

Информация по инвестиционному управлению пенсионными активами, находящимся в доверительном управлении АО «Jýsan Invest»

По состоянию на 01.05.2021г. пенсионные активы, находящиеся в доверительном управлении АО «Jýsan Invest» (далее – Jýsan Invest), составили 1 217,15 млн тенге.

Структура инвестиционного портфеля финансовых инструментов, сформированного за счет пенсионных активов, переданных в доверительное управление Jýsan Invest, представлена в Таблице 1.

Таблица 1. Структура инвестиционного портфеля по пенсионным активам, переданным в доверительное управление Jýsan Invest, в разрезе финансовых инструментов

млн тенге

Наименование	Текущая стоимость на 01.04.2021	Доля на 01.04.2021	Текущая стоимость на 01.05.2021	Доля на 01.05.2021	Прирост/снижение за период, %
ГЦБ МФ РК	0,00	0,00%	317,61	26,09%	100,00
Ноты НБРК	399,09	60,11%	332,02	27,28%	-16,81
Паи Exchange Traded Funds (ETF)	263,22	39,64%	564,22	46,36%	114,35
Денежные средства на инвестиционных счетах	1,66	0,25%	3,30	0,27%	99,34
Итого пенсионные активы, находящиеся в управлении АО «Jýsan Invest»	663,97	100,00%	1 217,15	100,00%	83,31
Обязательства к оплате по совершенным сделкам	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00
Итого пенсионные активы	663,97		1 217,15		83,31

По состоянию на 01.05.2021г. средневзвешенная доходность к погашению (YTM) долговых финансовых инструментов, номинированных в тенге, составила 9,24% годовых.

Паи Exchange Traded Funds

Основную долю в портфеле пенсионных активов, переданных в доверительное управление Jýsan Invest, занимают паи Exchange Traded Funds (далее - ETF), текущая стоимость которых на конец отчетного месяца составила 564,22 млн тенге. Их доля в портфеле составила 46,36%.

В отчетном периоде были приобретены следующие паи ETF:

iShares Core S&P 500 ETF в объеме 36,63 млн тенге;

Vanguard S&P 500 ETF в объеме 55,21 млн тенге;

Schwab Fundamental US Large Company ETF в объеме 11,88 млн тенге;

Schwab Emerging Markets Equity ETF в объеме 41,70 млн тенге;

SPDR MSCI AWCI ex-US ETF в объеме 43,96 млн тенге;

ARK Innovation ETF в объеме 22,07 млн тенге;

iShares MSCI USA ESG Select ETF в объеме 11,92 млн тенге;

VanEck Vectors Gold Miners ETF в объеме 50,14 млн тенге;

iShares MSCI Global Gold Miners ETF в объеме 5,92 млн тенге.

Ноты Национального Банка Республики Казахстан

Текущая стоимость нот Национального Банка Республики Казахстан (далее – НБРК) составила 332,02 млн тенге. Их доля в портфеле составила 27,28%.

В рассматриваемом периоде были приобретены 182-дневные ноты НБРК в объеме 86,68 млн тенге с доходностью 8,90%.

На отчетную дату средневзвешенная доходность к погашению по нотам НБРК, номинированным в тенге, составила 8,93% годовых.

Государственные ценные бумаги Министерства финансов Республики Казахстан

Текущая стоимость ГЦБ Министерства финансов Республики Казахстан (далее – МФ РК) составила 317,61 млн тенге. Их доля в портфеле составила 26,09%.

В отчетном периоде были приобретены следующие ГЦБ МФ РК:

ГЦБ МФ РК 2022 года гашения в объеме 27, 77 млн тенге и с доходностью 9,18%;

ГЦБ МФ РК 2022 года гашения в объеме 106,21 млн тенге и с доходностью 9,13%;
 ГЦБ МФ РК 2024 года гашения в объеме 98,08 млн тенге и с доходностью 9,57%;
 ГЦБ МФ РК 2025 года гашения в объеме 100,00 млн тенге и с доходностью 10,07%.

На отчетную дату средневзвешенная доходность к погашению по ГЦБ Министерства финансов РК, номинированным в тенге, составила 9,57% годовых.

