



QAZAQSTAN ULTTYQ BANKI

АҚПАРАТТЫҚ ХАБАР

2019 жылғы 27 қараша

БЖЗҚ зейнетақы активтері бойынша инвестициялық қызметке 2019 жылғы қазандағы қысқаша шолу

Жалпы портфель. БЖЗҚ зейнетақы активтерін инвестициялау стратегиясына сәйкес инвестициялық портфельді сақталуы мен кірістілігін қамтамасыз етуге бағытталған әртараптандыру мақсатында зейнетақы активтері валюталар, елдер, секторлар және эмитенттер бойынша әртүрлі қаржы құралдарына инвестицияланды.

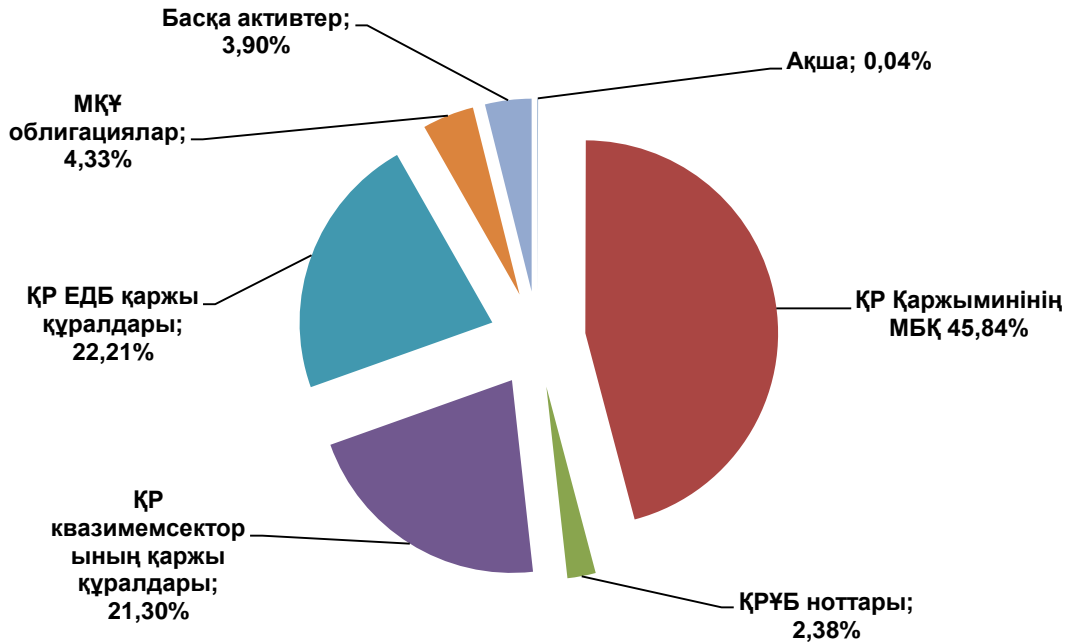
2019 жылғы 1 қарашадағы жағдай бойынша БЖЗҚ зейнетақы активтері портфелінің көлемі **10 564,4 млрд теңгені** құрады. Ақша қаражаты және теңгеге номинирленген қаржы құралдары **6 949,8 млрд теңгені** немесе 65,8%-ды, шетел валютасына номинирленген қаржы құралдары **3 614,6 млрд теңгені** немесе 34,2%-ды құрады.



* валюталық своп мәмілелері аясында алынған валютаны ескере отырып

Теңгемен номинирленген зейнетақы активтерінің портфелі. БЖЗҚ-ның теңгемен номинирленген зейнетақы активтері Қазақстан Республикасының Ұлттық қорын басқару жөніндегі кеңес жыл сайын мақұлдайтын бағыттар шеңберінде ғана инвестицияланады.

Теңгелік портфельдің құрылымы



Теңгемен инвестициялар. 2019 жылғы қазанда теңгемен номинирленген зейнетақы активтерін инвестициялау көлемі **192,03 млрд теңге** (ақша нарығы құралдарына инвестицияларды есептемегенде¹) болды, оның ішінде:

- ҚР Қаржы министрінің жылдық 9,6% орташа алынған кірістілігі бар жалпы сомасы 12,88 млрд теңгеге МБҚ сатып алынды;
- «ҚТЖ» ҰК» АҚ-тың жылдық 11,5% кірістілігі бар 170,0 млрд теңге сомаға облигациялары сатып алынды;
- ҚР ЕДБ арқылы 600 млрд теңге сомаға басым жобаларды кредиттеу тетігі шеңберінде 7,50 млрд. теңге сомаға «Альфа-Банк» ЕБ» АҚ-тың және «Аграрлық кредиттік корпорация» АҚ-тың жылдық 10,75% кірістілігі бар 1,65 млрд теңге сомаға облигациялары сатып алынды.

Теңгемен бос ақша қаражаты ақша нарығының қысқа мерзімді құралдарына да орналастырылған. Бұл ретте осы инвестициялар инвестициялаудың стратегиялық мақсаты болып табылмайды және зейнетақы активтерінің кірістілігін қолдау үшін ағымдағы өтімділікті басқару шеңберінде жүзеге асырылады.

Теңгемен өтеу. 2019 жылғы қазанда бағалы қағаздар эмиссияларының проспектісінде белгіленген мерзімдерге сәйкес 29,9 млрд. теңге жалпы сомада облигациялар бойынша негізгі борыш өтелді, оның ішінде:

- Еуразиялық Даму Банк 19,9 млрд. теңге сомада;
- «Баспана» Ипотекалық ұйымы» АҚ 10,0 млрд. теңге сомада.

