2015 жылғы шілде айы үшін «БЖЗҚ» АҚ зейнетақы активтерін инвестициялық басқару бойынша ақпарат

2015 жылғы 1 тамыздағы жағдай бойынша БЖЗҚ зейнетақы активтері (бұдан әрі - ЗА) 4 990,18 млрд. теңгені құрады.

Зейнетақы активтерінің портфелі

1-кесте. Қаржы құралдарының түрлері және олардың үлестері бойынша БЖЗҚ ЗА портфелінің құрылымы

Портфелдегі қаржы құралының түрі	01.07.2015 жылғы млрд.теңгемен ағымдағы құны	01.07.2015 ж. үлесі	01.08.2015 жылғы млрд.теңгемен ағымдағы құны	01.08.2015 ж. үлесі	ЗА өсімі
ҚР МБҚ	2 071,94	42,04%	2 159,16	43,27%	4,21%
Шетелдік мемлекеттердің МБҚ	51,94	1,05%	52,38	1,05%	0,85%
ХҚҰ	82,35	1,67%	82,37	1,65%	0,02%
ҚР эмитенттерінің корпоративтік облигациялары	1 593,14	32,32%	1 716,60	34,40%	7,75%
Шетелдік эмитенттердің корпоративтік облигациялары	92,06	1,87%	92,85	1,86%	0,85%
PPN (құрылымдық ноттар)	41,93	0,85%	41,09	0,82%	-2,02%
ҚР эмитенттерінің акциялары және депозитарлық қолхаттары	109,22	2,22%	101,98	2,04%	-6,63%
Шетелдік эмитенттердің акциялары және депозитарлық қолхаттары	9,77	0,20%	8,74	0,18%	-10,56%
Депозиттер	601,99	12,21%	543,31	10,89%	-9,75%
Инвестициялық шоттағы ақшалар	259,16	5,26%	181,09	3,63%	-30,13%
Басқа активтер (төлем шоттарындағы ақшалар)	15,46	0,31%	10,61	0,21%	-31,34%
ЗА барлығы	**4 928,96**	**100,00%**	**4 990,18**	**100,00%**	**1,24%**

БЖЗҚ ЗА табысы 2015 жылғы 01 қаңтардан бастап 2015 жылғы 31 шілдедегі кезең үшін 3,36 % құрады.

2-кесте. БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфелін үлестік бөлу

Қаржы құралының түрі	01.08.2015 жылға үлесі, %
Борыштық қаржы құралдары	93,94%
Үлестік қаржы құралдары	2,22%
Ақшалар	3,84%
Жиынтығы:	**100,00%**

БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфеліндегі борыштық қаржы құралдарын өтеуге орташа алынған кірістілік (YTM) 01.08.2015 жылғы жағдай бойынша жылына 7,15% құрады.

Соңғы ай үшін БЖЗҚ ЗА портфелі бойынша өзгерістер

3-кесте. 2015 жылғы шілде айы үшін зейнетақы активтерін инвестициялау

Қаржы құралдарының түрі	Валюта	Көлемі, млрд. теңге	Сатып алынғандардың орташа алынған кірістілігі жылына %
ҚР МБҚ	KZT	100,00	8,20
ҚР облигациялары	KZT	130,00	9,69
ҚР облигациялары	USD	0,60	6,36
ҚР акциялары	KZT	0,06	-
Жиынтығы:		**230,66**	**9,03**

Қазақстан Республикасының мемлекеттік бағалы қағаздары

БЖЗҚ ЗА портфелінде негізгі үлесті ҚР МБҚ құрайды, олардың көлемі есепті айда 87,22 млрд. теңгеге артты және 2 159,16 млрд. теңгені құрады. Олардың портфелдегі үлесі 43,27% құрады.

Есепті кезеңде орташа алынған кірістілігі жылына 8,20% құрайтын 100,00 млрд.теңге көлемінде ҚР ұзақмерзімді МБҚ сатып алынған болатын. Есепті кезеңде ҚР МБҚ өтелген жоқ және сатылған жоқ.

Есепті кезеңде БЖЗҚ ЗА портфелінде ҚР МБҚ өтеуге орташа алынған кірістілік жылына 5,50%-дан бастап жылына 5,62%-ға дейін артты.

Шетелдік мемлекеттердің мемлекеттік бағалы қағаздары

Есепті айда шетелдік мемлекеттердің мемлекеттік бағалы қағаздар көлемі 52,38 млрд. және теңгені құрады. Олардың портфелдегі үлесі 1,05% құрады.

Есепті кезеңде шетелдік мемлекеттердің МБҚ өтеулер, сатып алулар және сатулар болған жоқ.

Есепті кезеңде БЖЗҚ ЗА портфеліндегі шетелдік мемлекеттердің МБҚ өтеуге орташа алынған кірістілік жылына 2,97%-дан бастап жылына 2,75%-ға дейін азайды.

