

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

2016 жылғы 1 қазандағы жағдай бойынша Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкінің басқаруындағы (бұдан әрі - ҚРҰБ) БЖЗҚ зейнетақы активтері (бұдан әрі - ЗА) 6 503,16 млрд. теңгені құрады¹.

Зейнетақы активтерінің құрылымы

1-кесте. Зейнетақы активтері

Атауы	01.09.2016 жылғы млрд.теңгемен ағымдағы құны	01.09.2016 ж. үлесі	01.10.2016 жылғы млрд.теңгемен ағымдағы құны	01.10.2016 ж. үлесі	өсімі/төм ендеуі	жыл басынан бер өсім/төм ендеуі
ҚР МБҚ	3 023,02	47,12%	2 919,21	44,89%	-3,43%	10,92%
Шетелдік мемлекеттердің МБҚ	76,89	1,20%	263,59	4,05%	242,79%	420,24%
ХҚҰ	85,53	1,33%	85,31	1,31%	-0,26%	0,45%
ҚР эмитенттерінің корпоративтік облигациялары	105,78	1,65%	104,13	1,60%	-1,56%	-16,42%
ҚР квазимемлекеттік ұйымдардың облигациялары	836,07	13,03%	836,93	12,87%	0,10%	62,49%
ҚР ЕДБ облигациялары	1 492,92	23,27%	1 497,98	23,04%	0,34%	-4,76%
Шетелдік эмитенттердің корпоративтік облигациялары	149,60	2,33%	139,47	2,15%	-6,77%	-15,86%
PPN (құрылымдық ноталар)	42,17	0,66%	35,74	0,55%	-15,23%	-33,15%
ҚР эмитенттерінің акциялары және депозитарлық қолхаттары	122,22	1,91%	128,27	1,97%	4,96%	13,43%
Шетелдік эмитенттердің акциялары және депозитарлық қолхаттары	16,91	0,26%	17,16	0,26%	1,49%	26,58%
Депозиттер	427,00	6,66%	425,02	6,54%	-0,46%	16,78%
РЕПО	0,50	0,01%	21,00	0,32%	4100,00%	-59,08%
Инвестициялық шоттағы ақшалар (қаржы құралдарымен мәмілелер бойынша міндеттемелер шегерімімен)	26,23	0,41%	21,70	0,33%	-17,29%	-71,57%
Басқа активтер (дебиторлық берешек, мерзімі өткен берешек, провизиялар) ²	10,25	0,16%	7,65	0,12%	-25,40%	-45,49%
ҚРҰБ басқаруындағы ЗА жиынтығы	6 415,09	100,00%	6 503,16	100,00%	1,37%	11,52%
Зейнетақы жарналары және төлемдері шоттарындағы ақшалар, сонымен қатар қаржы құралдарымен мәмілелер бойынша есеп айырысу үшін қаражаттар	2,38		69,85			
Зейнетақы активтерінің жиыны	6 417,47		6 573,01		2,42%	12,66%

¹ Зейнетақы жарналары мен төлемдері шоттарындағы ақшалар, сонымен қатар қаржы құралдарымен мәмілелер бойынша есеп айырысуға қаражаттар есебінсіз.

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

01.01.2016 жылдан 30.09.2016 жылғы кезең үшін салымшылардың шоттарына (шартты зейнетақы бірлігі - ШЗБ) бөлінген БЖЗҚ зейнетақы активтерінің табыстылығы 7,30% құрады. 2016 жылдың қыркүйек айына БЖЗҚ шартты зейнетақы бірлігінің өсу қарқыны 0,61% құрады.

2-кесте. ҚРҰБ басқаруындағы БЖЗҚ зейнетақы активтерін үлестік бөлу

Қаржы құралының түрі	01.10.2016 жылға үлесі
Борыштық қаржы құралдары	97,32%
Үлестік қаржы құралдары	2,23%
Ақшалар	0,33%
Басқа активтер (дебиторлық берешек және мерзімі өткен берешек, провизиялар)	0,12%
ҚРҰБ басқаруындағы ЗА жиыны	100,00%

БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфеліндегі борыштық қаржы құралдарын өтеуге орташа алынған табыстылық (ҮТМ) 01.10.2016 жылғы жағдай бойынша жылына 10,75% құрады.

Қазақстан Республикасының мемлекеттік бағалы қағаздары

БЖЗҚ ЗА портфелінде негізгі үлесті ҚР МБҚ құрайды, олардың көлемі есепті айда 103,81 млрд. теңгеге азайды және 2 919,21 млрд. теңгені құрады. Олардың портфелдегі үлесі 44,89% құрады.