Операции РЕПО

В отчетном месяце открывались однодневные обратные РЕПО с корзиной государственных ценных бумаг (далее – ГЦБ) в общем объеме 645,18 млн тенге со средней доходностью 8,25%.

Валютная структура

Инвестиционный портфель финансовых инструментов в разрезе валют, в которых номинированы финансовые инструменты, приобретенные за счет пенсионных активов, переданных в доверительное управление Jýsan Invest, представлен в Таблице 2.

Таблица 2. Структура инвестиционного портфеля по пенсионным активам, переданным в доверительное управление Jýsan Invest, в разрезе валют

млн тенге

Валюта	Текущая стоимость на 01.04.2021	Доля на 01.04.2021	Текущая стоимость на 01.05.2021	Доля на 01.05.2021	Прирост/снижение с начала года
Национальная валюта	400,75	60,36%	652,93	53,64%	+62,93%
Доллары США	263,22	39,64%	564,22	46,36%	+114,35%
Итого:	663,97	100,00%	1 217,15	100,00%	+83,31%

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 2021г. составил 30,24 млн тенге. Доходность пенсионных активов составила 3,69%

Структура начисленного инвестиционного дохода представлена в Таблице 3.

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

млн тенге

Наименование	Инвестиционный доход за 2021 год
Доходы в виде вознаграждения по ценным бумагам, в том числе по размещенным вкладам и операциям «обратное РЕПО»	4,99
Доходы (убытки) от рыночной переоценки ценных бумаг	25,37
Доходы (убытки) от переоценки иностранной валюты	0,32
Доходы (убытки) от переоценки прочих активов (ПФИ)	0,00
Доходы (убытки) по активам, находящимся во внешнем управлении	0,00
Прочие доходы (убытки)	-0,44
Итого:	30,24

Информация о стоимости условной единицы

Динамика стоимости условной пенсионной единицы пенсионных активов АО «Единый накопительный пенсионный фонд» (далее – ПА ЕНПФ), находящихся в доверительном управлении Jýsan Invest представлена в Таблице 4.

Таблица 4. Стоимость одной условной единицы ПА ЕНПФ, находящихся в доверительном управлении Jýsan Invest

№ п/п	Дата	Стоимость одной условной единицы
1	01.04.2021	907,5148165
2	02.04.2021	907,5148165
3	03.04.2021	907,5148165
4	04.04.2021	907,5148165
5	05.04.2021	917,7358335
6	06.04.2021	917,7358335
7	07.04.2021	917,7358335
8	08.04.2021	917,7358335
9	09.04.2021	917,7358335
10	10.04.2021	917,7358335
11	11.04.2021	917,7358335
12	12.04.2021	928,5360606
13	13.04.2021	928,5360606
14	14.04.2021	928,5360606
15	15.04.2021	928,5360606
16	16.04.2021	928,5360606
17	17.04.2021	928,5360606
18	18.04.2021	928,5360606
19	19.04.2021	933,6671805
20	20.04.2021	933,6671805
21	21.04.2021	933,6671805
22	22.04.2021	933,6671805
23	23.04.2021	933,6671805
24	24.04.2021	933,6671805
25	25.04.2021	933,6671805
26	26.04.2021	933,5500282
27	27.04.2021	933,5500282
28	28.04.2021	933,5500282
29	29.04.2021	933,5500282
30	30.04.2021	932,6545162

Информация о соблюдении параметров инвестиционной декларации

Структурное распределение пенсионных активов, находящихся в доверительном управлении Jýsan 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 Jýsan Invest, по состоянию на 1 мая 2021 года представлены в Таблице 5.