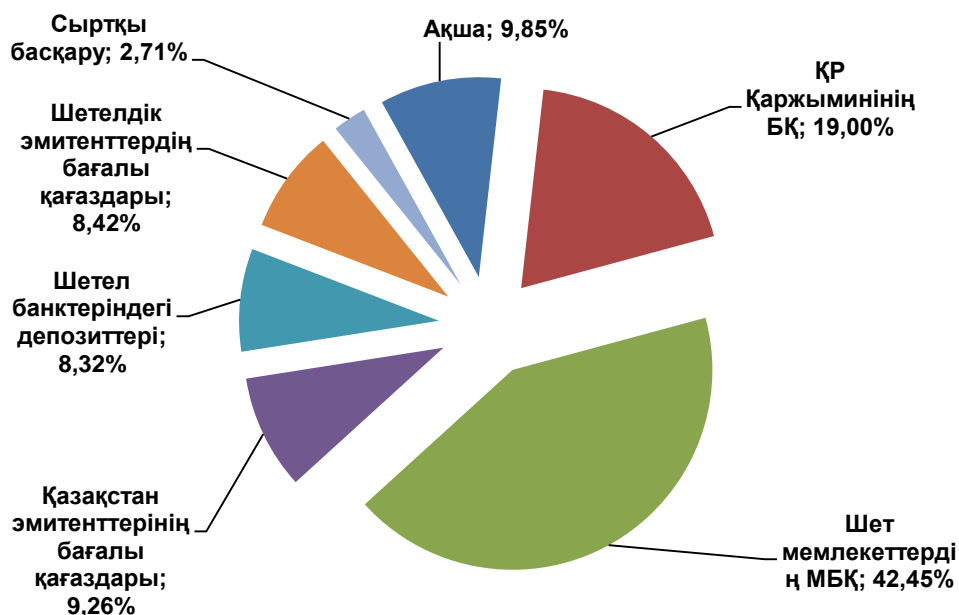
Банктік салым шарттарында белгіленген талаптарға сәйкес ҚР ЕДБ депозиттері бойынша 2,5 млрд. теңге жалпы сомада негізгі борыш және мерзімінен бұрын негізгі борыш ішінара өтелді.

Шетел валютасымен номинирленген зейнетақы активтерінің портфелі.

¹ ҚРҰБ ноттары мен депозиттері, ҚР МБҚ кепілімен «Кері репо» операциялары

БЖЗҚ-ның шетел валютасында номинирленген зейнетақы активтері БЖЗҚ-ның Инвестициялық декларациясында белгіленген валюталық активтердің жалпы құрылымына және инвестициялау стратегиясына сәйкес инвестицияланады.

Валюталық портфельдің құрылымы



Шетел валютасындағы инвестициялар. 2019 жылғы қазанда шетел валютасында номинирленген зейнетақы активтерін инвестициялау көлемі **267,6 млрд теңге** болды.

Есепті кезеңде жылдық 1,65% орташа алынған кірістілікпен **238,5 млрд. теңге** көлемде АҚШ-тың қысқамерзімді МБҚ сатып алынды.

Қарастырылып отырған кезеңде мынадай елдердің МБҚ-мен сатып алу-сату мәмілелері жасалды: Ресей Федерациясы, Филиппин, Перу, Индонезия, Мексика, Бразилия. Нетто-сату көлемі қарастырылып отырған кезеңде 131,0 млрд теңгені құрады.

Қарастырылып отырған кезеңде «А» және одан жоғары кредиттік рейтингпен ірі халықаралық инвестициялық банктер қатарында 6 айдан 9 айға дейінге мерзімге 327,0 млн АҚШ доллары көлемінде USD/JPY валюталық своп мәмілелері жасалды. Осы мәмілелер нарықтық жағдайларда зейнетақы активтерінің кірістілігін арттыру мақсатында жасалды. Осы мәмілелер шеңберінде БЖЗҚ-ның зейнетақы активтері портфеліне 35,3 млрд жапон йені алынды.

Қарастырылып отырған кезеңде шетел валютасымен бос ақша қаражаты «А-»-тен төмен емес рейтингтік бағасы бар шетел банктерінің қысқа мерзімді депозиттеріне орналастырылды. Бұл ретте осы инвестициялар инвестициялаудың стратегиялық мақсаты болып табылмайды және зейнетақы активтерінің кірістілігін қолдау үшін ағымдағы өтімділікті басқару шеңберінде жүзеге асырылады.

Шетел валютасымен өтеу және сату. 2019 жылғы қазанда бағалы қағаздардың эмиссиясы проспектілерінде белгіленген мерзімдерге сәйкес **208,3 млрд теңге** сомаға АҚШ Үкіметінің МБҚ бойынша негізгі борышты өтеу жүргізілді.

Инвестициялық қызметтің нәтижелері. 2019 жылдың басынан бастап есептелген инвестициялық кірістің мөлшері **599,3 млрд теңгені** құрады. 2019 жылдың басынан бастап

зейнетақы активтерінің салымшылардың (алушылардың) шоттарына бөлінген кірістілігі 5,67% болды.

Бұл ретте 2019 жылғы 1 қарашадағы жағдай бойынша БЖЗҚ салымшылары (алушылары) үшін соңғы 12 айдағы (2018 жылғы қарашадан бастап 2019 жылғы қазан аралығы) зейнетақы активтерінің кірістілігі 5,5% мөлшердегі инфляция кезінде **8,0%**-ды құрады. Осылайша, соңғы 12 айда БЖЗҚ-ның зейнетақы активтері бойынша нақты кірістілік **2,5%**-ды құрады.

Толығырақ ақпаратты БАҚ өкілдері мынадай телефон бойынша алуына болады:

+7 (727) 2704 591 (3930)

+7 (727) 330 24 52 (1452)

e-mail: press@nationalbank.kz

www.nationalbank.kz