

Информация по инвестиционному управлению пенсионными активами, находящимися в доверительном управлении АО «Jusan Invest»

По состоянию на 01.03.2023г. пенсионные активы, находящиеся в доверительном управлении АО «Jusan Invest» (далее – Jusan Invest), составили 4 236,36 млн тенге.

Структура инвестиционного портфеля финансовых инструментов, сформированного за счет пенсионных активов, переданных в доверительное управление Jusan Invest, представлена в Таблице 1.

Таблица 1. Структура инвестиционного портфеля пенсионных активов, находящихся в доверительном управлении Jusan Invest, в разрезе финансовых инструментов

Наименование	Текущая стоимость на 01.01.2023	Доля на 01.01.2023	Текущая стоимость на 01.03.2023	Доля на 01.03.2023	Прирост/ снижение с начала года, %
ГЦБ МФ РК	718,26	17,14%	922,63	21,78%	28,45%
Ноты НБРК	1 792,94	42,79%	831,38	19,63%	-53,63%
ГЦБ иностранных государств	369,93	8,83%	356,77	8,42%	-3,56%
Паи Exchange Traded Funds (ETF)	1 274,83	30,43%	1 253,95	29,60%	-1,64%
Денежные средства на инвестиционных счетах	31,43	0,75%	137,80	3,25%	338,40%
Репо	0,00	0,00%	731,46	17,27%	-
Прочие активы	2,30	0,05%	2,35	0,06%	2.13%
Итого пенсионные активы, находящиеся в управлении АО «Jusan Invest» [1]	4 189,69	100,00%	4 236,36	100,00%	1,11%
Обязательства к оплате по совершенным сделкам	0,00	0,00%	0,00	0,00%	-
Итого:	4 189,69	100,00%	4 236,36	100,00%	1,11%

млн тенге

По состоянию на 01.03.2023г. средневзвешенная доходность к погашению (YTM) долговых финансовых инструментов, номинированных в тенге, составила 14,96% годовых.

Ноты Национального Банка Республики Казахстан

Текущая стоимость нот Национального Банка Республики Казахстана составила 831,38 млн тенге. Их доля в портфеле занимает 19,63%.

В отчетном периоде произошли погашения нот НБРК на сумму 1 264,55 млн тенге.

В рассматриваемом периоде были приобретены 31-дневные ноты НБРК в объеме 840,42 млн тенге с доходностью 16,37%.

На отчетную дату средневзвешенная доходность к погашению по нотам НБРК, номинированным в тенге, составила 16,37% годовых.

Паи Exchange Traded Funds

Основную долю в портфеле пенсионных активов, переданных в доверительное управление Jusan Invest, занимают паи Exchange Traded Funds (далее - ETF), текущая стоимость которых составила 1 253,95 млн тенге. Их доля в портфеле составила 29,60%.

Государственные ценные бумаги Министерства финансов Республики Казахстан

Текущая стоимость государственных ценных бумаг (далее – ГЦБ) Министерства финансов Республики Казахстан (далее – МФ РК) составила 922,63 млн тенге. Их доля в портфеле составила 21,78%.

На отчетную дату средневзвешенная доходность к погашению по ГЦБ МФ РК, номинированным в тенге, составила 13,69% годовых.

Государственные ценные бумаги иностранных государств

Текущая стоимость ГЦБ иностранных государств составила 356,77 млн тенге. Их доля в портфеле составила 8,42%.

На отчетную дату средневзвешенная доходность к погашению по ГЦБ иностранных государств, номинированным в долларах США, составила 5,09% годовых.

Валютная структура

Инвестиционный портфель финансовых инструментов в разрезе валют, в которых номинированы финансовые инструменты, приобретенные за счет пенсионных активов, переданных в доверительное управление Jusan Invest, представлен в Таблице 2.