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

Таблица 5. Лимиты инвестирования по пенсионным активам, переданным в доверительное управление Jýsan Invest

№	Вид финансового инструмента	Фактическое значение (в процентах от общего объема ПА)	Выполнение (да/нет)
1	По валюте		
1.1	Казахстанский тенге	53,64%	да
1.2	Иностранная валюта	46,36%	да
2	По эмитенту		
2.1	МИНИСТЕРСТВО ФИНАНСОВ РК	53,37%	да
2.2	ГУ "Национальный Банк Республики Казахстан"	53,37%	да
2.3	ARK ETF Trust	5,07%	да
2.4	Vanguard S&P 500 ETF	8,74%	да
2.5	VanEck Vectors Gold Miners ETF	8,49%	да
2.6	ISHARES CORE S&P 500 ETF	8,68%	да
2.7	SCHWAB EMERGING MARKETS EQUITY ETF	8,57%	да
2.8	ISHARES MSCI GLOBAL GOLD MINERS ETF	8,68%	да
2.9	SCHWAB FUNDAMENTAL U.S. LARGE COMPANY INDEX ETF	8,57%	да
2.10	SPDR State Street Global Advisors	6,80%	да
2.11	ISHARES MSCI USA ESG SELECT ETF	8,68%	да
3	По виду финансового инструмента:		
3.1	Следующие производные финансовые инструменты, заключенные в целях хеджирования, базовым активом которых являются финансовые инструменты, разрешенные к приобретению за счет пенсионных активов в соответствии с настоящим приложением: опционы; фьючерсы; форварды; свопы; производные финансовые инструменты, представляющие собой комбинацию вышеперечисленных производных финансовых инструментов.	0,00%	да
3.2	Долговые ценные бумаги, выпущенные юридическим лицом, сто процентов акций которого принадлежат Национальному Банку Республики Казахстан	0,00%	да
3.3	Паи Exchange Traded Funds (ETF), Exchange Traded Commodities (ETC), Exchange Traded Notes (ETN), имеющие рейтинговую оценку не ниже «3 звезды» рейтингового агентства Morningstar	46,36%	да
3.4	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	14,55%	да
3.5	Государственные ценные бумаги Республики Казахстан (в том числе эмитированные в соответствии с законодательством других государств)	53,37%	да
3.6	Паи интервальных ПИФов, управляющая компания которых является юридическим лицом, включенные в официальный список фондовой биржи	0,00%	да
3.7	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
3.8	Аффинированные драгоценные металлы, металлические депозиты	0,00%	да

3.9	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
3.10	Негосударственные ценные бумаги, выпущенные организациями 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	0,00%	да
3.11	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
3.12	Долговые ценные бумаги, выпущенные местными исполнительными органами	0,00%	да
3.13	Долговые ценные бумаги, выпущенные Акционерным обществом «Фонд национального благосостояния «Самрук-Казына» и его дочерними организациями	0,00%	да
3.14	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
3.15	Иностранная валюта стран, имеющих суверенный рейтинг не ниже BBB по S&P или рейтинг аналогичного уровня другого агентства	0,00%	да
3.16	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

Информация по покупкам, продажам и погашениям финансовых инструментов, находящихся в инвестиционном портфеле пенсионных активов, переданных в доверительное управление Jýsan Invest

Таблица 6. Сведения по приобретению финансовых инструментов в инвестиционный портфель по пенсионным активам, переданным в доверительное управление Jýsan Invest, в отчетном месяце