Халықаралық қаржы ұйымдарының облигациялары

Есепті айда Халықаралық қаржы ұйымдарының облигацияларының көлемі 0,02 млрд. теңгеге артты және 82,37 млрд. теңгені құрады. Олардың портфелдегі үлесі 1,65 % құрады.

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

Есепті кезеңде БЖЗҚ ЗА портфелінде Халықаралық қаржы ұйымдарының облигацияларын өтеуге орташа алынған кірістілік жылына 7,28% құрады.

Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банктеріндегі депозиттер

Есепті айда ЕДБ салымдардың көлемі 58,68 млрд. теңгеге азайды және 543,31 млрд. теңгені құрады. Портфелдегі олардың үлесі 12,21%-дан бастап 10,89%-ға дейін төмендеді.

Есепті кезеңде БЖЗҚ ЗА портфелінде 60,00 млрд.теңге сомасына ҚР ЕДБ салымдары өтелген болатын. Есепті кезеңде ҚР ЕДБ салымдары орналастырылған жоқ.

Есепті кезеңде БЖЗҚ ЗА портфелінде ЕДБ салымдарын өтеуге орташа алынған кірістілік 8,80% құрады.

ҚР эмитенттерінің корпоративтік облигациялары

Есепті айда ҚР эмитенттерінің корпоративтік облигацияларының көлемі 123,46 млрд. теңгеге ұлғайды және 1 716,60 млрд. теңгені құрады. Олардың портфелдегі үлесі 32,32%-дан 34,40%-ға дейін ұлғайды.

Есепті кезеңде орташа алынған кірістілігі жылына 9,67% құрайтын 130,60 млрд. теңге сомасына ҚР эмитенттерінің корпоративтік облигациялары сатып алынған болатын. Бұл ретте есепті кезеңде 13,50 млрд. теңге сомасына ҚР эмитенттерінің корпоративтік облигациялары өтелген болатын.

Есепті кезеңде БЖЗҚ ЗА портфелінде ҚР эмитенттерінің корпоративтік облигацияларын өтеуге орташа алынған кірістілік жылына 8,65% құрады.

Шетелдік эмитенттердің корпоративтік облигациялары

Есепті айда шетелдік эмитенттердің корпоративтік облигацияларының көлемі 0,79 млрд. теңгеге артты және 92,85 млрд. теңгені құрады. Олардың үлесі 1,86% құрады.

Шетелдік эмитенттердің корпоративтік облигацияларын өтеу, сатып алу және сату болған жоқ.

Есепті кезеңде БЖЗҚ ЗА портфелінде шетелдік эмитенттердің корпоративтік облигацияларын өтеуге орташа алынған кірістілік жылына 7,47% құрады.

Шетелдік эмитенттердің PPN (құрылымдық ноттар)

Есепті айда шетелдік эмитенттердің PPN (құрылымдық ноттар) көлемі 41,09 млрд. теңгені құрады. Олардың портфелдегі үлесі 0,82% құрайды.

Шетелдік эмитенттердің PPN (құрылымдық ноттар) өтеу, сатып алулар және сатулар болған жоқ.

ҚР эмитенттерінің акциялары және депозитарлық қолхаттары

Есепті айда ҚР эмитенттерінің акциялары мен депозитарлық қолхаттарының көлемі 7,24 млрд. теңгеге төмендеді және 101,98 млрд. теңгені құрады. Олардың портфелдегі үлесі 2,22%-дан бастап 2,04%-ға дейін төмендеді.

Есепті кезеңде 58,00 млн. теңге көлемінде ҚР эмитенттерінің акциялары сатып алынды. Бұл ретте есепті кезеңде 20,00 млн.теңге сомасына ҚР эмитенттерінің акциялары сатылған болатын.

Шетелдік эмитенттердің акциялары және депозитарлық қолхаттары

Есепті айда шетелдік эмитенттердің акциялары мен депозитарлық қолхаттарының көлемі 1,03 млрд. теңгеге азайды және 8,74 млрд. теңгені құрады. Олардың портфелдегі үлесі 0,18% құрады.

Есепті кезеңде шетелдік эмитенттердің акциялары мен депозитарлық қолхаттарын сатып алулар және сатулар болған жоқ.