Таблица 2. Структура инвестиционного портфеля пенсионных активов, находящихся в доверительном управлении Jusan Invest, в разрезе валют

<i>млн тенге</i>					
Валюта	Текущая стоимость на 01.01.2023	Доля на 01.01.2023	Текущая стоимость на 01.03.2023	Доля на 01.03.2023	Прирост/снижение с начала года, %
Национальная валюта	2 531,86	60,43%	2 612,27	61,66%	3,18%
Доллары США	1 657,83	39,57%	1 624,08	38,34%	-2,04%
Итого:	4 189,69	100,00%	4 236,36	100,00%	1,11%

Результаты инвестиционной деятельности

В результате инвестиционной деятельности, а также вследствие волатильности курсов иностранных валют и изменения рыночной стоимости финансовых инструментов, размер начисленного инвестиционного дохода за 2023 г. составил 55,76 млн тенге. Доходность пенсионных активов составила 1,25%.

Структура начисленного инвестиционного дохода представлена в Таблице 3.

Таблица 3. Структура инвестиционного дохода, полученного от управления пенсионными активами, находящимися в доверительном управлении Jusan Invest

<i>млн тенге</i>	
Наименование	Инвестиционный доход за 2023 год
Доходы в виде вознаграждения по ценным бумагам, в том числе по размещенным вкладам и операциям «обратное РЕПО»	62,11
Доходы (убытки) от рыночной переоценки ценных бумаг	7,81
Доходы (убытки) от переоценки иностранной валюты	-13,89
Доходы (убытки) от переоценки прочих активов (ПФИ)	0,00
Доходы (убытки) по активам, находящимся во внешнем управлении	0,00
Прочие доходы (убытки)	-0,27
Итого:	55,76

Информация о стоимости условной единицы

Динамика стоимости условной пенсионной единицы пенсионных активов АО «Единый накопительный пенсионный фонд» (далее – ПА ЕНПФ), находящихся в доверительном управлении Jusan Invest представлена в Таблице 4.

Таблица 4. Стоимость одной условной единицы ПА ЕНПФ, находящихся в доверительном управлении Jusan Invest

№ п/п	Дата	Стоимость одной условной единицы
1	01.02.2023	1 027,8645647
2	02.02.2023	1 027,8645647
3	03.02.2023	1 027,8645647
4	04.02.2023	1 027,8645647
5	05.02.2023	1 027,8645647
6	06.02.2023	1 025,780918
7	07.02.2023	1 025,780918
8	08.02.2023	1 025,780918
9	09.02.2023	1 025,780918
10	10.02.2023	1 025,780918
11	11.02.2023	1 025,780918
12	12.02.2023	1 025,780918
13	13.02.2023	1 024,2964046
14	14.02.2023	1 024,2964046
15	15.02.2023	1 024,2964046
16	16.02.2023	1 024,2964046
17	17.02.2023	1 024,2964046
18	18.02.2023	1 024,2964046
19	19.02.2023	1 024,2964046
20	20.02.2023	1 019,7629444
21	21.02.2023	1 019,7629444
22	22.02.2023	1 019,7629444
23	23.02.2023	1 019,7629444
24	24.02.2023	1 019,7629444
25	25.02.2023	1 019,7629444
26	26.02.2023	1 019,7629444
27	27.02.2023	1 016,6228859
28	28.02.2023	1 016,2985646

Информация о соблюдении параметров инвестиционной декларации

Структурное распределение пенсионных активов, находящихся в доверительном управлении Jusan Invest, соответствует требованиям Инвестиционной декларации по доверительному управлению пенсионными активами¹. Доли валютных позиций остаются в рамках допустимого уровня и не нарушают требований Инвестиционной декларации по доверительному управлению пенсионными активами. Сведения о соблюдении лимитов инвестирования по пенсионным активам, находящихся в доверительном управлении Jusan Invest, по состоянию на 1 марта 2023 года представлены в Табл. 5.

