

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

2016 жылғы 1 сәуірдегі жағдай бойынша Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкінің басқаруындағы (бұдан әрі - ҚРҰБ) БЖЗҚ зейнетақы активтері (бұдан әрі - ЗА) 6 066,85 млрд. теңгені құрады¹.

Зейнетақы активтерінің құрылымы

1-кесте. Зейнетақы активтері

| Атауы | 01.03.2016 жылғы млрд.теңгемен ағымдағы құны | 01.03.2016 ж. үлесі | 01.04.2016 жылғы млрд.теңгемен ағымдағы құны | 01.04.2016 ж. үлесі | өсімі/төмендеуі |
|--|---|------------------------|---|------------------------|-----------------|
| ҚР МБҚ | 2 672,03 | 44,61% | 2 739,69 | 45,16% | 2,53% |
| Шетелдік мемлекеттердің МБҚ | 52,38 | 0,87% | 51,28 | 0,85% | -2,09% |
| ХҚҰ | 85,24 | 1,42% | 85,74 | 1,41% | 0,58% |
| ҚР эмитенттерінің корпоративтік облигациялары | 2 217,31 | 37,02% | 2 217,74 | 36,55% | 0,02% |
| Шетелдік эмитенттердің корпоративтік облигациялары | 169,94 | 2,84% | 168,57 | 2,78% | -0,81% |
| PPN (құрылымдық ноттар) | 40,80 | 0,68% | 42,55 | 0,70% | 4,29% |
| ҚР эмитенттерінің акциялары және депозитарлық қолхаттары | 107,63 | 1,80% | 112,19 | 1,85% | 4,24% |
| Шетелдік эмитенттердің акциялары және депозитарлық қолхаттары | 13,87 | 0,23% | 15,03 | 0,25% | 8,38% |
| Депозиттер | 355,53 | 5,93% | 338,13 | 5,57% | -4,89% |
| РЕПО | - | 0,00% | 18,20 | 0,30% | - |
| Инвестициялық шоттағы ақшалар | 270,06 | 4,51% | 267,51 | 4,41% | -0,94% |
| Басқа активтер (дебиторлық берешек, мерзімі өткен берешек, провизиялар, төлем шоттарындағы ақшалар) ² | 5,38 | 0,09% | 10,22 | 0,17% | 89,99% |
| ҚРҰБ басқаруындағы ЗА жиынтығы | 5 990,17 | 100,00% | 6 066,85 | 100,00% | 1,28% |
| Зейнетақы жарналары және төлемдері шоттарындағы ақшалар | 1,84 | | 1,62 | | -12,47% |
| ЗА барлығы | 5 992,01 | | 6 068,47 | | 1,28% |

01.01.2016 жылдан 31.03.2016 жылғы кезең үшін салымшылардың (алушылардың) шоттарына бөлінген БЖЗҚ зейнетақы активтерінің табыстылығы 2,4 % 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 | 01.04.2016 жылға үлесі, % |
|---|---------------------------|
| Борыштық қаржы құралдары | 93,32% |
| Үлестік қаржы құралдары | 2,10% |
| Ақшалар | 4,41% |
| Басқа активтер (дебиторлық берешек, мерзімі өткен берешек, провизиялар) | 0,17% |
| ҚРҰБ басқаруындағы ЗА жиынтығы | 100,00% |

БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфеліндегі борыштық қаржы құралдарын өтеуге орташа алынған табыстылық (ҮТМ) 01.04.2016 жылғы жағдай бойынша жылына 10,5% 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 67,66 млрд. теңгеге артты және 2 739,69 млрд. теңгені құрады. Олардың портфелдегі үлесі 45,16% құрады.

Есепті кезеңде сәйкесінше орташа алынған кірістілігі жылына 16,23% құрайтын 271,65 млрд.теңге көлемінде қысқамерзімді ҚР МБҚ сатып алынған болатын.

Сондай-ақ номинал құны 218,78 млрд. теңге көлемінде қысқамерзімді ҚР МБҚ өтелді.

