

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

01.01.2023 жылғы жағдай бойынша «Jýsan Invest» АҚ (бұдан әрі - Jýsan Invest) сенімгерлік басқаруындағы зейнетақы активтері 4 189,69 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

млн теңге

| Атауы | 01.01.2022 жылға ағымдағы құны | 01.01.2022 жылға үлесі | 01.01.2023 жылға ағымдағы құны | 01.01.2023 жылға үлесі | Кезең үшін өсуі/төменд еуі % |
|--|---|------------------------------|---|------------------------------|---------------------------------------|
| ҚР ҚМ МБҚ | 516,73 | 15,07% | 718,26 | 17,14% | 39,00% |
| ҚРҰБ ноттары | 1 146,26 | 33,42% | 1 792,94 | 42,79% | 56,42% |
| Шетелдік мемлекеттердің МБҚ | 0,00 | 0,00% | 369,93 | 8,83% | - |
| Exchange Traded Funds (ETF) пайлары | 838,33 | 24,45% | 1 274,83 | 30,43% | 52,07% |
| Инвестициялық шоттағы ақшалай қаражат | 357,29 | 10,42% | 31,43 | 0,75% | -91,20% |
| Репо | 570,78 | 16,64% | 0,00 | 0,00% | - |
| Басқа активтер | 0,00 | 0,00% | 2,30 | 0,05% | - |
| «Jýsan Invest» АҚ басқаруындағы зейнетақы активтерінің жиынтығы [1] | 3 429,39 | 100,00% | 4 189,69 | 100,00% | 22,17% |
| Жасалған мәмілелер бойынша төлемге міндеттемелер | 0,00 | 0,00% | 0,00 | 0,00% | - |
| Жиыны: | 3 429,39 | 100,00% | 4 189,69 | 100,00% | 22,17% |

01.01.2023 жылғы жағдай бойынша теңгеге номинирленген борыштық қаржы құралдарын өтеуге орташа алынған кірістілік (YTM) жылдық 16,03% құрайды.

Қазақстан Республикасы Ұлттық Банк ноттары

Jusan Invest сенімгерлік басқаруға берілген зейнетақы активтері портфеліндегі негізгі үлесті ағымдағы құны 1 792,94 млн теңгені құрайтын Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкінің ноттары құрайды. Олардың портфельдегі үлесі 42,79%.

Есептік кезеңде ҚР ҰБ ноттары 1 620,83 млн теңге сомасына өтелді.

Қарастырылып отырған 16,30% кірістілікпен 798,11 млн.теңге көлемінде ҚРҰБ-тың 28-күндік ноттары және 16,34% кірістілікпен 1 011,64 млн.теңге көлемінде ҚРҰБ-тың 28-күндік ноттары сатып алынды.

Есепті күнге теңгеге номинирленген ҚРҰБ ноттары бойынша өтеуге орташа алынған кірістілік жылдық 16,32% құрады.

Exchange Traded Funds пайлары

Exchange Traded Funds (бұдан әрі - ETF) пайларының ағымдағы құны 1 274,83 млн.теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 30,43% құрады.

Қазақстан Республикасы Қаржы министрлігінің Мемлекеттік бағалы қағаздары

Қазақстан Республикасы Қаржы министрлігінің (бұдан әрі – ҚР ҚМ) мемлекеттік бағалы қағаздарының (бұдан әрі – МБҚ) ағымдағы құны 718,26 млн.теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 17,14%.

Есепті күнге теңгеге номиналданған ҚР ҚМ МБҚ бойынша өтеуге орташа алынған кірістілігі жылдық 15,30% құрады.

Шетелдік мемлекеттердің мемлекеттік бағалы қағаздары

Шетелдік мемлекеттердің мемлекеттік бағалы қағаздарының ағымдағы құны 369,93 млн. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 8,83% құрады.

Есепті күнге шетелдік мемлекеттердің МБҚ өтеуге орташа алынған кірістілігі АҚШ долларымен номиналданған жылдық 4,52% құрады.

