

«Jýsan Invest» АҚ сенімгерлік басқаруындағы зейнетақы активтерін инвестициялық басқару бойынша ақпарат

01.04.2021 жылғы жағдай бойынша «Jýsan Invest» АҚ (бұдан әрі - Jýsan Invest) сенімгерлік басқаруындағы зейнетақы активтері 663,97 млн.теңгені құрады.

Jýsan Invest сенімгерлік басқаруына берілген зейнетақы активтері есебінен құрылған қаржы құралдарының инвестициялық портфелінің құрылымы 1-кестеде берілген.

1-кесте. Қаржы құралдарының бөлігінде Jýsan Invest сенімгерлік басқаруына берілген зейнетақы активтері бойынша инвестициялық портфелінің құрылымы

Атауы	01.03.2021 жылға ағымдағы құны	01.03.2021 жылға үлесі	01.04.2021 жылға ағымдағы құны	01.04.2021 жылға үлесі	01.03.2021 жылдан бастап өсуі/төмендеуі
ҚРҰБ ноталары	0,00	0,00%	399,09	60,11%	-
Exchange Traded Funds (ETF) пайлары	0,00	0,00%	263,22	39,64%	-
Инвестициялық шоттағы ақшалай қаражат	0,00	0,00%	1,66	0,25%	-
ИПБ басқаруындағы ЗА жиынтығы	0,00	0,00%	663,97	100,00%	-
Жасалған мәмілелер бойынша төлемге міндеттемелер	0,00	0,00%	0,00	0,00	-
Барлығы зейнетақы активтері	0,00	0,00%	663,97	100,00%	-

01.04.2021 жылғы жағдай бойынша теңгеге номинирленген борыштық қаржы құралдарын өтеуге орташа алынған кірістілік (YTM) жылдық 8,93% құрайды.

Қазақстан Республикасы Ұлттық Банк ноталары

Jýsan Invest сенімгерлік басқаруына берілген зейнетақы активтері портфелінде негізгі үлесті Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкі (бұдан әрі - ҚРҰБ) ноталары құрайды, олардың есепті айдың соңындағы ағымдағы құны 399,09 млн.теңгені құрады. Олардың портфелдегі үлесі 60,11% құрады.

Қарастырылып отырған кезеңде 9,05% кірістілікпен 196,00 млн.теңге көлемінде ҚРҰБ-тың 182-күндік ноталары, 9,16% кірістілікпен 60,23 млн.теңге көлемінде ҚРҰБ-тың 182-күндік ноталары және 8,70% кірістілікпен 152,83 млн.теңге көлемінде ҚРҰБ-тың 27-күндік ноталары сатып алынған болатын.

Есепті күнге теңгеге номинирленген ҚРҰБ ноталары бойынша өтеуге орташа алынған кірістілік жылдық 8,93% құрады.

Exchange Traded Funds пайлары

Есепті айдың соңына Exchange Traded Funds (бұдан әрі - ETF) пайларының ағымдағы құны 263,22 млн.теңгені құрады. Олардың портфелдегі үлесі 39,64% құрады.

Есепті кезеңде келесі ETF пайлары сатып алынды:

iShares Core S&P 500 ETF 30,84 млн теңге көлемінде;

Vanguard S&P 500 ETF 46,62 млн теңге көлемінде;

Schwab Fundamental US Large Company ETF 10,39 млн теңге көлемінде;

Schwab Emerging Markets Equity ETF 36,46 млн теңге көлемінде;

SPDR MSCI AWCI ex-US ETF 35,97 млн теңге көлемінде;

ARK Innovation ETF 35,67 млн теңге көлемінде;

iShares MSCI USA ESG Select ETF 10,22 млн теңге көлемінде;

VanEck Vectors Gold Miners ETF 45,90 млн теңге көлемінде;

iShares MSCI Global Gold Miners ETF 5,05 млн теңге көлемінде.

РЕПО операциялары

Есепті айда 8,00% кірістілікпен 40 млн.теңге көлемінде мемлекеттік бағалы қағаздар (бұдан әрі - МБК) қоржынымен бір күндік кері РЕПО ашылған.

Валюталық құрылым

Jýsan Invest сенімгерлік басқаруына берілген зейнетақы активтерінің есебінен сатып алынған қаржы құралдары номиналданған валюталар бөлігінде қаржы құралдарының инвестициялық портфелі 2-кестеде келтірілген.

