

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

01.02.2022 жылғы жағдай бойынша «Jusan Invest» АҚ (бұдан әрі - Jusan Invest) сенімгерлік басқаруындағы зейнетақы активтері 3 480,55 млн.теңгені құрады.

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

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

Атауы	01.01.2022 жылға ағымдағы құны	01.01.2022 жылға үлесі	01.02.2022 жылға ағымдағы құны	01.02.2022 жылға үлесі	Кезең үшін өсуі/төмендеуі %
ҚР ҚМ МБҚ	516,73	15,07%	861,31	24,75%	66,69
ҚРҰБ ноталары	1 146,26	33,42%	1 278,43	36,73%	11,53
Exchange Traded Funds (ETF) пайлары	838,33	24,45%	968,60	27,83%	15,54
Инвестициялық шоттағы ақшалай қаражат	357,29	10,42%	372,21	10,69%	4,17
Репо	570,78	16,64%	0,00	0,00%	-100
Басқа активтер (дебиторлық берешек, мерзімі өткен берешек, провизиялар)	0,00	0,00%	0,00	0,00%	
«Jusan Invest» АҚ басқаруындағы зейнетақы активтерінің жиынтығы¹	3 429,39	100,00%	3 480,55	100,00%	1,49
Жасалған мәмілелер бойынша төлемге міндеттемелер	0,00	0,00%	0,00	0,00%	
Барлығы:	3 429,39		3 480,55		1,49

01.02.2022 жылғы жағдай бойынша теңгеге номинирленген борыштық қаржы құралдарын өтеуге орташа алынған кірістілік (ҮТМ) жылдық 9,62% құрайды.

Қазақстан Республикасы Ұлттық Банк ноталары

Jusan Invest сенімгерлік басқаруына берілген зейнетақы активтері портфеліндегі негізгі үлесті Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкі (бұдан әрі - ҚРҰБ) ноталары құрайды, ағымдағы құны 1 278,43 млн.теңге құрады. Олардың портфелдегі үлесі 36,73%.

Қарастырылып отырған 9,33% кірістілікпен 201,33 млн.теңге көлемінде ҚРҰБ-тың 182-күндік ноталары сатып алынды.

Есепті кезеңде 78,00 млн.теңге сомасына ҚРҰБ ноталары өтелді.

Есепті күнге теңгеге номинирленген ҚРҰБ ноталары бойынша өтеуге орташа алынған кірістілік жылдық 9,28% құрады.

Exchange Traded Funds пайлары

Exchange Traded Funds (бұдан әрі - ETF) пайларының ағымдағы құны 968,60 млн.теңгені құрады. Олардың портфелдегі үлесі 27,83% құрады.

Есепті кезеңде келесі ETF пайлары сатып алынды:

Fidelity MSCI Real Estate Index ETF 51,69 млн теңге көлемінде;

Vanguard S&P 500 ETF 48,65 млн теңге көлемінде;

iShares Core S&P 500 ETF 42,21 млн теңге көлемінде;

VanEck Vectors Gold Miners ETF 16,88 млн теңге көлемінде;

iShares MSCI USA ESG Select ETF 12,76 млн теңге көлемінде.

¹ Жасалған мәмілелер бойынша төлеуге міндеттемелер есебімен «Jusan Invest» АҚ сенімгерлік басқаруындағы зейнетақы активтерінің жиынтық ағымдағы құны

Қазақстан Республикасы Қаржы министрлігінің Мемлекеттік бағалы қағаздары

Қазақстан Республикасы Қаржы министрлігінің (бұдан әрі – ҚР ҚМ) мемлекеттік бағалы қағаздарының (бұдан әрі – МБҚ) ағымдағы құны 861,31 млн.теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 24,75%.

Есепті кезеңде келесідей ҚР ҚМ МБҚ:

10,30% кірістілікпен және 220,60 млн теңге көлемінде 2023 жылға өтелетін ҚР ҚМ МБҚ;

10,67% кірістілікпен және 150,00 млн теңге көлемінде 2026 жылға өтелетін ҚР ҚМ МБҚ сатып алынды.

Есепті күнге теңгеге номиналданған ҚР Қаржы министрлігінің МБҚ бойынша өтеуге орташа алынған кірістілігі жылдық 10,11% құрады.

РЕПО операциялары

Есепті айда 7,16% кірістілікпен жалпы көлемі 1 899,74 млн.теңге МБҚ қоржынымен кері РЕПО ашылған.

