

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

2016 жылғы 1 ақпандағы жағдай бойынша Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкінің басқаруындағы (бұдан әрі - ҚРҰБ) БЖЗҚ зейнетақы активтері (бұдан әрі - ЗА) 5 960,91 млрд. теңгені құрады¹.

Зейнетақы активтерінің құрылымы

1-кесте. Зейнетақы активтері

Атауы	01.01.2016 жылғы млрд.теңгемен ағымдағы құны	01.01.2016 ж. үлесі	01.02.2016 жылғы млрд.теңгемен ағымдағы құны	01.02.2016 ж. үлесі	өсімі/төмендеуі
ҚР МБҚ	2 631,84	45,13%	2 754,69	46,21%	4,67%
Шетелдік мемлекеттердің МБҚ	50,67	0,87%	54,56	0,92%	7,68%
ХҚҰ	84,92	1,46%	86,01	1,44%	1,28%
ҚР эмитенттерінің корпоративтік облигациялары	2 212,56	37,94%	2 245,61	37,67%	1,49%
Шетелдік эмитенттердің корпоративтік облигациялары	165,76	2,84%	178,62	3,00%	7,76%
PPN (құрылымдық ноттар)	53,47	0,92%	55,51	0,93%	3,82%
ҚР эмитенттерінің акциялары және депозитарлық қолхаттары	113,09	1,94%	104,50	1,75%	-7,59%
Шетелдік эмитенттердің акциялары және депозитарлық қолхаттары	13,55	0,23%	12,70	0,21%	-6,33%
Депозиттер	363,93	6,24%	355,81	5,97%	-2,23%
РЕПО	51,32	0,88%	0,40	0,01%	-99,22%
Инвестициялық шоттағы ақшалар	76,32	1,31%	95,57	1,60%	25,23%
Басқа активтер (дебиторлық берешек, мерзімі өткен берешек, провизиялар, төлем шоттарындағы ақшалар) ²	14,03	0,24%	16,93	0,29%	20,69%
ҚРҰБ басқаруындағы ЗА жиынтығы	5 831,46	100,00%	5 960,91	100,00%	2,22%
Төлем шоттарындағы ақшалар	3,16		1,89		
ЗА барлығы	5 834,62		5 962,80		2,20%

2016 жылдың қаңтар айы үшін салымшылардың (алушылардың) шоттарына бөлінген БЖЗҚ зейнетақы активтерінің табыстылығы 1,7 % құрады.

¹ Төлем шоттарындағы ақшалардың есебінсіз 1,89 млрд. теңге көлемінде.

² Дебиторлық берешекке шығарылым проспектісіне 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	01.02.2016 жылға үлесі, %
Борыштық қаржы құралдары	96,15%
Үлестік қаржы құралдары	1,96%
Ақшалар	1,60%
Басқа активтер (дебиторлық берешек, мерзімі өткен берешек, провизиялар)	0,29%
ҚРҰБ басқаруындағы ЗА жиынтығы	100,00%

БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфеліндегі борыштық қаржы құралдарын өтеуге орташа алынған табыстылық (ҮТМ) 01.02.2016 жылғы жағдай бойынша жылына 9,8% құрады.

Соңғы ай үшін БЖЗҚ ЗА инвестициялануы

2015 жылдың аяғында Қазақстан Республикасының Ұлттық Банкі зейнетақы активтерін тек қана Қазақстан Республикасының мемлекеттік бағалы қағаздарына инвестициялау туралы шешім қабылдады. Бұл шешім экономикалық саясат кеңесімен расталды.

Аталған инвестициялық стратегия уақытша болып табылады және Қазақстан Республикасының Ұлттық қорын басқару кеңесі шешім қабылдағанға дейін әрекет етеді, ол «Қазақстан Республикасында зейнетақымен қамсыздандыру туралы» Қазақстан Республикасының 2013 жылғы 21 маусымдағы №105-V Заңына сәйкес 2016 жылғы 1 қаңтардан бастап БЖЗҚ зейнетақы активтерін инвестициялаудың бағыттарын анықтайды.