Таблица 5. Лимиты инвестирования по пенсионным активам, находящимся в доверительном управлении Jusan Invest

№	Вид финансового инструмента	Фактическое значение (в процентах от общего объема ПА)	Выполнение (да/нет)
1	По валюте		
1.1	Казахстанский тенге	61,66%	да
1.2	Иностранная валюта	38,34%	да
2	По эмитенту		
2.1	МИНИСТЕРСТВО ФИНАНСОВ РК	58,67%	да
2.2	ГУ "Национальный Банк Республики Казахстан"	58,67%	да

¹ Инвестиционная декларация по доверительному управлению пенсионными активами утверждена решением Совета Директоров АО «Jusan Invest» №18/02/23-01 от 18 января 2023 года

2.3	ISHARES 1-3 YEAR TREASURY BOND ETF	7,57%	да
2.4	US TREASURY N/B	8,42%	да
2.5	Vanguard S&P 500 ETF	8,45%	да
2.6	VanEck Vectors Gold Miners ETF	3,29%	да
2.7	ISHARES CORE S&P 500 ETF	7,57%	да
2.8	SCHWAB EMERGING MARKETS EQUITY ETF	4,38%	да
2.9	ISHARES MSCI GLOBAL GOLD MINERS ETF	7,57%	да
2.10	SCHWAB FUNDAMENTAL U.S. LARGE COMPANY INDEX ETF	4,38%	да
2.11	ISHARES MSCI USA ESG SELECT ETF	7,57%	да
2.12	FIDELITY MSCI REAL ESTATE INDEX ETF	2,49%	да
2.13	ISHARES FLOATING RATE BOND ETF	7,57%	да
2.14	VANGUARD SHORT-TERM TREASURY ETF	8,45%	да
2.15	USA TREASURY N/B	8,42%	да
2.16	SPDR MSCI ACWI (EX-US) ETF	3,48%	да
3	По виду финансового инструмента:		
3.1	Государственные ценные бумаги Республики Казахстан (в том числе эмитированные в соответствии с законодательством других государств)	58,67%	да
3.2	Долговые ценные бумаги, выпущенные местными исполнительными органами	0,00%	да
3.3	Долговые ценные бумаги, выпущенные юридическим лицом, сто процентов акций которого принадлежат Национальному Банку Республики Казахстан	0,00%	да
3.4	Долговые ценные бумаги, выпущенные Акционерным обществом «Фонд национального благосостояния «Самрук-Казына» и его дочерними организациями	0,00%	да
3.5	Вклады в банках второго уровня Республики Казахстан, при соответствии одному из следующих условий: банки имеют долгосрочный кредитный рейтинг не ниже «BB-» по международной шкале агентства Standard & Poor's, или рейтинговую оценку аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, или рейтинговую оценку не ниже «kzA-» по национальной шкале Standard & Poor's; банки являются дочерними банками-резидентами, родительский банк-нерезидент которых имеет долгосрочный кредитный рейтинг по международной шкале агентства Standard & Poor's не ниже «A-» или рейтинговую оценку аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств	0,00%	да
3.6	Вклады в банках-нерезидентах, с рейтингом не ниже «A-» агентства «Standard&Poor's» или рейтинг аналогичного уровня агентств «Fitch» или «Moody's» (далее другие рейтинговые агентства)	0,00%	да
3.7	Ценные бумаги следующих международных финансовых организаций: Азиатский банк развития, Африканский банк развития, Банк международных расчетов, Евразийский банк развития, Европейский инвестиционный банк, Европейский банк реконструкции и развития, Исламский банк развития, Межамериканский банк развития, Международный банк реконструкции и развития, Международная финансовая корпорация	0,00%	да
3.8	Ценные бумаги, имеющие статус государственных, выпущенные центральными правительствами иностранных государств, имеющих суверенный рейтинг не ниже «BB+» по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинг аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств	8,42%	да
3.9	Негосударственные ценные бумаги, выпущенные иностранными организациями: акции иностранных эмитентов, имеющих рейтинговую оценку не ниже «BB» по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинговую оценку аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств; акции иностранных эмитентов, входящие в состав основных фондовых индексов, и депозитарные расписки, базовым активом которых являются данные акции; долговые ценные бумаги, имеющие рейтинговую оценку не ниже «BB» по международной шкале агентства Standard & Poor's или	0,00%	да