Есепті кезеңде БЖЗҚ ЗА портфелінде ҚР МБҚ өтеуге орташа алынған кірістілік жылына 12,4% құрады.

Шетелдік мемлекеттердің мемлекеттік бағалы қағаздары

Есепті айда шетелдік мемлекеттердің мемлекеттік бағалы қағаздар көлемі 51,28 млрд. теңгені құрады. Олардың портфелдегі үлесі 0,85% 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 0,50 млрд. теңгеге артты және 85,74 млрд. теңгені құрады. Олардың портфелдегі үлесі 1,41 % 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 17,40 млрд. теңгеге кеміді және 338,13 млрд. теңгені құрады. Портфелдегі олардың үлесі 5,57% құрады.

Есепті кезеңде БЖЗҚ ЗА портфелінде 12,00 млрд.теңге сомасына негізгі борыш өтелді.

Қарастырылып отырған 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 0,43 млрд. теңгеге артты және 2 217,74 млрд. теңгені құрады. Олардың портфелдегі үлесі 36,55% құрады.

Есепті кезеңде БЖЗҚ ЗА портфелінде 0,68 млрд.теңге сомасына ҚР эмитенттерінің корпоративтік облигацияларының негізгі борышы өтелді.

Қарастырылып отырған кезеңде БЖЗҚ ЗА портфелінде ҚР эмитенттерінің корпоративтік облигацияларын сатып алулар мен сатулары болған жоқ.

ҚР эмитенттерінің корпоративтік облигацияларын сатып алулар және сатулар болған жоқ.

Есепті кезеңде БЖЗҚ ЗА портфелінде ҚР эмитенттерінің корпоративтік облигацияларын өтеуге орташа алынған кірістілік жылына 8,7 % құрады.

Шетелдік эмитенттердің корпоративтік облигациялары

Есепті айда шетелдік эмитенттердің корпоративтік облигацияларының көлемі 1,37 млрд. теңгеге азайды және 168,57 млрд. теңгені құрады. Олардың портфелдегі үлесі 2,78% құрады.

Қарастырылып отырған кезеңде БЖЗҚ ЗА портфелінде 0,28 млрд.теңге сомасына шетелдік эмитенттердің корпоративтік облигацияларының негізгі борышы өтелді.

Есепті кезеңде шетелдік эмитенттердің корпоративтік облигацияларын сатып алу және сату 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 42,55 млрд. теңгені құрады. Олардың портфелдегі үлесі 0,70% құрады.

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

ҚР эмитенттерінің акциялары және депозитарлық қолхаттары

Есепті айда ҚР эмитенттерінің акциялары мен депозитарлық қолхаттарының көлемі 4,56 млрд. теңгеге артты және 112,19 млрд. теңгені құрады. Олардың портфелдегі үлесі 1,85 % 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 1,16 млрд. теңгеге ұлғайды және 15,03 млрд. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 0,25% 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 құрылымы

| Валюта | 01.03.16 жылға ағымдағы күн, млрд. теңге | 01.03.16 ж. үлесі | 01.04.16 жылға ағымдағы күн, млрд. теңге | 01.04.16ж. үлесі | Соңғы айда өсуі/төмендеуі % |
|------------------------|--|-------------------|--|------------------|-----------------------------|
| Ұлттық валюта | 4 785,94 | 79,90% | 4 868,43 | 80,25% | 1,72% |
| АҚШ доллары | 1 164,37 | 19,44% | 1 154,63 | 19,03% | -0,84% |
| Ресей рублі | 29,29 | 0,49% | 32,71 | 0,53% | 11,69% |
| Малазия ринггиттері | 4,96 | 0,08% | 5,28 | 0,09% | 6,52% |
| Бразилия реалдары | 2,89 | 0,04% | 2,88 | 0,05% | -0,20% |
| Ағылшын фунт стерлингi | 1,69 | 0,03% | 1,88 | 0,03% | 11,31% |
| Еуро | 1,03 | 0,02% | 1,04 | 0,02% | 0,82% |
| Жиыны | 5 990,17 | 100,00% | 6 066,85 | 100,00% | 1,28% |

Инвестициялық қызметтің нәтижелері

2016 жылғы наурыз айы үшін БЖЗҚ зейнетақы активтері бойынша есептелген инвестициялық табыс 45,01 млрд. теңгені құрады.