Қазақстан Республикасының мемлекеттік бағалы қағаздары

БЖЗҚ ЗА портфелінде негізгі үлесті ҚР МБҚ құрайды, олардың көлемі есепті айда 122,85 млрд. теңгеге артты және 2 754,69 млрд. теңгені құрады. Олардың портфелдегі үлесі 46,21% құрады.

Есепті кезеңде орташа алынған кірістілігі жылына 12,48% құрайтын 563,00 млрд.теңге көлемінде қысқамерзімді ҚР МБҚ сатып алынған болатын.

Сондай-ақ номинал құны 453,05 млрд. теңге көлеміндегі қысқамерзімді ҚР МБҚ өтелді. Есепті кезеңде ҚР МБҚ сатылған жоқ.

Есепті кезеңде БЖЗҚ ЗА портфелінде ҚР МБҚ өтеуге орташа алынған кірістілік жылына 11,2% құрады.

Шетелдік мемлекеттердің мемлекеттік бағалы қағаздары

Есепті айда шетелдік мемлекеттердің мемлекеттік бағалы қағаздар көлемі 54,56 млрд. теңгені құрады. Олардың портфелдегі үлесі 0,92% құрады.

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

Есепті кезеңде БЖЗҚ ЗА портфеліндегі шетелдік мемлекеттердің МБҚ өтеуге орташа алынған кірістілік жылына 5,2% құрады.

Халықаралық қаржы ұйымдарының облигациялары

Есепті айда Халықаралық қаржы ұйымдарының облигацияларының көлемі 1,09 млрд. теңгеге артты және 86,01 млрд. теңгені құрады. Олардың портфелдегі үлесі 1,44 % құрады.

Есепті кезеңде Халықаралық қаржы ұйымдарының облигацияларын 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 салымдардың көлемі 8,12 млрд. теңгеге кеміді және 355,81 млрд. теңгені құрады. Портфелдегі олардың үлесі 5,97% құрады.

Есепті кезеңде БЖЗҚ ЗА портфелінде 8,06 млрд.теңге сомасына ҚР ЕДБ салымдарының негізгі борышы өтелді. Есепті кезеңде ҚР ЕДБ салымдары орналастырылған жоқ.

Есепті кезеңде БЖЗҚ ЗА портфелінде ЕДБ салымдарын өтеуге орташа алынған кірістілік жылына 8,9% құрады.

ҚР эмитенттерінің корпоративтік облигациялары

Есепті айда ҚР эмитенттерінің корпоративтік облигацияларының көлемі 33,05 млрд. теңгеге ұлғайды және 2 245,61 млрд. теңгені құрады. Олардың портфелдегі үлесі 37,67% құрады.

Есепті кезеңде ҚР эмитенттерінің корпоративтік облигацияларын сатып алулар, сатулар мен өтеулер болған жоқ.

Есепті кезеңде БЖЗҚ ЗА портфелінде ҚР эмитенттерінің корпоративтік облигацияларын өтеуге орташа алынған кірістілік жылына 8,5 % құрады.

Шетелдік эмитенттердің корпоративтік облигациялары

Есепті айда шетелдік эмитенттердің корпоративтік облигацияларының көлемі 12,86 млрд. теңгеге артты және 178,62 млрд. теңгені құрады. Олардың үлесі 3,00% құрады.

Қарастырылып отырған кезеңде 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 7,5% құрады.

Шетелдік эмитенттердің PPN (құрылымдық ноттар)

Есепті айда шетелдік эмитенттердің PPN (құрылымдық ноттар) көлемі 55,51 млрд. теңгені құрады. Олардың портфелдегі үлесі 0,93% құрады.

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

ҚР эмитенттерінің акциялары және депозитарлық қолхаттары

Есепті айда ҚР эмитенттерінің акциялары мен депозитарлық қолхаттарының көлемі 8,59 млрд. теңгеге кеміді және 104,50 млрд. теңгені құрады. Олардың портфелдегі үлесі 1,75 % құрады.

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

Шетелдік эмитенттердің акциялары және депозитарлық қолхаттары

Есепті айда шетелдік эмитенттердің акциялары мен депозитарлық қолхаттарының көлемі 0,85 млрд. теңгеге кеміді және 12,70 млрд. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 0,21% құрады.