Валюталар бойынша БЖЗҚ ЗА портфелін құрылымдық үлестіру

4-кесте. Валюталар бөлігінде БЖЗҚ ЗА портфелінің құрылымы

Валюта	01.07.15 жылға ағымдағы құн, млрд. теңге	01.07.15 ж. үлесі	01.08.15 жылға ағымдағы құн, млрд. теңге	01.08.15ж. үлесі	Соңғы айда өсуі/төмендеуі %
Ұлттық валюта	4 377,74	88,82%	4 441,30	89,00%	1,45%
АҚШ доллары	517,07	10,49%	521,46	10,45%	0,85%
Ресей рублі	22,06	0,45%	19,54	0,39%	-11,44%
Малазия ринггиттері	3,01	0,06%	3,00	0,06%	-0,30%
Еуро	1,06	0,02%	1,07	0,02%	0,73%
Ағылшын фунт стерлингі	1,56	0,03%	1,32	0,03%	-15,01%
Бразилия реалдары	2,39	0,05%	2,24	0,04%	-6,18%
Мексика песосы	0,25	0,01%	0,25	0,01%	-2,25%
Қытай юані	3,82	0,08%	0,00	0,00%	-100,00%
Жиыны	**4 928,96**	**100,00%**	**4 990,18**	**100,00%**	**1,24%**

Инвестициялық қызметтің нәтижелері

2015 жылғы шілде айы үшін БЖЗҚ зейнетақы активтері бойынша есептелген инвестициялық табыс 18,88 млрд. теңгені құрады.

Инвестициялық табыс/шығын құрылымы:

- ✓ Екінші деңгейдегі банктердегі салымдар бойынша инвестициялық табыс 4,21 млрд. теңгені құрады.
- ✓ Бағалы қағаздар бойынша инвестициялық табыс 14,49 млрд. теңгені құрады.
- ✓ Валюталық шоттардан инвестициялық табыс 0,18 млрд. теңгені құрады.

2015 жылғы шілде үшін БЖЗҚ шартты зейнетақы бірлігінің өсу қарқыны 0,31% құрады.

Инвестициялық декларация параметрлерін сақтау туралы ақпарат

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

5-кесте. 01.08.2015 жылғы жағдай бойынша инвестиция нысандарының тізбесі және лимиттері

№ р/с	Қаржы құралдарының түрі	Нақты мәні (зейнетақы активтерінен пайызда)	Талаптардың орындалуы (иә/жоқ)
Ақшалай қаражат		**3,63%**	иә
Борыштық құралдар		**82,61%**	иә
1	Қазақстан Республикасының Қаржы министрлігінің және Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкі шығарған Қазақстан Республикасының Мемлекеттік бағалы қағаздары (басқа мемлекеттердің заңнамаларына сәйкес эмитенттелген бағалы қағаздарды қоса алғанда), сонымен қатар «Кері РЕПО» операцияларының мәні болып табылатын бағалы қағаздарды қоса алғанда қазақстан Республикасы Үкіметінің кепілдігімен шығарылған бағалы қағаздар.	43,18%	иә
2	шетелдік мемлекеттердің орталық үкіметтерімен шығарылған мемлекеттік мәртебесі бар бағалы қағаздар, оның ішінде:	1,05%	иә
	1) «Standard&Poor's» агенттігінің халықаралық шәкілі бойынша «ВВВ-» төмен емес тәуелсіз рейтингісімен немесе басқа рейтинг агенттіктерінің бірінің осыған ұқсас деңгейінің рейтингісі;	0,49%	иә
	2) «Standard&Poor's» агенттігінің халықаралық шәкілі бойынша «ВВВ-» бастап «В» дейінгі тәуелсіз рейтингісімен немесе басқа рейтинг агенттіктерінің бірінің осыған ұқсас деңгейінің рейтингісі;	0,56%	иә
3	Қазақстан қор биржасының ресми тізіміне енгізілген Қазақстан Республикасының жергілікті атқарушы органдарымен шығарылған облигациялар	0,11%	иә
4	Екінші деңгейдегі банктерді қоспағанда Қазақстан Республикасы эмитенттерінің мемлекеттік емес борыштық бағалы қағаздары, оның ішінде:	10,34%	иә
	1) «Standard&Poor's» агенттігінің халықаралық шәкілі бойынша «В-» төмен емес рейтингтік бағасы бар немесе басқа рейтинг агенттіктерінің бірінің осыған ұқсас деңгейінің рейтингтік бағасы бар немесе «Standard&Poor's» агенттігінің ұлттық шәкілі бойынша «kzB» төмен емес рейтингтік бағасы немесе басқа рейтинг агенттіктерінің бірінің осыған ұқсас деңгейінің рейтингтік бағасы бар борыштық бағалы қағаздар;	0,00%	иә
	2) жалған мемлекеттік сектордың субьектілерімен шығарылған борыштық бағалы қағаздар;	7,96%	иә
	3) Қазақстан қор биржасының ресми тізіміне енгізілген кепілдемесі немесе мемлекеттік кепілдігі бар Қазақстан Республикасы ұйымдарының инфрақұрылымдық облигациялары;	0,56%	иә
	4) Қазақстан қор биржасының ресми тізіміне енгізілген борыштық бағалы қағаздар.	1,82%	иә
5	Келесі халықаралық қаржы ұйымдарымен шығарылған борыштық бағалы қағаздар: – Халықаралық Қайта құру және Даму банкі; – Европалық Қайта құру және Даму банкі; – Америкааралық даму банкі; – Халықаралық есеп банкі; – Азиялық Даму банкі; – Африкалық даму банкі; – Халықаралық қаржы корпорациясы;	1,65%	иә