Есепті кезеңде орташа алынған кірістілігі жылына 13,01% құрайтын 585,98 млрд.теңге көлемінде ҚРҰБ қысқамерзімді дисконтты ноттары сатып алынған болатын.

Есепті күнге 692,01 млрд.теңге сомасына ҚРҰБ дисконтты ноттары өтелді. Есепті кезеңде сату болған жоқ.

Есепті кезеңде БЖЗҚ ЗА портфелінде ҚР МБҚ өтеуге орташа алынған кірістілік жылына 12,5% құрады.

Шетелдік мемлекеттердің мемлекеттік бағалы қағаздары

Есепті айда шетелдік мемлекеттердің мемлекеттік бағалы қағаздар көлемі 186,70 млрд. теңгеге артты және 263,59 млрд. теңгені құрады. Олардың портфелдегі үлесі 4,05% құрады.

Есепті кезеңде орташа алынған кірістілігі жылына 3,42% құрайтын 20,67 млрд.теңге көлемінде АҚШ долларына номинацияланған РФ Қаржы министрлігінің облигациялары, орташа алынған кірістілігі жылына 0,08% құрайтын 167,56 млрд.теңге көлемінде АҚШ долларына номинацияланған АҚШ Қазынашылығының қысқамерзімді облигациялары сатып алынды. Есепті кезеңде сату және өтеу болған жоқ.

Есепті кезеңде БЖЗҚ ЗА портфеліндегі шетелдік мемлекеттердің МБҚ өтеуге орташа алынған кірістілік жылына 1,7% құрады.

Халықаралық қаржы ұйымдарының облигациялары

Есепті айда Халықаралық қаржы ұйымдарының облигацияларының көлемі 0,22 млрд. теңгеге төмендеді және 85,31 млрд. теңгені құрады. Олардың портфелдегі үлесі 1,31 % 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 1,98 млрд. теңгеге азайды және 425,02 млрд. теңгені құрады. Портфелдегі олардың үлесі 6,54% құрады.

Есепті кезеңде ЕДБ-ға БЖЗҚ ЗА орналастырылған және өтелген жоқ.

Есепті кезеңде БЖЗҚ ЗА портфелінде ЕДБ салымдарын өтеуге орташа алынған кірістілік жылына 10,9% құрады.

ҚР эмитенттерінің корпоративтік облигациялары

Есепті айда ҚР эмитенттерінің корпоративтік облигацияларының көлемі 1,65 млрд. теңгеге азайды және 104,13 млрд. теңгені құрады. Олардың портфелдегі үлесі 1,60% құрады.

Қаралып отырған кезеңде БЖЗҚ ЗА портфелінде 2,24 млрд.теңге сомасына ҚР корпоративтік сектор облигацияларының негізгі борышы өтелді. 0,23 млрд.теңге сомасына ҚР корпоративтік сектор облигациялары сатылды.

ҚР эмитенттерінің корпоративтік облигацияларын сатып алулар болған жоқ.

Есепті кезеңде БЖЗҚ ЗА портфелінде ҚР эмитенттерінің корпоративтік облигацияларын өтеуге орташа алынған кірістілік жылына 9,4 % құрады.

ҚР квазимемлекеттік ұйымдардың облигациялары

Есепті айда ҚР квазимемлекеттік ұйымдардың облигацияларының көлемі 0,86 млрд.теңгеге артты және 836,93 млрд.теңгені құрады. Олардың портфелдегі үлесі 12,87% құрады.

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

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

ҚР екінші деңгейдегі банктерінің облигациялары

Есепті айда ҚР ЕДБ облигацияларының көлемі 5,06 млрд.теңгеге артты және 1 497,98 млрд.теңгені құрады. Олардың портфелдегі үлесі 23,03% құрады.

Есепті кезеңде БЖЗҚ ЗА портфелінде ҚР ЕДБ облигацияларын сатып алу, сату және өтеу 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 10,13 млрд. теңгеге азайды және 139,47 млрд. теңгені құрады. Олардың портфелдегі үлесі 2,14% құрады.

Қарастырылып отырған кезеңде орташа алынған кірістілік жылына 5,54% құрайтын 9,43 млрд.теңге көлемінде АҚШ долларына номинацияланған шетелдік эмитенттердің корпоративтік облигациялары сатылды.

Есепті кезеңде БЖЗҚ ЗА портфелінде шетелдік эмитенттердің корпоративтік облигацияларын сатып алу және өтеу болған жоқ.

Есепті кезеңде БЖЗҚ ЗА портфелінде шетелдік эмитенттердің корпоративтік облигацияларын өтеуге орташа алынған кірістілік жылына 7,9% құрады.