Валюталық құрылым

Jusan 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 Jusan Invest сенімгерлік басқаруына берілген зейнетақы активтері бойынша инвестициялық портфель құрылымы

млн теңге

Валюта	01.01.2022 жылғы ағымдағы құны	01.01.2022 жылғы үлесі	01.02.2022 жылғы ағымдағы құны	01.02.2022 жылғы үлесі	Жыл басынан бері өсуі/төмендеуі
Ұлттық валюта	2 236,50	65,22%	2 327,73	66,88%	4,08
АҚШ доллары	1 192,89	34,78%	1 152,82	33,12%	-3,36
Жиыны²:	3 429,39	100,00%	3 480,55	100,00%	1,49

Инвестициялық қызметтің нәтижелері

Инвестициялық қызметтің нәтижесінде, сондай-ақ шетелдік валюталар бағамының құбылмалылығы салдарынан және қаржы құралдарының нарықтық құнының өзгеруі нәтижесінде 2022 жыл үшін есептелген инвестициялық табыс көлемі -24,40 млн. теңгені құрады. Зейнетақы активтерінің кірістілігі -0,67% құрады.

Есептелген инвестициялық кіріс құрылымы 3-кестеде берілген.

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

млн теңге

Атауы	2022 жылғы инвестициялық кіріс
Бағалы қағаздар, орналастырылған салымдар және «кері РЕПО» операциялары бойынша сыйақы түріндегі табыстар	15,90
Бағалы қағаздарды нарықтық қайта бағалаудан кірістер (шығындар)	-41,85
Шетелдік валютаны қайта бағалаудан кірістер (шығындар)	1,83
Басқа активтерді қайта бағалаудан кірістер (шығындар) (БҚҚ)	0,00
Сыртқы басқарудағы активтер бойынша кірістер (шығындар)	0,00
Басқа табыстар (шығындар)	-0,28
Жиынтығы:	-24,40

² Жасалған мәмілелер бойынша төлеуге міндеттемелер есебімен «Jusan Invest» АҚ сенімгерлік басқаруындағы зейнетақы активтерінің жиынтық ағымдағы құны

Шартты бірлік құны туралы ақпарат

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

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

№ п/п	Күні	Бір шартты бірлік құны
1	01.01.2022	972,1586483
2	02.01.2022	972,1586483
3	03.01.2022	972,1586483
4	04.01.2022	972,1586483
5	05.01.2022	976,5363879
6	06.01.2022	976,5363879
7	07.01.2022	976,5363879
8	08.01.2022	976,5363879
9	09.01.2022	976,5363879
10	10.01.2022	972,4883533
11	11.01.2022	972,4883533
12	12.01.2022	972,4883533
13	13.01.2022	972,4883533
14	14.01.2022	972,4883533
15	15.01.2022	972,4883533
16	16.01.2022	972,4883533
17	17.01.2022	977,9042651
18	18.01.2022	977,9042651
19	19.01.2022	977,9042651
20	20.01.2022	977,9042651
21	21.01.2022	977,9042651
22	22.01.2022	977,9042651
23	23.01.2022	977,9042651
24	24.01.2022	971,1273709
25	25.01.2022	971,1273709
26	26.01.2022	971,1273709
27	27.01.2022	971,1273709
28	28.01.2022	971,1273709
29	29.01.2022	971,1273709
30	30.01.2022	971,1273709
31	31.01.2022	965,6425353

Инвестициялық декларация параметрлерін сақтау туралы ақпарат

Jusan Invest сенімгерлік басқаруындағы зейнетақы активтерін құрылымдық үлестіру зейнетақы активтерін сенімгерлік басқару бойынша Инвестициялық декларация³ талаптарына сәйкес келеді. Валюталық позициялар үлесі рұқсат етілген деңгей шегінде қалады және зейнетақы активтерін сенімгерлік басқару бойынша Инвестициялық декларацияның талаптарын бұзбайды. 2022 жылғы 1 ақпандағы жағдай бойынша Jusan Invest сенімгерлік басқаруындағы зейнетақы активтері бойынша инвестициялау лимиттерін сақтау туралы мәліметтер 5-кестеде берілген.

³ Зейнетақы активтерін сенімгерлік басқару бойынша инвестициялық декларация «Jusan Invest» АҚ Директорлар кеңесінің 2021 жылғы 18 ақпандағы №18/02/21-01 шешімімен бекітілген.