2-кесте. Валюта бөлігінде Jýsan Invest сенімгерлік басқаруына берілген зейнетақы активтері бойынша инвестициялық портфель құрылымы

млн теңге

Валюта	01.03.2021 жылғы ағымдағы құны	01.03.2021 жылғы үлесі	01.04.2021 жылғы ағымдағы құны	01.04.2021 жылғы үлесі	01.03.2021 жылғы өсуі/төмендеуі
Ұлттық валюта	0,00	0,00 %	400,75	60,36%	-
АҚШ доллары	0,00	0,00 %	263,22	39,64%	-
Жиыны:	0,00	0,00%	663,97	100,00%	-

Инвестициялық қызметтің нәтижелері

Инвестициялық қызметтің нәтижесінде, сондай-ақ шетелдік валюталар бағамының құбылмалылығы салдарынан және қаржы құралдарының нарықтық құнының өзгеруі нәтижесінде есептелген инвестициялық табыс көлемі 6,18 млн. теңгені құрады. Зейнетақы активтерінің кірістілігі 0,89% құрады.

Есептелген инвестициялық кіріс құрылымы 3-кестеде берілген.

3-кесте. Jýsan Invest сенімгерлік басқаруындағы зейнетақы активтерін басқарудан алынған инвестициялық кіріс құрылымы

млн теңге

Атауы	2021 жылғы инвестициялық кіріс
Бағалы қағаздар, орналастырылған салымдар және «кері РЕПО» операциялары бойынша сыйақы түріндегі табыстар	1,00
Бағалы қағаздарды нарықтық қайта бағалаудан кірістер (шығындар)	4,89
Шетелдік валютаны қайта бағалаудан кірістер (шығындар)	0,39
Басқа активтерді қайта бағалаудан кірістер (шығындар) (БҚК)	0,00
Сыртқы басқарудағы активтер бойынша кірістер (шығындар)	0,00
Басқа табыстар (шығындар)	-0,10
Жиынтығы:	6,18

Шартты бірлік құны туралы ақпарат

Jýsan Invest сенімгерлік басқаруындағы «Бірыңғай жинақтаушы зейнетақы қоры» АҚ (бұдан әрі – БЖЗҚ ЗА) зейнетақы активтерінің шартты зейнетақы бірлігі құнының динамикасы 4-кестеде берілген.

4-кесте. Jýsan Invest сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА бір шартты бірлігінің құны

№	Күні	Бір шартты бірлік құны
1	15.03.2021	899,4814074
2	16.03.2021	899,4814074
3	17.03.2021	899,4814074
4	18.03.2021	899,4814074
5	19.03.2021	899,4814074
6	20.03.2021	899,4814074

7	21.03.2021	899,4814074
8	22.03.2021	899,4814074
9	23.03.2021	899,4814074
10	24.03.2021	899,4814074
11	25.03.2021	899,9002202
12	26.03.2021	899,9002202
13	27.03.2021	899,9002202
14	28.03.2021	899,9002202
15	29.03.2021	906,5168967
16	30.03.2021	906,5168967
17	31.03.2021	907,5148165

Инвестициялық декларация параметрлерін сақтау туралы ақпарат

Jýsan Invest сенімгерлік басқаруындағы зейнетақы активтерін құрылымдық үлестіру зейнетақы активтерін сенімгерлік басқару бойынша Инвестициялық декларация¹ талаптарына сәйкес келеді. Валюталық позициялар үлесі рұқсат етілген деңгей шегінде қалады және зейнетақы активтерін сенімгерлік басқару бойынша Инвестициялық декларацияның талаптарын бұзбайды. 2021 жылғы 1 сәуірдегі жағдай бойынша Jýsan Invest сенімгерлік басқаруындағы зейнетақы активтері бойынша инвестициялау лимиттерін сақтау туралы мәліметтер 5-кестеде берілген.