Шетелдік эмитенттердің PPN (құрылымдық ноттар)

Есепті айда шетелдік эмитенттердің PPN (құрылымдық ноттар) көлемі 35,74 млрд. теңгені құрады. Олардың портфелдегі үлесі 0,55% құрады.

Есепті кезеңде БЖЗҚ ЗА портфелінде 7,33 млрд. теңге көлемінде құрылымдық ноттар өтелді. Шетелдік эмитенттердің PPN (құрылымдық ноталар) сатып алулар және сатулар болған жоқ.

ҚР эмитенттерінің акциялары және депозитарлық қолхаттары

Есепті айда ҚР эмитенттерінің акциялары мен депозитарлық қолхаттарының көлемі 6,05 млрд. теңгеге артты және 128,27 млрд. теңгені құрады. Олардың портфелдегі үлесі 1,97 % 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 17,16 млрд. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 0,26% 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 721,60 млн. АҚШ долларына «валюталық своп» операциясы жүзеге асырылды.

3-кесте. Валюталар бөлігінде ҚРҰБ басқаруындағы БЖЗҚ ЗА құрылымы

Валюта	01.09.16 жылға ағымдағы күн, млрд. теңге	01.09.16 ж. үлесі	01.10.16 жылға ағымдағы күн, млрд. теңге	01.10.16ж. үлесі	Соңғы айда өсуі/төмендеуі %	Жыл басынан өсуі/төмендеуі %
Ұлттық валюта	5 232,49	81,57%	5 153,78	79,25%	-1,50%	6,47%
АҚШ доллары	1 138,12	17,74%	1 304,79	20,06%	14,64%	37,21%
Ресей рублі	33,26	0,52%	33,78	0,52%	1,55%	15,29%
Малайзия рингиттері	5,00	0,08%	4,86	0,08%	-2,98%	0,74%
Бразилия реалдары	3,27	0,05%	3,22	0,05%	-1,50%	14,57%
Ағылшын фунт стерлингі	2,14	0,03%	2,00	0,03%	-6,40%	30,76%
Еуро	0,81	0,01%	0,73	0,01%	-10,40%	-46,81%
Жиыны	6 415,09	100,00%	6 503,16	100,00%	1,37%	11,52%

Инвестициялық қызметтің нәтижелері

Инвестициялық табыс/шығынның құрылымы:

Атауы	2016 жылғы қыркүйек айы үшін, млрд. теңге	2016 жылдың басынан млрд. теңге	Жыл басынан құрылымы
бағалы қағаздар, орналастырылған салымдар және «кері РЕПО» операциялары бойынша есептелген сыйақыдан	54,30	475,26	98,63%
бағалы қағаздарды қайта бағалаудан	7,30	18,85	3,91%
валюта бағамдарының өзгерісінен	-14,76	-12,23	-2,54%
Жиыны	46,84	481,88	100,00%

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. 01.10.2016 жылғы жағдай бойынша БЖЗҚ зейнетақы активтерін инвестициялау лимиттері

№ р/р	Қаржы құралдарының түрі	Нақты мәні (зейнетақы активтерінен пайызда)	Талаптардың орындалуы (иә/жоқ)
1	Шетелдік эмитенттер:	8,31%	иә
1.1	мемлекеттік, агенттік және халықаралық қаржы ұйымдарының бағалы қағаздары:	5,37%	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;	3,91%	иә
2)	«Standard&Poor's» агенттігінің халықаралық шәкілі бойынша «BB+»-дан «BB-» дейін рейтинг бағасы бар	1,46%	иә

	немесе басқа рейтинг агенттіктерінің бірінің осыған ұқсас деңгейінің рейтинг бағасы бар;		
1.2	Корпоративтік борыштық бағалы қағаздар	2,13%	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	0,14%	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;	1,99%	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	0,26%	иә
1.5	«Standard&Poor's» агенттігінің халықаралық шәкілі бойынша «A-» 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 ұйымдар шығарған құрылымдық өнімдер	0,55%	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 рейтинг 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:	89,30%	иә
2.1	Қазақстан Республикасының мемлекеттік бағалы қағаздары	44,89%	иә иә
2.2	Квзимемлекеттік сектор субъектілерінің бағалы қағаздары	13,77%	иә
2.3	Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банктерінің қаржы құралдары	30,36%	иә
2.4	«Standard&Poor's» агенттігінің халықаралық шәкілі бойынша «B-» төмен емес бағалы қағаздар және/немесе эмитент рейтинг бағасы бар немесе басқа рейтинг агенттіктерінің бірінің осыған ұқсас деңгейінің рейтингтік бағасы бар Қазақстан Республикасының квзимемлекеттік 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	0,19%	иә
2.6	Қазақстан қор биржасының ресми тізіміне енгізілген ислам қаржыландыру құралдары	0,07%	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