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

Валюталар бойынша БЖЗҚ ЗА құрылымдық үлестіру

3-кесте. Валюталар бөлігінде ҚРҰБ басқаруындағы БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфельінің құрылымы

Валюта	01.01.16 жылға ағымдағы құн, млрд. теңге	01.01.16 ж. үлесі	01.02.16 жылға ағымдағы құн, млрд. теңге	01.02.16ж. үлесі	Соңғы айда өсуі/төмендеуі %
Ұлттық валюта	4 840,72	83,01%	4 902,87	82,25%	1,28%
АҚШ доллары	950,91	16,31%	1 016,29	17,05%	6,88%
Ресей рублі	29,30	0,50%	30,79	0,52%	5,12%
Малазия ринггиттері	4,82	0,08%	5,37	0,09%	11,35%
Бразилия реалдары	2,81	0,05%	2,96	0,05%	5,02%
Ағылшын фунт стерлингі	1,53	0,03%	1,44	0,02%	-5,69%
Еуро	1,37	0,02%	1,19	0,02%	-13,42%
Жиыны	5 831,46	100,00%	5 960,91	100,00%	2,22%

Инвестициялық қызметтің нәтижелері

2016 жылғы қаңтар айы үшін БЖЗҚ зейнетақы активтері бойынша есептелген инвестициялық табыс 108,63 млрд. теңгені құрады.

Инвестициялық табыс/шығын құрылымы:

- ✓ Екінші деңгейдегі банктердегі салымдар бойынша инвестициялық табыс 2,54 млрд. теңгені құрады.
- ✓ Бағалы қағаздар бойынша инвестициялық табыс 100,05 млрд. теңгені құрады.
- ✓ Валюталық шоттардан инвестициялық табыс 6,04 млрд. теңгені құрады.

2016 жылғы қаңтар айы үшін БЖЗҚ шартты зейнетақы бірлігінің өсу қарқыны 1,7 % 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. 01.02.2016 жылғы жағдай бойынша инвестиция нысандарының тізбесі және лимиттері

№ р/с	Қаржы құралдарының түрі	Нақты мәні (зейнетақы активтерінен пайызда)	Талаптардың орындалуы (иә/жоқ)
	Ақшалай қаражат	1,31%	иә
	Борыштық құралдар	89,29%	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.	46,22%	иә
2	шетелдік мемлекеттердің орталық үкіметтерімен шығарылған мемлекеттік мәртебесі бар бағалы қағаздар, оның ішінде:	0,92%	иә
	1) «Standard&Poor's» агенттігінің халықаралық шәкілі бойынша «BBB-» төмен емес тәуелсіз рейтингісімен немесе басқа рейтинг агенттіктерінің бірінің осыған ұқсас деңгейінің рейтингісі;	0,02%	иә
	2) «Standard&Poor's» агенттігінің халықаралық шәкілі бойынша «BBB-» бастап «B» дейінгі тәуелсіз рейтингісімен немесе басқа рейтинг агенттіктерінің бірінің осыған ұқсас деңгейінің рейтингісі;	0,90%	иә
3	Қазақстан қор биржасының ресми тізіміне енгізілген Қазақстан Республикасының жергілікті атқарушы органдарымен шығарылған облигациялар	0,00%	иә
4	Екінші деңгейдегі банктерді қоспағанда Қазақстан Республикасы эмитенттерінің мемлекеттік емес борыштық бағалы қағаздары, оның ішінде:	10,76%	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 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 субъектілерімен шығарылған борыштық бағалы қағаздар;	8,95%	иә
	3) Қазақстан қор биржасының ресми тізіміне енгізілген кепілдемесі немесе мемлекеттік кепілдігі бар Қазақстан Республикасы ұйымдарының инфрақұрылымдық облигациялары;	0,46%	иә
	4) Қазақстан қор биржасының ресми тізіміне енгізілген борыштық бағалы қағаздар.	1,35%	иә
5	Келесі халықаралық қаржы ұйымдарымен шығарылған борыштық бағалы қағаздар: – Халықаралық Қайта құру және Даму банкі; – Еуропалық Қайта құру және Даму банкі; – Америкааралық даму банкі; – Халықаралық есеп банкі; – Азиялық Даму банкі; – Африкалық даму банкі; – Халықаралық қаржы корпорациясы; – Ислам Даму банкі; – Еуропалық инвестициялық банкі; – Еуразия Даму банкі	1,44%	иә
6	Шетелдік ұйымдар шығарған мемлекеттік емес борыштық бағалы қағаздар, оның ішінде:	2,8%	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;	0,13%	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	2,67%	иә
7	«Standard&Poor's» агенттігінің халықаралық шәкілі бойынша «A-» төмен емес рейтингтік бағасы бар немесе басқа рейтинг агенттіктерінің бірінің осыған ұқсас деңгейінің рейтингтік бағасы бар ұйымдарымен шығарылған Principalprotectednotes.	0,57%	иә
Үлестік құралдар		1,96%	иә
8	Қазақстан Республикасы ұйымдарымен және шетелдік ұйымдармен шығарылған үлесті бағалы қағаздар, оның ішінде:	1,96%	иә