5-кесте. Jýsan Invest сенімгерлік басқаруына берілген зейнетақы активтері бойынша инвестициялау лимиттері

№	Қаржы құралының түрі	Нақты мәні (ЗА жалпы көлемінен пайызбен)	Орындалуы (иә/жоқ)
1	Валюта бойынша		
1.1	Шетелдік валюта	39,64%	иә
1.2	Қазақстан теңгесі	60,36%	иә
2	Эмитент бойынша		
2.1	«Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкі» ММ	60,11%	иә
2.2	ARK ETF Trust	5,42%	иә
2.3	Vanguard S&P 500 ETF	7,20%	иә
2.4	VanEck Vectors Gold Miners ETF	7,06%	иә
2.5	ISHARES CORE S&P 500 ETF	7,14%	иә
2.6	SCHWAB EMERGING MARKETS EQUITY ETF	7,27%	иә
2.7	ISHARES MSCI GLOBAL GOLD MINERS ETF	7,14%	иә
2.8	SCHWAB FUNDAMENTAL U.S. LARGE COMPANY INDEX ETF	7,27%	иә
2.9	SPDR State Street Global Advisors	5,55%	иә
2.10	ISHARES MSCI USA ESG SELECT ETF	7,14%	иә
3	Қаржы құралының түрі бойынша:		
3.1	Акцияларының жүз пайызы Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкіне тиесілі, заңды тұлға шығарған борыштық бағалы қағаздар		иә
3.2	Morningstar рейтингтік агенттігінің «3 жұлдыз» төмен емес рейтингтік бағасы бар Exchange Traded Funds (ETF), Exchange Traded Commodities (ETC), Exchange Traded Notes (ETN) пайлары	39,64%	иә
3.3	Exchange Traded Funds (ETF) пайлары, олардың активтерінің құрылымы негізгі қор индекстерінің бірінің құрылымын немесе пайлары негізгі қор индекстеріне байлаулы баға құрушыны қайталайды	11,98%	иә
3.4	Қазақстан Республикасының мемлекеттік бағалы қағаздары (оның ішінде басқа мемлекеттердің заңнамасына сәйкес эмитерлінген)	60,11%	иә

¹ Зейнетақы активтерін сенімгерлік басқару бойынша инвестициялық декларация «Jýsan Invest» АҚ Директорлар кеңесінің 2021 жылғы 18 ақпандағы №18/02/21-01 шешімімен бекітілген.