5-кесте. Jusan 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	Қазақстан теңгесі	66,88%	иә
1.2	Шетелдік валюта	33,12%	иә
2	Эмитент бойынша		
2.1	ҚР ҚАРЖЫ МИНИСТРЛІГІ	61,48%	иә
2.2	«Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкі» ММ	61,48%	иә
2.3	Vanguard S&P 500 ETF	4,56%	иә
2.4	VanEck Vectors Gold Miners ETF	4,18%	иә
2.5	ISHARES CORE S&P 500 ETF	4,96%	иә
2.6	SCHWAB EMERGING MARKETS EQUITY ETF	5,97%	иә
2.7	ISHARES MSCI GLOBAL GOLD MINERS ETF	4,96%	иә
2.8	SCHWAB FUNDAMENTAL U.S. LARGE COMPANY INDEX ETF	5,97%	иә
2.9	ISHARES MSCI USA ESG SELECT ETF	4,96%	иә
2.10	FIDELITY MSCI REAL ESTATE INDEX ETF	3,56%	иә
2.11	SPDR MSCI ACWI (EX-US) ETF	4,59%	иә
3	Қаржы құралының түрі бойынша:		
3.1	Қазақстан Республикасының мемлекеттік бағалы қағаздары (оның ішінде басқа мемлекеттердің заңнамасына сәйкес эмитирлинген)	61,48%	
3.2	Жергілікті атқарушы органдар шығарған борыштық бағалы қағаздар	0,00%	иә
3.3	Акцияларының жүз пайызы Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкіне тиесілі, заңды тұлға шығарған борыштық бағалы қағаздар	0,00%	иә
3.4	«Самрұқ-Қазына» Ұлттық әл-ауқат қоры» акционерлік қоғамы мен оның еншілес ұйымдары шығарған борыштық бағалы қағаздар	0,00%	иә
3.5	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	0,00%	иә
3.6	«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	0,00%	иә
3.7	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, Америкааралық даму банкі, Халықаралық қайтақұру және даму банкі, Халықаралық қаржы копорациясы	0,00%	иә
3.8	«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	0,00%	иә

3.9	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	0,00%	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	0,00%	иә
3.11	Morningstar рейтингтік агенттігінің «3 жұлдыз» төмен емес рейтингтік бағасы бар Exchange Traded Funds (ETF), Exchange Traded Commodities (ETC), Exchange Traded Notes (ETN) пайлары	27,83%	иә
3.12	Интервалды ПИҚ пайлары, оларды басқарушы компания қор биржасының ресми тізіміне енгізілген заңды тұлға болып табылады	0,00%	иә
3.13	Exchange Traded Funds (ETF) пайлары, олардың активтерінің құрылымы негізгі қор индекстерінің бірінің құрылымын немесе пайлары негізгі қор индекстеріне байлаулы баға құрушыны қайталайды	7,92%	иә
3.14	S&P бойынша BBB төмен емес тәуелсіз рейтингісі немесе басқа агенттіктің ұқсас деңгейдегі рейтингісі бар елдердің шетелдік валютасы	0,00%	иә
3.15	Тазартылған қымбат металдар, металд депозиттер	0,00%	иә
3.16	Базалық активтері ПИҚ құрамына кіретін құралдар болып табылатын, хеджирлеу мақсатында жасалған туынды құралдар, шетелдік валюта, индекстер: CAC40, DAX, DJIA, ENXT 100, FTSE 100, KASE, MICEX, MSCI World Index, NIKKEI-225, RTSI, S&P 500	0,00%	иә

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

6-кесте. Есептік айда Jusan Invest сенімгерлік басқаруындағы зейнетақы активтерінің инвестициялық портфеліне қаржы құралдарын сатып алу бойынша мәліметтер

Құрал түрі	Валюта	Бағалы қағаз эмитенті	Теңгемен номинал құны
МБҚ мәміле күні 19.01.2022	KZT	«Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкі» ММ (NTK028_2768 KZW100013322)	201 330 000
МБҚ мәміле күні 19.01.2022	KZT	ҚР ҚАРЖЫ МИНИСТРЛІГІ (MOM048_0052 KZK200000687)	150 000 000
ETF пайлары, мәміле 19.01.2022	KZT	ISHARES CORE S&P 500 ETF (IVV US US4642872000)	42 208 362
ETF пайлары, мәміле 19.01.2022	USD	Vanguard S&P 500 ETF (VOO US US9229083632)	48 651 440

ETF пайлары, мәміле 19.01.2022	USD	ISHARES MSCI USA ESG SELECT ETF (SUSA US US4642888022)	12 764 423
ETF пайлары, мәміле 19.01.2022	USD	FIDELITY MSCI REAL ESTATE INDEX ETF (FREL US3160928574)	5 1693 047
ETF пайлары, мәміле 19.01.2022	USD	VanEck Vectors Gold Miners ETF (GDX US US92189F1066)	16 879126
МБҚ мәміле күні 20.01.2022	KZT	ҚР ҚАРЖЫ МИНИСТРЛІГІ (МКМ012_0150 KZK100000266)	220 600 000
Жиыны			744 126 398

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

Құрал түрі	Валюта	Бағалы қағаз эмитенті	Тенгемен номинал құны
МБҚ мәміле күні 19.01.2022	KZT	«Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкі» ММ (NTK028_2747 KZW100013116)	77 997 100,00
Жиыны			77 997 100,00