	1) Қазақстан Республикасының ұйымдары шығарған жай және артықшылықты акциялар, Қазақстан Республикасының ұйымдары шығарған акцияларға депозитарлық қолхаттар;	1,75%	иә
	2) шетелдік ұйымдар шығарған жай және артықшылықты акциялар, шетелдік ұйымдар шығарған акцияларға депозитарлық қолхаттар;	0,21%	иә
Екінші деңгейдегі қаржы құралдары, салымдарды қоса алғанда		33,32%	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
	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
11	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		17,75%	иә
12	АҚШ доллары, Еуро, Ағылшын фунт стерлингілеріндегі ашық валюталық позиция	17,09%	иә
13	Басқа валюталар бойынша ашық валюталық позиция	0,6%	иә

Информация по инвестиционному управлению пенсионными активами АО «ЕНПФ» за январь 2016 года

По состоянию на 1 февраля 2016 года пенсионные активы (далее – ПА) ЕНПФ, находящиеся в управлении Национального Банка Республики Казахстан (далее – НБРК), составили 5 960,91 млрд. тенге³.

Структура пенсионных активов

Таблица 1 Пенсионные активы

Наименование	Текущая стоимость в млрд. тенге на 01.01.2016 г.	Доля на 01.01.2016 г.	Текущая стоимость в млрд. тенге на 01.02.2016 г.	Доля на 01.02.2016 г.	Прирост/ снижение
ГЦБ РК	2 631,84	45,13%	2 754,69	46,21%	4,67%
ГЦБ иностранных государств	50,67	0,87%	54,56	0,92%	7,68%
МФО	84,92	1,46%	86,01	1,44%	1,28%
Корпоративные облигации эмитентов РК	2 212,56	37,94%	2 245,61	37,67%	1,49%
Корпоративные облигации иностранных эмитентов	165,76	2,84%	178,62	3,00%	7,76%
PPN (структурные ноты)	53,47	0,92%	55,51	0,93%	3,82%
Акции и депозитарные расписки эмитентов РК	113,09	1,94%	104,50	1,75%	-7,59%
Акции и депозитарные расписки иностранных эмитентов	13,55	0,23%	12,70	0,21%	-6,33%
Депозиты	363,93	6,24%	355,81	5,97%	-2,23%
РЕПО	51,32	0,88%	0,40	0,01%	-99,22%
Деньги на инвестиционном счете	76,32	1,31%	95,57	1,60%	25,23%
Прочие активы (дебиторская задолженность ⁴ , просроченная задолженность, провизии)	14,03	0,24%	16,93	0,29%	20,69%
Итого ПА, находящиеся в управлении НБРК	5 831,46	100,00%	5 960,91	100,00%	2,22%
Деньги на выплатных счетах	3,16		1,89		
Итого пенсионные активы	5 834,62		5 962,80		2,20%

Доходность пенсионных активов ЕНПФ, распределенная на счета вкладчиков (получателей) за январь 2016 года, составила 1,7%.

Таблица 2. Долевое распределение ПА ЕНПФ, находящиеся в управлении НБРК

Вид финансового инструмента	Доля на 01.02.2016 г.
Долговые финансовые инструменты	96,15%
Долевые финансовые инструменты	1,96%

³ без учета денег на выплатных счетах в размере 1,89 млрд. тенге.