	рейтинговую оценку аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств		
3.10	Негосударственные ценные бумаги, выпущенные организациями Республики Казахстан в соответствии с законодательством Республики Казахстан и других государств: акции юридических лиц, имеющих рейтинговую оценку не ниже «BB-» по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинговую оценку аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, или рейтинговую оценку не ниже «kzA-» по национальной шкале Standard & Poor's и депозитарные расписки, базовым активом которых являются данные акции; акции юридических лиц, включенные в официальный список фондовой биржи, соответствующие требованиям категории «премиум» сектора «акции» площадки «Основная» официального списка фондовой биржи и депозитарные расписки, базовым активом которых являются данные акции; акции юридических лиц, входящие в состав основных фондовых индексов; долговые ценные бумаги, имеющие рейтинговую оценку не ниже «BB-» по международной шкале агентства Standard & Poor's или рейтинговую оценку аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств, или рейтинговую оценку не ниже «kzA-» по национальной шкале Standard & Poor's; ценные бумаги, выпущенные в рамках реструктуризации обязательств эмитента в целях обмена на ранее выпущенные ценные бумаги либо иные обязательства данного эмитента	0,00%	да
3.11	Паи Exchange Traded Funds (ETF), Exchange Traded Commodities (ETC), Exchange Traded Notes (ETN), имеющие рейтинговую оценку не ниже «3 звезды» рейтингового агентства Morningstar	29,66%	да
3.12	Паи интервальных ПИФов, управляющая компания которых является юридическим лицом, включенные в официальный список фондовой биржи	0,00%	да
3.13	Паи Exchange Traded Funds (ETF), структура активов которых повторяет структуру одного из основных фондовых индексов, или ценообразование по паям которых привязано к основным фондовым индексам	7,05%	да
3.14	Иностранная валюта стран, имеющих суверенный рейтинг не ниже BBB по S&P или рейтинг аналогичного уровня другого агентства	0,00%	да
3.15	Аффинированные драгоценные металлы, металлические депозиты	0,00%	да
3.16	Производные инструменты, заключенные в целях хеджирования, базовым активом которых являются инструменты, входящие в состав ПИФов, иностранная валюта, индексы: CAC40, DAX, DJIA, ENXT 100, FTSE 100, KASE, MICEX, MSCI World Index, NIKKEI-225, RTSI, S&P 500	0,00%	да

Информация по покупкам, продажам и погашениям финансовых инструментов, находящихся в инвестиционном портфеле пенсионных активов, переданных в доверительное управление Jusan Invest

Таблица 6. Сведения по приобретению финансовых инструментов в инвестиционный портфель пенсионных активов, находящихся в доверительном управлении Jusan Invest, в отчетном месяце

Вид инструмента	Валюта	Эмитент ценной бумаги	Номинальная стоимость в тенге
ГЦБ	KZT	РГУ "Национальный Банк Республики Казахстан"	840 422 000,00
Итого			840 422 000,00

Таблица 7. Сведения по продаже финансовых инструментов с инвестиционного портфеля по пенсионным активам, переданным в доверительное управление Jusan Invest, в отчетном месяце

Вид инструмента	Валюта	Эмитент ценной бумаги	Номинальная стоимость в тенге
Итого			0,00

Таблица 8. Сведения по погашениям основного долга по ценным бумагам в инвестиционном портфеле по пенсионным активам, переданным в доверительное управление Jusan Invest, в отчетном месяце

Вид инструмента	Валюта	Эмитент ценной бумаги	Номинальная стоимость в тенге
Дисконтные ноты	KZT	ГУ "Национальный Банк Республики Казахстан"	1 264 553 000,00
Итого			1 264 553 000,00