Инвестициялық табыс/шығын құрылымы:

- ✓ Екінші деңгейдегі банктердегі салымдар бойынша инвестициялық табыс 2,48 млрд. теңгені құрады.
- ✓ Бағалы қағаздар бойынша инвестициялық табыс 45,84 млрд. теңгені құрады.
- ✓ Валюталық шоттардан инвестициялық шығын 3,31 млрд. теңгені құрады.

2016 жылғы наурыз айы үшін БЖЗҚ шартты зейнетақы бірлігінің өсу қарқыны 0,63 % 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. 01.04.2016 жылғы жағдай бойынша инвестиция нысандарының тізбесі және лимиттері

| № п/п | Қаржы құралдарының түрі | Нақты мәні (зейнетақы активтерінен пайызда) | Талаптардың орындалуы (иә/жоқ) |
|-------|-------------------------|---|--------------------------------|
| 1 | Борыштық құралдар: | 5,81% | иә |

| | | | |
|----------|---|---------------|-----------|
| 1.1 | Халықаралық қаржы ұйымдарының мемлекеттік, агенттік және бағалы қағаздары: | 2,26% | иә |
| 1) | «Standard&Poor's» агенттігінің халықаралық шәкілі бойынша «BBB-» төмен емес рейтингісімен немесе басқа рейтинг агенттіктерінің бірінің осыған ұқсас деңгейінің рейтингісімен; | 1,43% | иә |
| 2) | «Standard&Poor's» агенттігінің халықаралық шәкілі бойынша «BB+»-дан «BB-» дейін рейтингісімен немесе басқа рейтинг агенттіктерінің бірінің осыған ұқсас деңгейінің рейтингісімен; | 0,83% | иә |
| 1.2 | Корпоративтік борыштық бағалы қағаздар | 2,60% | 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 | 0,11% | 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; | 2,49% | 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 қолхаттар | 0,25% | иә |
| 1.5 | «Standard&Poor's» агенттігінің халықаралық шәкілі бойынша «А-» төмен емес рейтингтік бағасы бар немесе басқа рейтинг агенттіктерінің бірінің осыған ұқсас деңгейінің рейтингтік бағасы бар шетелдік банктердегі депозиттер (салымдар) | 0,00% | 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 ұйымдармен шығарылған құрылымдық өнімдер | 0,70% | 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 | 87,19% | иә |
| 2.1 | Қазақстан Республикасының мемлекеттік бағалы қағаздары | 45,16% | иә |
| | | | иә |
| 2.2 | Квазимемлекеттік сектор субъектілерінің бағалы қағаздары | 9,40% | иә |
| 2.3 | Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банктерінің қаржы құралдары | 32,22% | 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 | 0,11% | 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 | 0,25% | иә |
| 2.6 | Қазақстан қор биржасының ресми тізіміне енгізілген ислам қаржыландыру құралдары | 0,00% | иә |

5 - кесте. Жекеленген қаржы құралдары түрлеріне БЖЗҚ зейнетақы активтерін инвестициялау лимиті

| № р/с | Қаржы құралының түрі | Нақты мәні (зейнетақы активтерінен пайызбен) | Орындалуы (иә /жоқ) |
|-------|---|--|---------------------|
| 1 | стандартты туынды қаржы құралдары | 0,00% | иә |
| 1) | инвестициялық тәуекелді хеджирлеу үшін стандартты туынды қаржы құралдары қолданылатын болса | 0,00% | иә |
| 2 | металл шоттардағы және құймалардағы алтын | 0,00% | иә |