

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

01.06.2022 жылғы жағдай бойынша «Jysan Invest» АҚ (бұдан әрі - Jysan Invest) сенімгерлік басқаруындағы зейнетақы активтері 3 942,36 млн.теңгені құрады.

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

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

млн теңге

Атауы	01.01.2022 жылға ағымдағы құны	01.01.2022 жылға үлесі	01.06.2022 жылға ағымдағы құны	01.06.2022 жылға үлесі	Кезең үшін өсуі/төмендеуі %
ҚР ҚМ МБҚ	516,73	15,07%	724,17	18,37%	40,14
ҚРҰБ ноталары	1 146,26	33,42%	165,84	4,21%	-85,53
Exchange Traded Funds (ETF) пайлары	838,33	24,45%	1 239,33	31,44%	47,83
Инвестициялық шоттағы ақшалай қаражат	357,29	10,42%	1 812,86	45,98%	407,38
Репо	570,78	16,64%	0,000	0,00%	-100
Басқа активтер (дебиторлық берешек, мерзімі өткен берешек, провизиялар)	0	0,00%	0,17	0,00%	
«Jysan Invest» АҚ басқаруындағы зейнетақы активтерінің жиынтығы [1]	3 429,39	100,00%	3 942,36	100,00%	14,96
Жасалған мәмілелер бойынша төлемге міндеттемелер	0	0,00%	0,000	0,00%	
Жиыны:	3 429,39		3 942,36		14,96

01.06.2022 жылғы жағдай бойынша теңгеге номинирленген борыштық қаржы құралдарын өтеуге орташа алынған кірістілік (ҮТМ) жылдық 12,78% құрайды.

Қазақстан Республикасы Ұлттық Банк ноталары

Jysan Invest сенімгерлік басқаруына берілген зейнетақы активтері портфеліндегі негізгі үлесті Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкі (бұдан әрі - ҚРҰБ) ноталары құрайды, ағымдағы құны 165,84 млн.теңге құрады. Олардың портфельдегі үлесі 4,21%.

Есепті кезеңде 282,83 млн.теңге сомасына ҚРҰБ ноталары өтелді.

Есепті күнге теңгеге номинирленген ҚРҰБ ноталары бойынша өтеуге орташа алынған кірістілік жылдық 9,57% құрады.

Exchange Traded Funds пайлары

Jysan Invest сенімгерлік басқаруға берілген зейнетақы активтері портфеліндегі негізгі үлесін Exchange Traded Funds (бұдан әрі - ETF) пайларының ағымдағы құны 1 239,33 млн.теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 31,44% құрады.

Қазақстан Республикасы Қаржы министрлігінің Мемлекеттік бағалы қағаздары

Қазақстан Республикасы Қаржы министрлігінің (бұдан әрі – ҚР ҚМ) мемлекеттік бағалы қағаздарының (бұдан әрі – МБҚ) ағымдағы құны 724,17 млн.теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 18,37%.

Есепті күнге теңгеге номиналданған ҚР ҚМ МБҚ бойынша өтеуге орташа алынған кірістілігі жылдық 13,52% 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	01.06.2022 жылға ағымдағы құны	01.06.2022 жылға үлесі	Кезең үшін өсуі/төмендеуі %
Ұлттық валюта	2 236,50	60,36%	2 524,78	64,04%	12,89
АҚШ доллары	1 192,89	39,64%	1 417,57	35,96%	18,83
Жиыны:	3 429,39	100,00%	3 942,36	100,00%	14,96

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 68,80 млн. теңгені құрады. Зейнетақы активтерінің кірістілігі -1,10% 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	78,32
Бағалы қағаздарды нарықтық қайта бағалаудан кірістер (шығындар)	-146,25
Шетелдік валютаны қайта бағалаудан кірістер (шығындар)	2,68
Басқа активтерді қайта бағалаудан кірістер (шығындар) (БҚК)	0,00
Сыртқы басқарудағы активтер бойынша кірістер (шығындар)	0,00
Басқа табыстар (шығындар)	-3,55
Жиыны:	-68,80

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	01.05.2022	985,5618322
2	02.05.2022	985,5618322
3	03.05.2022	974,4677466
4	04.05.2022	974,4677466
5	05.05.2022	974,4677466
6	06.05.2022	974,4677466
7	07.05.2022	974,4677466
8	08.05.2022	974,4677466
9	09.05.2022	974,4677466
10	10.05.2022	974,4677466

11	11.05.2022	962,6105089
12	12.05.2022	962,6105089
13	13.05.2022	962,6105089
14	14.05.2022	962,6105089
15	15.05.2022	962,6105089
16	16.05.2022	953,8224272
17	17.05.2022	953,8224272
18	18.05.2022	953,8224272
19	19.05.2022	953,8224272
20	20.05.2022	953,8224272
21	21.05.2022	953,8224272
22	22.05.2022	953,8224272
23	23.05.2022	950,7713979
24	24.05.2022	950,7713979
25	25.05.2022	950,7713979
26	26.05.2022	950,7713979
27	27.05.2022	950,7713979
28	28.05.2022	950,7713979
29	29.05.2022	950,7713979
30	30.05.2022	962,7050677
31	31.05.2022	961,4369335

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. 2022 жылғы 1 маусымдағы 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	Қазақстан теңгесі	64,04%	иә
1.2	Шетелдік валюта	35,96%	иә
2	Эмитент бойынша		
2.1	ҚР ҚАРЖЫ МИНИСТРЛІГІ	22,58%	иә
2.2	«Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкі» ММ	22,58%	иә
2.3	ISHARES 1-3 YEAR TREASURY BOND ETF	8,02%	иә
2.4	Vanguard S&P 500 ETF	7,91%	иә
2.5	VanEck Vectors Gold Miners ETF	4,04%	иә
2.6	ISHARES CORE S&P 500 ETF	8,02%	иә
2.7	SCHWAB EMERGING MARKETS EQUITY ETF	4,80%	иә
2.8	ISHARES MSCI GLOBAL GOLD MINERS ETF	8,02%	иә
2.9	SCHWAB FUNDAMENTAL U.S. LARGE COMPANY INDEX ETF	4,80%	иә
2.10	ISHARES MSCI USA ESG SELECT ETF	8,02%	иә

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

2.11	FIDELITY MSCI REAL ESTATE INDEX ETF	2,95%	иә
2.12	ISHARES FLOATING RATE BOND ETF	8,02%	иә
2.13	VANGUARD SHORT-TERM TREASURY ETF	7,91%	иә
2.14	SPDR MSCI ACWI (EX-US) ETF	3,73%	иә
3	Қаржы құралының түрі бойынша:		
3.1	Қазақстан Республикасының мемлекеттік бағалы қағаздары (оның ішінде басқа мемлекеттердің заңнамасына сәйкес эмитирлинген)	22,58%	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&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	31,44%	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	6,48%	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

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

6-кесте. Есептік айда Жұсан 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	282 827 000
Жиыны			282 827 000