3.5	Интервалды ПИК пайлары, оларды басқарушы компания қор биржасының ресми тізіміне енгізілген заңды тұлға болып табылады		иә
3.6	«Standard&Poor's» агенттігінің халықаралық шәкілі бойынша «BB+» төмен емес тәуелсіз рейтингісі бағасы бар немесе басқа рейтинг агенттіктерінің бірінің осыған ұқсас деңгейінің рейтингтік бағасы бар шетелдік мемлекеттердің орталық орталық үкіметтері шығарған мемлекеттік мәртебесі бар бағалы қағаздары		иә
3.7	Тазартылған қымбат металлдар, металл депозиттер		иә
3.8	Хеджирлеу мақсатында жасалған туынды құралдар, олардың базалық активтері ПИК құрамына кіретін құралдар, шетелдік валюта, индекстер: CAC40, DAX, DJIA, ENXT 100, FTSE 100, KASE, MICEX, MSCI World Index, NIKKEI-225, RTSI, S&P 500 болып табылады		иә
3.9	Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банктеріне салымдар, келесі талаптардың біріне сәйкес келсе: банктердің «Standard&Poor's» агенттігінің халықаралық шәкілі бойынша «BB-» төмен емес ұзақ мерзімді кредиттік рейтингісі немесе басқа рейтинг агенттіктерінің бірінің осыған ұқсас деңгейінің рейтингтік бағасы бар, немесе «Standard&Poor's» ұлттық шәкілі бойынша «kzA-» төмен емес рейтингтік бағасы бар; банктер резидент еншілес банктер болып табылады, олардың басты бейрезидент банкінің «Standard&Poor's» агенттігінің халықаралық шәкілі бойынша «A-» төмен емес ұзақ мерзімді кредиттік рейтингісі немесе басқа рейтинг агенттіктерінің бірінің осыған ұқсас деңгейінің рейтингтік бағасы бар		иә
3.10	Қазақстан Республикасы мен басқа мемлекеттердің заңнамасына сәйкес қазақстан Республикасының ұйымдары шығарған мемлекеттік емес бағалы қағаздар: «Standard&Poor's» агенттігінің халықаралық шәкілі бойынша «BB-» төмен емес рейтингтік бағасы немесе басқа рейтинг агенттіктерінің бірінің осыған ұқсас деңгейінің рейтингтік бағасы бар, немесе «Standard&Poor's» ұлттық шәкілі бойынша «kzA-» төмен емес рейтингтік бағасы бар заңды тұлғалардың акциялары және базалық активтері аталған акциялар болып табылатын депозитарлық қолхаттар; қор биржасының ресми тізіміне енгізілген, қор биржасының ресми тізімінің "Негізгі" алаңының "Акциялар" секторының "Премиум" санатының талаптарына сәйкес келетін қор биржасының ресми тізіміне енгізілген заңды тұлғалардың акциялары және базалық активтері аталған акциялар болып табылатын депозитарлық қолхаттар; негізгі қор индекстерінің құрамына кіретін заңды тұлғалардың акциялары; «Standard&Poor's» агенттігінің халықаралық шәкілі бойынша «BB-» төмен емес рейтингтік бағасы немесе басқа рейтинг агенттіктерінің бірінің осыған ұқсас деңгейінің рейтингтік бағасы бар, немесе «Standard&Poor's» ұлттық шәкілі бойынша «kzA-» төмен емес рейтингтік бағасы бар борыштық бағалы қағаздар; бұрын шығарылған бағалы қағаздарға немесе аталған эмитенттің басқа міндеттемелеріне айырбастау мақсатында эмитенттің міндеттемелерін қайта құрылымдау аясында шығарылған бағалы қағаздар		иә
3.11	Шетелдік ұйымдар шығарған мемлекеттік емес бағалы қағаздар: «Standard&Poor's» агенттігінің халықаралық шәкілі бойынша «BB» төмен емес рейтингтік бағасы немесе басқа рейтинг агенттіктерінің бірінің осыған ұқсас деңгейінің рейтингтік бағасы бар шетелдік эмитенттердің акциялары; негізгі қор индекстерінің құрамына кіретін шетелдік эмитенттердің акциялары және базалық активтері аталған акциялар болып табылатын депозитарлық қолхаттар; «Standard&Poor's» агенттігінің халықаралық шәкілі бойынша «BB» төмен емес рейтингтік бағасы немесе басқа рейтинг агенттіктерінің бірінің осыған ұқсас деңгейінің рейтингтік бағасы бар борыштық бағалы қағаздар		иә
3.12	Жергілікті атқарушы органдар шығарған борыштық бағалы қағаздар		иә
3.13	«Самұқ-Қазына» Ұлттық әл-ауқат қоры» акционерлік қоғамы мен оның еншілес ұйымдары шығарған борыштық бағалы қағаздар		иә
3.14	Келесі халықаралық қаржы ұйымдарының бағалы қағаздары: Азия даму банкі, Африка даму банкі, Халықаралық есептеулер банкі, Еуразия даму банкі, Еуропалық инвестициялық банк, Еуропалық қайта құру және даму банкі, Ислам даму банкі, Америкаарадық даму банкі, Халықаралық қайтақұру және даму банкі, Халықаралық қаржы копорациясы		иә
3.15	S&P бойынша BBB төмен емес тәуелсіз рейтингісі немесе басқа агенттіктің ұқсас деңгейдегі рейтингісі бар елдердің шетелдік валютасы		иә
3.16	«Standard&Poor's» агенттігінің «A-» төмен емес рейтингісі немесе «Fitch» немесе «Moody's» агенттіктерінің (бұдан әрі басқа рейтингтік агенттіктер) ұқсас деңгейдегі рейтингісі бар бей резидент банктердегі салымдар		иә

Jýsan Invest сенімгерлік басқаруына берілген зейнетақы активтерінің инвестициялық портфеліндегі қаржы құралдарды сатып алу, сату және өтеу бойынша ақпарат

6-кесте. Есептік айда Jýsan Invest сенімгерлік басқаруына берілген зейнетақы активтері бойынша инвестициялық портфеліне қаржы құралдарын сатып алу бойынша мәліметтер