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 | 01.01.2022 жылға ағымдағы құны | 01.01.2022 жылға үлесі | 01.01.2023 жылға ағымдағы құны | 01.01.2023 жылға үлесі | Кезең үшін өсуі/төмендеуі % |
|---------------|--------------------------------|------------------------|--------------------------------|------------------------|-----------------------------|
| Ұлттық валюта | 2 236,50 | 65,22% | 2 531,86 | 60,43% | 13,21% |
| АҚШ доллары | 1 192,89 | 34,78% | 1 657,83 | 39,57% | 38,98% |
| Жиыны: | 3 429,39 | 100,00% | 4 189,69 | 100,00% | 22,17% |

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 117,61 млн. теңгені құрады. Зейнетақы активтерінің кірістілігі 3,25% құрады.

Есептелген инвестициялық кіріс құрылымы 3-кестеде берілген.

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

млн теңге

| Атауы | 2022 жылға инвестициялық кіріс |
|---|--------------------------------|
| Бағалы қағаздар, орналастырылған салымдар және «кері РЕПО» операциялары бойынша сыйақы түріндегі табыстар | 256,08 |
| Бағалы қағаздарды нарықтық қайта бағалаудан кірістер (шығындар) | -156,94 |
| Шетелдік валютаны қайта бағалаудан кірістер (шығындар) | 24,89 |
| Басқа активтерді қайта бағалаудан кірістер (шығындар) (БҚК) | 0,00 |
| Сыртқы басқарудағы активтер бойынша кірістер (шығындар) | 0,00 |
| Басқа табыстар (шығындар) | -6,42 |
| Жиыны: | 117,61 |

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

| № р/с | Күні | Бір шартты бірлік құны |
|-------|------------|------------------------|
| 1 | 01.12.2022 | 1 008,4414263 |
| 2 | 02.12.2022 | 1 008,4414263 |
| 3 | 03.12.2022 | 1 008,4414263 |
| 4 | 04.12.2022 | 1 008,4414263 |
| 5 | 05.12.2022 | 1 017,7725923 |
| 6 | 06.12.2022 | 1 017,7725923 |
| 7 | 07.12.2022 | 1 017,7725923 |
| 8 | 08.12.2022 | 1 017,7725923 |
| 9 | 09.12.2022 | 1 017,7725923 |
| 10 | 10.12.2022 | 1 017,7725923 |
| 11 | 11.12.2022 | 1 017,7725923 |
| 12 | 12.12.2022 | 1 015,5756513 |
| 13 | 13.12.2022 | 1 015,5756513 |
| 14 | 14.12.2022 | 1 015,5756513 |
| 15 | 15.12.2022 | 1 015,5756513 |
| 16 | 16.12.2022 | 1 015,5756513 |
| 17 | 17.12.2022 | 1 015,5756513 |
| 18 | 18.12.2022 | 1 015,5756513 |
| 19 | 19.12.2022 | 1 005,7239537 |
| 20 | 20.12.2022 | 1 005,7239537 |
| 21 | 21.12.2022 | 1 005,7239537 |
| 22 | 22.12.2022 | 1 005,7239537 |
| 23 | 23.12.2022 | 1 005,7239537 |
| 24 | 24.12.2022 | 1 005,7239537 |
| 25 | 25.12.2022 | 1 005,7239537 |
| 26 | 26.12.2022 | 1 003,1192957 |
| 27 | 27.12.2022 | 1 003,1192957 |
| 28 | 28.12.2022 | 1 003,1192957 |
| 29 | 29.12.2022 | 1 003,1192957 |
| 30 | 30.12.2022 | 1 003,1192957 |
| 31 | 31.12.2022 | 1 003,7961697 |

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. 2023 жылғы 1 қаңтардағы 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 Зейнетақы активтерін сенімгерлік басқару бойынша инвестициялық декларация «Jýsan Invest» АҚ Директорлар кеңесінің 2021 жылғы 18 ақпандағы №18/02/21-01 шешімімен бекітілген.