⁴ дебиторская задолженность включает суммы к получению по вознаграждению и/или основному долгу, по которым наступила купонная дата, но не закончился период погашения в соответствии с проспектом выпуска.

Деньги	1,60%
Прочие активы (дебиторская задолженность и просроченная задолженность, провизии)	0,29%
Итого ПА, находящиеся в управлении НБРК	100,00%

Средневзвешенная доходность к погашению (УТМ) долговых финансовых инструментов, находящихся в инвестиционном портфеле ПА ЕНПФ, по состоянию на 01.02.2016 года составила 9,8% годовых.

Инвестирование ПА ЕНПФ за последний месяц

В конце 2015 года Национальный Банк Республики Казахстан принял решение об инвестировании пенсионных активов только в государственные ценные бумаги Республики Казахстан. Данное решение также поддержано Советом по экономической политике.

Данная инвестиционная стратегия является временной и будет действовать до принятия решений Советом по управлению Национальным фондом Республики Казахстан, который в соответствии с Законом Республики Казахстан от 21 июня 2013 года №105-V «О пенсионном обеспечении в Республике Казахстан» с 1 января 2016 года определяет направления инвестирования пенсионных активов ЕНПФ.

Государственные ценные бумаги Республики Казахстан

Основную долю в портфеле ПА ЕНПФ составляют ГЦБ РК, объем которых за отчетный месяц увеличился на 122,85 млрд. тенге и составил 2 754,69 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 46,21%.

В отчетном периоде были приобретены краткосрочные ГЦБ РК в объеме 563,00 млрд. тенге со средневзвешенной доходностью 12,48% годовых.

Также произошло погашение краткосрочных ГЦБ РК номинальной стоимостью в размере 453,05 млрд. тенге. Продаж ГЦБ РК в отчетном периоде не было.

Средневзвешенная доходность к погашению ГЦБ РК в портфеле ПА ЕНПФ за отчетный период составила 11,2% годовых.

Государственные ценные бумаги иностранных государств

Объем государственных ценных бумаг иностранных государств в отчетном месяце составил 54,56 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 0,92%.

В отчетном периоде покупок, продаж и погашений ГЦБ иностранных государств не было.

Средневзвешенная доходность к погашению ГЦБ иностранных государств в портфеле ПА ЕНПФ за отчетный период составила 5,2% годовых.

Облигации Международных финансовых организаций

Объем облигаций Международных финансовых организаций в отчетном месяце увеличился на 1,09 млрд. тенге и составил 86,01 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 1,44%.

В отчетном периоде покупок, продаж и погашений ценных бумаг Международных финансовых организаций не было.

Средневзвешенная доходность к погашению облигаций Международных финансовых организаций в портфеле ПА ЕНПФ за отчетный период составила 7,3% годовых.

Депозиты в банках второго уровня Республики Казахстан

Объем вкладов в БВУ в отчетном месяце уменьшился на 8,12 млрд. тенге и составил 355,81 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 5,97%.

В отчетном периоде в портфеле ПА ЕНПФ произошло погашение основного долга вкладов БВУ РК на сумму 8,06 млрд. тенге. Размещений вкладов БВУ РК за отчетный период не было.

Средневзвешенная доходность к погашению вкладов БВУ в портфеле ПА ЕНПФ за отчетный период составила 8,9% годовых.

Корпоративные облигации эмитентов РК

Объем корпоративных облигаций эмитентов РК в отчетном месяце увеличился на 33,05 млрд. тенге и составил 2 245,61 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 37,67%.

В отчетном периоде покупок, продаж и погашений корпоративных облигаций эмитентов РК не было.

Средневзвешенная доходность к погашению корпоративных облигаций эмитентов РК в портфеле ПА ЕНПФ за отчетный период составила 8,5% годовых.

Корпоративные облигации иностранных эмитентов

Объем корпоративных облигаций иностранных эмитентов в отчетном месяце увеличился на 12,86 млрд. тенге и составил 178,62 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 3,00%.

За рассматриваемый период покупок, продаж и погашений корпоративных облигаций иностранных эмитентов не было.

Средневзвешенная доходность к погашению корпоративных облигаций иностранных эмитентов в портфеле ПА ЕНПФ за отчетный период составила 7,5% годовых.