Құрал түрі	Валюта	Бағалы қағаз эмитенті	Теңгемен номинал құны
МБК, мәміле жасалған күні 15.03.2021	KZT	«Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкі» ММ (NTK182_2702 KZW100012662)	196 000 000
ETF пайлары, мәміле жасалған күні 25.03.2021	USD	ISHARES CORE S&P 500 ETF (IVV US US4642872000)	15 623 550
ETF пайлары, мәміле жасалған күні 25.03.2021	USD	Vanguard S&P 500 ETF (VOO US US9229083632)	23 037 549
ETF пайлары, мәміле жасалған күні 25.03.2021	USD	SCHWAB FUNDAMENTAL U.S. LARGE COMPANY INDEX ETF (FNDX US US8085247711)	5 281 827
ETF пайлары, мәміле жасалған күні 25.03.2021	USD	SCHWAB EMERGING MARKETS EQUITY ETF (SCHE US US8085247067)	18 439 402
ETF пайлары, мәміле жасалған күні 25.03.2021	USD	SPDR State Street Global Advisors (CWI US US78463X8487)	17 765 773
ETF пайлары, мәміле жасалған күні 25.03.2021	USD	ARK ETF Trust (ARKK US US00214Q1040)	17 488 155
Паи ETF, мәміле жасалған күні 25.03.2021	USD	ISHARES MSCI USA ESG SELECT ETF (SUSA US US4642888022)	5 173 184
ETF пайлары, мәміле жасалған күні 25.03.2021	USD	VanEck Vectors Gold Miners ETF (GDX US US92189F1066)	23 165 154
ETF пайлары, мәміле жасалған күні 25.03.2021	USD	ISHARES MSCI GLOBAL GOLD MINERS ETF (RING US US46434G8556)	2 549 995
ETF пайлары, мәміле жасалған күні 25.03.2021	USD	ISHARES CORE S&P 500 ETF (IVV US US4642872000)	15 219 394
ETF пайлары, мәміле жасалған күні 25.03.2021	USD	Vanguard S&P 500 ETF (VOO US US9229083632)	23 584 370
ETF пайлары, мәміле жасалған күні 25.03.2021	USD	SCHWAB FUNDAMENTAL U.S. LARGE COMPANY INDEX ETF (FNDX US US8085247711)	5 107 288
ETF пайлары, мәміле жасалған күні 25.03.2021	USD	SCHWAB EMERGING MARKETS ETF (SCHE US EQUITY US8085247067)	18 016 483
ETF пайлары, мәміле жасалған күні 25.03.2021	USD	SPDR State Street Global Advisors (CWI US US78463X8487)	18 205 433
ETF пайлары, мәміле жасалған күні 25.03.2021	USD	ARK ETF Trust (ARKK US US00214Q1040)	18 182 867
ETF пайлары, мәміле жасалған күні 25.03.2021	USD	ISHARES MSCI USA ESG SELECT ETF (SUSA US US4642888022)	5 046 875
ETF пайлары, мәміле жасалған күні 25.03.2021	USD	VanEck Vectors Gold Miners ETF (GDX US US92189F1066)	22 732 391
ETF пайлары, мәміле жасалған күні 25.03.2021	USD	ISHARES MSCI GLOBAL GOLD MINERS ETF (RING US US46434G8556)	2 501 126
МБК, мәміле жасалған күні 25.03.2021	KZT	«Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкі» ММ (NTK027_2708 KZW100012720)	152 833 200

МБҚ, мәміле жасалған күні 26.03.2021	KZT	«Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкі» ММ (NTK182_2709 KZW100012738)	60 233 000
Жиыны			666 187 016

7-кесте. Есептік айда Jýsan Invest сенімгерлік басқаруына берілген зейнетақы активтері бойынша инвестициялық портфельден қаржы құралдарын сату бойынша мәліметтер

Құрал түрі	Валюта	Бағалы қағаз эмитенті	Тенгемен мәміле сомасы
Жиыны			0

8-кесте. Есептік айда Jýsan Invest сенімгерлік басқаруына берілген зейнетақы активтері бойынша инвестициялық портфельдегі бағалы қағаздар бойынша негізгі борышты өтеу бойынша мәліметтер

Құрал түрі	Валюта	Бағалы қағаз эмитенті	Тенгемен мәміле сомасы
Жиыны			0

9-кесте. Есептік айда Jýsan Invest сенімгерлік басқаруына берілген зейнетақы активтерін шетелдік банктерге салымдарға орналастырулар бойынша мәліметтер

Құрал түрі	Валюта	Банк атауы	Тенгемен мәміле сомасы
Жиыны			0

10-кесте. Есептік айда Jýsan Invest сенімгерлік басқаруына берілген зейнетақы активтері бойынша инвестициялық портфельдегі салымдар бойынша негізгі борышты өтеу бойынша мәліметтер

Құрал түрі	Валюта	Банк атауы	Тенгемен өтеу сомасы
Жиыны			0