| | | | |
|----------|---|--------|----|
| 1.1 | Қазақстан теңгесі | 60,43% | иә |
| 1.2 | Шетелдік валюта | 39,57% | иә |
| 2 | По эмитенту | | |
| 2.1 | ҚР ҚАРЖЫ МИНИСТРЛІГІ | 59,94% | иә |
| 2.2 | «Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкі» ММ | 59,94% | иә |
| 2.3 | ISHARES 1-3 YEAR TREASURY BOND ETF | 7,75% | иә |
| 2.4 | US TREASURY N/B | 8,83% | иә |
| 2.5 | Vanguard S&P 500 ETF | 8,64% | иә |
| 2.6 | VanEck Vectors Gold Miners ETF | 3,65% | иә |
| 2.7 | ISHARES CORE S&P 500 ETF | 7,75% | иә |
| 2.8 | SCHWAB EMERGING MARKETS EQUITY ETF | 4,47% | иә |
| 2.9 | ISHARES MSCI GLOBAL GOLD MINERS ETF | 7,75% | иә |
| 2.10 | SCHWAB FUNDAMENTAL U.S. LARGE COMPANY INDEX ETF | 4,47% | иә |
| 2.11 | ISHARES MSCI USA ESG SELECT ETF | 7,75% | иә |
| 2.12 | FIDELITY MSCI REAL ESTATE INDEX ETF | 2,49% | иә |
| 2.13 | ISHARES FLOATING RATE BOND ETF | 7,75% | иә |
| 2.14 | VANGUARD SHORT-TERM TREASURY ETF | 8,64% | иә |
| 2.15 | USA TREASURE N/B | 8,83% | иә |
| 2.16 | SPDR MSCI ACWI (EX-US) ETF | 3,49% | иә |
| 3 | Қаржы құралының түрі бойынша: | | |
| 3.1 | Қазақстан Республикасының мемлекеттік бағалы қағаздары (оның ішінде басқа мемлекеттердің заңнамасына сәйкес эмитирлинген) | 59,94% | иә |
| 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&Poog'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 | 8,83% | иә |
| 3.9 | Шетелдік ұйымдар шығарған мемлекеттік емес бағалы қағаздар: «Standard&Poog'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&Poog'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&Poog's» агенттігінің халықаралық шәкілі бойынша «BB-» төмен емес рейтингтік бағасы немесе басқа рейтинг агенттіктерінің бірінің осыған ұқсас деңгейінің рейтингтік бағасы бар, немесе «Standard&Poog'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&Poog's» агенттігінің халықаралық шәкілі бойынша «BB-» төмен емес рейтингтік бағасы немесе басқа рейтинг агенттіктерінің бірінің осыған ұқсас деңгейінің рейтингтік бағасы бар, немесе «Standard&Poog'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 | 30,43% | иә |
| 3.12 | Интервалды ПИК 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 | 7,07% | 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 металлдар, металд депозиттер | 0,00% | иә |
| 3.16 | Базалық активтері ПИК 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 |

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

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

| Құрал түрі | Валюта | Бағалы қағаз эмитенті | Теңгемен номинал құны |
|--------------|--------|--|-------------------------|
| МБҚ | KZT | «Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкі» ММ | 798 113 000,00 |
| МБҚ | KZT | «Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкі» ММ | 1 011 642 000,00 |
| Жиыны | | | 1 809 755 000,00 |

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

| Құрал түрі | Валюта | Бағалы қағаз эмитенті | Теңгемен номинал құны |
|--------------|--------|-----------------------|-----------------------|
| Жиыны | | | 0 |

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

| Құрал түрі | Валюта | Бағалы қағаз эмитенті | Теңгемен номинал құны |
|--------------|--------|--|-------------------------|
| МБҚ | KZT | «Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкі» ММ | 609 701 000,00 |
| МБҚ | KZT | «Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкі» ММ | 1 011 130 000,00 |
| Жиыны | | | 1 620 831 000,00 |