығарған облигациялар	10 %-дан кем емес	0,52%
4	Қазақстан Республикасы эмитенттерінің мемлекеттік емес борыштық бағалы қағаздары, оның ішінде:	30 %-дан кем емес	16,81%
	1) Қазақстан Республикасы ұйымдарының ипотекалық облигациялары	15 %-дан кем емес	0,53%
	2) «Самрұқ-Қазына» ұлттық әл-ауқат қоры» акционерлік қоғамы шығарған борыштық бағалы қағаздар	10 %-дан кем емес	0,68%
5	халықаралық және шетел ұйымдары шығарған борыштық бағалы қағаздар	35 %-дан кем емес	2,57%
6	құрылымдық ноттар	5 %-дан кем емес	1,03%
	Үлесті құралдар	30 %-ға дейін	2,64%
7	Қазақстан Республикасының ұйымдары, шетел ұйымдары шығарған мемлекеттік емес үлесті бағалы қағаздар, оның ішінде	30 %-дан кем емес	2,64%
	1) Қазақстан Республикасының ұйымдары шығарған арапайым, артықшылықты акциялар және Қазақстан Республикасының ұйымдары шығарған акцияларға жаһандық депозитарлық қолхаттар және американдық депозитарлық қолхаттар (GDR, ADR), сонымен қатар қазақстандық акциялар индексіне фьючерстерді қосқанда мемлекеттік емес үлесті бағалы қағаздар	15 %-дан кем емес	1,72%
	2) шетел ұйымдары шығарған арапайым, артықшылықты акциялар және шетел ұйымдары шығарған акцияларға жаһандық депозитарлық қолхаттар және американдық депозитарлық қолхаттар (GDR, ADR), сонымен қатар шетелдік акциялар индексіне фьючерстерді қосқанда мемлекеттік емес үлесті бағалы қағаздар	30 %-дан кем емес	0,91%
	Екінші деңгейдегі банктердегі салымдар	25 %-ға дейін	17,51%
	Басқа құралдар	30 %-ға дейін	8,61%
8	Тазартылған қымбат металдар, оның ішінде метал депозиттері	10 %-ға дейін	8,61%
9	туынды қаржы құралдары, оның ішінде опцион, форвард, своп, фьючерс, егер олар инвестициялық тәуекелді хеджирлеуге пайдаланылатын болса	шектеусіз	0,00%
10	туынды қаржы құралдары, оның ішінде фьючерстер, опциондар, своптар, форвардтар	30 %-дан кем емес	0,00%
	Валюталық нетто-позиция	50 %-ға дейін	24,00%
11	АҚШ доллары, Еуро, Ағылшын фунт стерлингінде ашық валюталық позиция	50 %-дан кем емес	23,01%
12	Басқа валюталар бойынша ашық валюталық позиция	15 %-дан кем емес	0,99%