PPN (структурные ноты) иностранных эмитентов

Объем PPN (структурных нот) иностранных эмитентов в отчетном месяце составил 55,51 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 0,93%.

Покупок, продаж и погашений PPN (структурных нот) иностранных эмитентов не было.

Акции и депозитарные расписки эмитентов РК

Объем акций и депозитарных расписок эмитентов РК в отчетном месяце уменьшился на 8,59 млрд. тенге и составил 104,50 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 1,75%.

В отчетном периоде продаж и покупок акций эмитентов РК не было.

Акции и депозитарные расписки иностранных эмитентов

Объем акций и депозитарных расписок иностранных эмитентов в отчетном месяце уменьшился на 0,85 млрд. тенге и составил 12,70 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 0,21%.

Покупок и продаж акций и депозитарных расписок иностранных эмитентов в отчетном периоде не было.

Структурное распределение ПА ЕНПФ по валютам

Таблица 3. Структура ПА ЕНПФ, находящиеся в управлении НБРК, в разрезе валют

Валюта	Текущая стоимость на 01.01.16 г., млрд. тенге	Доля на 01.01.16 г.	Текущая стоимость на 01.02.16 г., млрд. тенге	Доля на 01.02.16 г.	Прирост/снижение за последний месяц, %
Национальная валюта	4 840,72	83,01%	4 902,87	82,25%	1,28%
Доллары США	950,91	16,31%	1 016,29	17,05%	6,88%
Российские рубли	29,30	0,50%	30,79	0,52%	5,12%
Малазийские ринггиты	4,82	0,08%	5,37	0,09%	11,35%
Бразильские реалы	2,81	0,05%	2,96	0,05%	5,02%
Английские фунты стерлингов	1,53	0,03%	1,44	0,02%	-5,69%
Евро	1,37	0,02%	1,19	0,02%	-13,42%
Итого	5 831,46	100,00%	5 960,91	100,00%	2,22%

Результаты инвестиционной деятельности

За январь месяц 2016 года начисленный инвестиционный доход по пенсионным активам ЕНПФ составил 108,63 млрд. тенге.

Структура инвестиционного дохода/убытка:

✓ Инвестиционный доход по вкладам в банках второго уровня составил 2,54 млрд. тенге.

✓ Инвестиционный доход по ценным бумагам составил 100,05 млрд. тенге.

✓ Инвестиционный доход от валютных счетов составил 6,04 млрд. тенге.

Темп роста условной пенсионной единицы ЕНПФ за январь 2016 года составил 1,7%.

Информация о соблюдении параметров инвестиционной декларации

Структурное распределение ПА ЕНПФ, находящихся в доверительном управлении, соответствует требованиям Инвестиционной декларации ЕНПФ. Доли валютных позиций остаются в рамках допустимого уровня и не нарушают требований Инвестиционной декларации ЕНПФ.

Таблица 4. Перечень и лимиты объектов инвестирования по состоянию на 01.02.2016г.

№ п/п	Вид финансового инструмента	Фактическое значение (в процентах от пенсионных активов)	Выполнение требований (да/нет)
Денежные средства		1,31%	да
Долговые инструменты		89,29%	да
1	Государственные ценные бумаги Республики Казахстан (включая эмитированные в соответствии с законодательством других государств), выпущенные Министерством финансов Республики Казахстан и Национальным Банком Республики Казахстан, а также ценные бумаги, выпущенные под гарантию Правительства Республики Казахстан, включая ценные бумаги, являющиеся предметом операций «Обратного РЕПО».	46,22%	да
2	Ценные бумаги, имеющие статус государственных, выпущенные центральными правительствами иностранных государств, в том числе:	0,92%	да
	1) с суверенным рейтингом не ниже «BBB-» по международной шкале агентства «Standard&Poor's» или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств;	0,02%	да
	2) с суверенным рейтингом от «BBB-» до «B» по международной шкале агентства «Standard&Poor's» или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств.	0,90%	да
3	Облигации, выпущенные местными исполнительными органами Республики Казахстан, включенные в официальный список Казахстанской фондовой биржи.	0,00%	да
4	Негосударственные долговые ценные бумаги эмитентов Республики Казахстан, за исключением банков второго уровня, в том числе:	10,76%	да
	1) долговые ценные бумаги, имеющие рейтинговую оценку не ниже «B-» по международной шкале агентства «Standard&Poor's» или рейтинговую оценку аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, или рейтинговую оценку не ниже «kzB» по национальной шкале агентства «Standard&Poor's» или рейтинговую оценку аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств;	0,00%	да
	2) долговые ценные бумаги, выпущенные субъектами квазигосударственного сектора;	8,95%	да
	3) инфраструктурные облигации организаций Республики Казахстан, по которым имеется государственная гарантия или поручительство, включенные в официальный список Казахстанской фондовой биржи;	0,46%	да
	4) долговые ценные бумаги, включенные в официальный список Казахстанской фондовой биржи.	1,35%	да
5	Долговые ценные бумаги, выпущенные следующими международными финансовыми организациями: – Международным банком реконструкции и развития; – Европейским банком реконструкции и развития; – Межамериканским банком развития; – Банком международных расчетов; – Азиатским банком развития;	1,44%	да