	– Ислам Даму банкі; – Еуропалық инвестициялық банкі; – Еуразия Даму банкі		
6	Шетелдік ұйымдар шығарған мемлекеттік емес борыштық бағалы қағаздар, оның ішінде:	1,86%	иә
	1) «Standard&Poor's» агенттігінің халықаралық шәкілі бойынша «BBB-» төмен емес рейтингтік бағасы бар немесе басқа рейтинг агенттіктерінің бірінің осыған ұқсас деңгейінің рейтингтік бағасы бар;	0,10%	иә
	2) «Standard&Poor's» агенттігінің халықаралық шәкілі бойынша «BBB-» бастап «B» дейінгі рейтингтік бағасы немесе басқа рейтинг агенттіктерінің бірінің осыған ұқсас деңгейінің рейтингтік бағасы бар	1,76%	иә
7	«Standard&Poor's» агенттігінің халықаралық шәкілі бойынша «А-» төмен емес рейтингтік бағасы бар немесе басқа рейтинг агенттіктерінің бірінің осыған ұқсас деңгейінің рейтингтік бағасы бар ұйымдарымен шығарылған Principal protected notes.	0,52%	иә
Үлестік құралдар		**2,22%**	иә
8	Қазақстан Республикасы ұйымдарымен және шетелдік ұйымдармен шығарылған үлесті бағалы қағаздар, оның ішінде:	2,22%	иә
	1) Қазақстан Республикасының ұйымдары шығарған жай және артықшылықты акциялар, Қазақстан Республикасының ұйымдары шығарған акцияларға депозитарлық қолхаттар;	2,04%	иә
	2) шетелдік ұйымдар шығарған жай және артықшылықты акциялар, шетелдік ұйымдар шығарған акцияларға депозитарлық қолхаттар;	0,18%	иә
Екінші деңгейдегі қаржы құралдары, салымдарды қоса алғанда		**35,63%**	иә
Басқа құралдар		**0,00%**	иә
10	Лондондық бағалы металдар нарығының қауымдастығы (London bullion market association) қабылдаған және осы қауымдастықтың құжаттарында «Лондондық сапалы жеткізілім» («London good delivery») стандарты ретінде белгіленген халықаралық сапа стандарттарына сәйкес келетін тазартылған бағалы металдар және металл депозиттері, оның ішінде Standard & Poor’s агенттігінің халықаралық шәкілі бойынша «АА» төмен емес рейтингілік бағасы немесе басқа рейтингілік агенттіктердің бірінің осыған ұқсас деңгейдегі рейтингілік бағасы бар Қазақстан Республикасының резидент емес банктерінде он екі айдан аспайтын мерзімге салынған металл депозиттері	0,00%	иә
11	Туынды қаржы құралдары, қоса алғанда, алайда мұнымен шектелмейтін базалық активтері болып зейнетақы активтері есебінен сатып алуға рұқсат етілген қаржы құралдары, шетел валютасы, мынадай есеп айырысу көрсеткіштері (индекстер) табылатын фьючерстер, опциондар, своптар, форвардтар:	0,00%	иә
	1) Егер туынды қаржы құралдары инвестициялық тәуекелді хеджирлеу үшін пайдаланылатын болса;	0,00%	иә
	2) Есеп айырысу көрсеткіштері (индекстер): 1. MICEX (Moscow Interbank Currency Exchange Index); 2. DAX (Deutscher Aktien index); 3. CAC 40 (Compagnie des Agents de Change 40 Index); 4. NIKKEI - 225 (NIKKEI - 225 Index); 5. TOPIX (Tokyo Price Index); 6. HSI (Hang Seng Index); 7. ENXT 100 (Euronext 100); 8. RTSI (Russian Trade System Index); 9. DJIA (Dow Jones Industrial Average); 10. S&P 500 (Standard and Poor's 500 Index); 11. FTSE 100 (Financial Times Stock Exchange 100 Index); 12. KASE (Kazakhstan Stock Exchange); 13. MSCI World Index (Morgan Stanley Capital International World Index).	0,00%	иә
Валюталық нетто-позиция		**11,00%**	иә
12	АҚШ доллары, Еуро, Ағылшын фунт стрелингілеріндегі ашық валюталық позиция	10,50%	иә
13	Басқа валюталар бойынша ашық валюталық позиция	0,50%	иә