

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

По состоянию на 01.09.2022г. пенсионные активы, находящиеся в доверительном управлении АО «Jusan Invest» (далее – Jusan Invest), составили 4 088,42 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

<i>млн тенге</i>					
Наименование	Текущая стоимость на 01.01.2022	Доля на 01.01.2022	Текущая стоимость на 01.09.2022	Доля на 01.09.2022	Прирост/снижение за период, %
ГЦБ МФ РК	516,73	15,07%	709,02	17,34%	37,21%
Ноты НБРК	1 146,26	33,43%	904,08	22,11%	-21,13%
Паи Exchange Traded Funds (ETF)	838,33	24,45%	1 265,38	30,95%	50,94%
Денежные средства на инвестиционных счетах	357,19	10,42%	508,47	12,44%	42,31%
Репо	570,78	16,64%	701,47	17,16%	22,90%
Итого пенсионные активы, находящиеся в управлении АО «Jusan Invest» [1]	3 429,29	100,00%	4 088,42	100,00%	19,22%
Обязательства к оплате по совершенным сделкам	0,00	0,00%	0,00	0,00%	
Итого:	3 429,29		4 088,42		19,22%

По состоянию на 01.09.2022г. средневзвешенная доходность к погашению (YTM) долговых финансовых инструментов, номинированных в тенге, составила 13,81% годовых.

Паи Exchange Traded Funds

Основную долю в портфеле пенсионных активов, переданных в доверительное управление Jusan Invest, занимают паи Exchange Traded Funds (далее - ETF), которые составили 1 265,38 млн тенге. Их доля в портфеле составила 30,95%.

Государственные ценные бумаги Министерства финансов Республики Казахстан

Текущая стоимость государственных ценных бумаг (далее – ГЦБ) Министерства финансов Республики Казахстан (далее – МФ РК) составила 709,02 млн тенге. Их доля в портфеле составила 17,34%.

На отчетную дату средневзвешенная доходность к погашению по ГЦБ МФ РК, номинированным в тенге, составила 13,29% годовых.

Ноты Национального Банка Республики Казахстан

Текущая стоимость нот Национального Банка Республики Казахстана составила 904,08 млн тенге. Их доля в портфеле составила 22,11%.

В отчетном периоде произошли погашения нот НБРК на сумму 916,57 млн тенге.

В рассматриваемом периоде были приобретены 28-дневные ноты НБРК в объеме 300,00 млн тенге с доходностью 14,21%, 28-дневные ноты НБРК в объеме 300,01 млн тенге с доходностью 14,22% и 28-дневные ноты НБРК в объеме 299,96 млн тенге с доходностью 14,23%.

На отчетную дату средневзвешенная доходность к погашению по нотам НБРК, номинированным в тенге, составила 14,22% 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

млн тенге

Валюта	Текущая стоимость на 01.01.2022	Доля на 01.01.2022	Текущая стоимость на 01.09.2022	Доля на 01.09.2022	Прирост/снижение за период, %
Национальная валюта	2 236,50	60,36%	2 615,02	63,96%	16,92%
Доллары США	1 192,89	39,64%	1 473,40	36,04%	23,51%
Итого1:	3 429,39	100,00%	4 088,42	100,00%	19,22%

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 2022г. составил 41,06 млн тенге. Доходность пенсионных активов составила 1,49%.

Структура начисленного инвестиционного дохода представлена в Таблице 3.