	<ul style="list-style-type: none"> – Африканским банком развития; – Международной финансовой корпорацией; – Исламским банком развития; – Европейским инвестиционным банком; – Евразийским банком развития. 		
	Негосударственные долговые ценные бумаги, выпущенные иностранными организациями, в том числе:	2,8%	да
6	1) имеющими рейтинговую оценку не ниже «BBB-» по международной шкале агентства «Standard&Poog's» или рейтинговую оценку аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств;	0,13%	да
	2) имеющими рейтинговую оценку от «BBB-» до «B» по международной шкале агентства «Standard&Poog's» или рейтинговую оценку аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств.	2,67%	да
7	Principal protected notes, выпущенные организациями, имеющими рейтинговую оценку не ниже «A-» по международной шкале агентства «Standard&Poog's» или рейтинговую оценку аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств.	0,57%	да
Долевые инструменты		1,96%	да
8	Долевые ценные бумаги, выпущенные организациями Республики Казахстан и иностранными организациями, в том числе :	1,96%	да
	1) простые и привилегированные акции, выпущенные организациями Республики Казахстан, депозитарные расписки на акции, выпущенные организациями Республики Казахстан;	1,75%	да
	2) простые и привилегированные акции, выпущенные иностранными организациями, депозитарные расписки на акции, выпущенные иностранными организациями.	0,21%	да
Финансовые инструменты банков второго уровня, включая вклады		33,32%	да
Иные инструменты		0,00%	да
10	Аффинированные драгоценные металлы, соответствующие международным стандартам качества, принятым Лондонской ассоциацией рынка драгоценных металлов (Londonbullionmarketassociation) и обозначенным в документах данной ассоциации как стандарт «Лондонская качественная поставка» («Londongooddelivery») и металлические депозиты, в том числе в банках-нерезидентах Республики Казахстан, обладающих рейтинговой оценкой не ниже «AA» агентства «Standard&Poog's» или рейтингом аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, на срок не более двенадцати месяцев.	0,00%	да
11	Производные финансовые инструменты, включая, но не ограничиваясь, опцион, форвард, своп, фьючерс, базовым активом которых являются финансовые инструменты, разрешенные к приобретению за счет пенсионных активов, иностранная валюта, и расчетные показатели (индексы):	0,00%	да
	1) в случае если производные финансовые инструменты используются для хеджирования инвестиционного риска;	0,00%	да
	2) Расчетные показатели (индексы): 1. MICEX (Moscow Interbank Currency Exchange Index); 2. DAX (DeutscherAktienindex); 3. CAC 40 (Compagnie des Agents de Change 40 Index); 4. NIKKEI - 225 (NIKKEI - 225 Index); 5. TOPIX (TokyoPriceIndex); 6. HSI (HangSengIndex); 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 (KazakhstanStockExchange); 13. MSCI World Index (Morgan Stanley Capital International World Index).	0,00%	да
Валютная нетто-позиция		17,75%	да
12	Открытая валютная позиция в долларах США, Евро, Английском фунте стерлингов.	17,09	да
13	Открытая валютная позиция по другим валютам.	0,66%	да