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

млн тенге

Наименование	Инвестиционный доход за 2022 год
Доходы в виде вознаграждения по ценным бумагам, в том числе по размещенным вкладам и операциям «обратное РЕПО»	130,04
Доходы (убытки) от рыночной переоценки ценных бумаг	-112,81
Доходы (убытки) от переоценки иностранной валюты	27,61
Доходы (убытки) от переоценки прочих активов (ПФИ)	0,00
Доходы (убытки) по активам, находящимся во внешнем управлении	0,00
Прочие доходы (убытки)	-3,78
Итого:	41,06

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	01.08.2022	995,7554355
2	02.08.2022	995,7554355
3	03.08.2022	995,7554355
4	04.08.2022	995,7554355
5	05.08.2022	995,7554355
6	06.08.2022	995,7554355
7	07.08.2022	995,7554355
8	08.08.2022	993,4894758
9	09.08.2022	993,4894758
10	10.08.2022	993,4894758
11	11.08.2022	993,4894758
12	12.08.2022	993,4894758
13	13.08.2022	993,4894758
14	14.08.2022	993,4894758

15	15.08.2022	1 001,9439679
16	16.08.2022	1 001,9439679
17	17.08.2022	1 001,9439679
18	18.08.2022	1 001,9439679
19	19.08.2022	1 001,9439679
20	20.08.2022	1 001,9439679
21	21.08.2022	1 001,9439679
22	22.08.2022	995,8596474
23	23.08.2022	995,8596474
24	24.08.2022	995,8596474
25	25.08.2022	995,8596474
26	26.08.2022	995,8596474
27	27.08.2022	995,8596474
28	28.08.2022	995,8596474
29	29.08.2022	995,8596474
30	30.08.2022	995,8596474
31	31.08.2022	986,6821232

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 сентября 2022 года представлены в Таблице 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	63,96%	да
1.2	Иностранная валюта	36,04%	да
2	По эмитенту		
2.1	МИНИСТЕРСТВО ФИНАНСОВ РК	49,19%	да
2.2	ГУ "Национальный Банк Республики Казахстан"	49,19%	да
2.3	АО "КАЗАХСТАНСКИЙ ФОНД УСТОЙЧИВОСТИ"	7,42%	да
2.4	ISHARES 1-3 YEAR TREASURY BOND ETF	8,20%	да
2.5	Vanguard S&P 500 ETF	8,20%	да
2.6	НАРОДНЫЙ БАНК КАЗАХСТАНА	0,00%	да
2.7	VanEck Vectors Gold Miners ETF	3,19%	да
2.8	ISHARES CORE S&P 500 ETF	8,20%	да
2.9	SCHWAB EMERGING MARKETS EQUITY ETF	4,87%	да
2.10	ISHARES MSCI GLOBAL GOLD MINERS ETF	8,20%	да
2.11	SCHWAB FUNDAMENTAL U.S. LARGE COMPANY INDEX ETF	4,87%	да

¹ Инвестиционная декларация по доверительному управлению пенсионными активами утверждена решением Совета Директоров АО «Jusan Invest» №18/02/21-01 от 18 февраля 2021 года

2.12	ISHARES MSCI USA ESG SELECT ETF	8,20%	да
2.13	FIDELITY MSCI REAL ESTATE INDEX ETF	2,92%	да
2.14	ISHARES FLOATING RATE BOND ETF	8,20%	да
2.15	VANGUARD SHORT-TERM TREASURY ETF	8,20%	да
2.16	SPDR MSCI ACWI (EX-US) ETF	3,57%	да
3	По виду финансового инструмента:		
3.1	Государственные ценные бумаги Республики Казахстан (в том числе эмитированные в соответствии с законодательством других государств)	49,19%	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	0,00%	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 рейтинговую оценку аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств	0,00%	да

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	7,42%	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	30,95%	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	6,62%	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"	303 015 000,00
ГЦБ	KZT	РГУ "Национальный Банк Республики Казахстан"	303 024 000,00
ГЦБ	KZT	РГУ "Национальный Банк Республики Казахстан"	302 972 000,00
Итого			909 011 000,00

Таблица 7. 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
ГЦБ	KZT	ГУ "Национальный Банк Республики Казахстан"	302 915 000,00
ГЦБ	KZT	ГУ "Национальный Банк Республики Казахстан"	310 658 000,00
ГЦБ	KZT	ГУ "Национальный Банк Республики Казахстан"	303 000 000,00
Итого			916 573 000,00