Вид инструмента	Валюта	Эмитент ценной бумаги	Номинальная стоимость в тенге
Паи ETF, дата сделки 07.04.2021	USD	ISHARES CORE S&P 500 ETF (IVV US US4642872000)	18 955 861,54
Паи ETF, дата сделки 07.04.2021	USD	Vanguard S&P 500 ETF (VOO US US9229083632)	28 608 977,86
Паи ETF, дата сделки 07.04.2021	USD	SCHWAB FUNDAMENTAL U.S. LARGE COMPANY INDEX ETF (FNDX US EQUITY US8085247711)	6 297 685,09
Паи ETF, дата сделки 07.04.2021	USD	SCHWAB EMERGING MARKETS EQUITY ETF (SCHE US EQUITY US8085247067)	22 101 133,00
Паи ETF, дата сделки 07.04.2021	USD	SPDR State Street Global Advisors (CWI US EQUITY US78463X8487)	21 808 597,10
Паи ETF, дата сделки 07.04.2021	USD	ARK ETF Trust (ARKK US US00214Q1040)	22 070 802,49
Паи ETF, дата сделки 07.04.2021	USD	ISHARES MSCI USA ESG SELECT ETF (SUSA US EQUITY US4642888022)	6 342 623,02
Паи ETF, дата сделки 07.04.2021	USD	VanEck Vectors Gold Miners ETF (GDX US US92189F1066)	27 853 519,28
Паи ETF, дата сделки 07.04.2021	USD	ISHARES MSCI GLOBAL GOLD MINERS ETF (RING US EQUITY US46434G8556)	3 127 325,58
ГЦБ, дата сделки 07.04.2021	KZT	МИНИСТЕРСТВО ФИНАНСОВ РК (MUM132_0004 KZKD00000402)	27 770 000
ГЦБ, дата сделки 09.04.2021	KZT	МИНИСТЕРСТВО ФИНАНСОВ РК (MUM120_0011 KZKD00000527)	106 210 000
Паи ETF, дата сделки 21.04.2021	USD	SCHWAB FUNDAMENTAL U.S. LARGE COMPANY INDEX ETF (FNDX US EQUITY US8085247711)	5 578 955,54
Паи ETF, дата сделки 21.04.2021	USD	SCHWAB EMERGING MARKETS EQUITY ETF (SCHE US EQUITY US8085247067)	19 599 706,17
Паи ETF, дата сделки 21.04.2021	USD	SPDR State Street Global Advisors (CWI US EQUITY US78463X8487)	22 152 595,82
Паи ETF, дата сделки 21.04.2021	USD	ISHARES MSCI USA ESG SELECT ETF (SUSA US EQUITY US4642888022)	5 577 840,95
Паи ETF, дата сделки 21.04.2021	USD	VanEck Vectors Gold Miners ETF (GDX US US92189F1066)	22 284 272,47
Паи ETF, дата сделки 21.04.2021	USD	ISHARES MSCI GLOBAL GOLD MINERS ETF (RING US EQUITY US46434G8556)	2 787 890,13
Паи ETF, дата сделки 22.04.2021	USD	ISHARES CORE S&P 500 ETF (IVV US US4642872000)	17 670 318,04
Паи ETF, дата сделки 22.04.2021	USD	Vanguard S&P 500 ETF (VOO US US9229083632)	26 596 392,44
ГЦБ, дата сделки 23.04.2021	KZT	МИНИСТЕРСТВО ФИНАНСОВ РК (MUM084_0017 KZKD00000881)	98 080 000
ГЦБ, дата сделки 23.04.2021	KZT	МИНИСТЕРСТВО ФИНАНСОВ РК (MUM180_0003 KZKD00000337)	100 000 000
ГЦБ, дата сделки 23.04.2021	KZT	ГУ "Национальный Банк Республики Казахстан" (NTK182_2715 KZW100012795)	86 682 000
Итого			698 156 496,52

Таблица 7. Сведения по продаже финансовых инструментов с инвестиционного портфеля по пенсионным активам, переданным в доверительное управление Jýsan Invest, в отчетном месяце

Вид инструмента	Валюта	Эмитент ценной бумаги	Сумма сделки в тенге
Итого			0

Таблица 8. Сведения по погашениям основного долга по ценным бумагам в инвестиционном портфеле по пенсионным активам, переданным в доверительное управление Jýsan Invest, в отчетном месяце

Вид инструмента	Валюта	Эмитент ценной бумаги	Сумма сделки в тенге
ГЦБ, дата сделки 21.04.2021	KZT	ГУ "Национальный Банк Республики Казахстан" (NTK027_2708 KZW100012720)	152 833 200
Итого			152 833 200

Таблица 9. Сведения по размещениям во вклады иностранных банков пенсионных активов, переданных в доверительное управление Jýsan Invest, в отчетном месяце

Вид инструмента	Валюта	Наименование банка	Сумма сделки в тенге
Итого			0

Таблица 10. Сведения по погашениям основного долга по вкладам в инвестиционном портфеле по пенсионным активам, переданным в доверительное управление Jýsan Invest, в отчетном месяце

Вид инструмента	Валюта	Наименование банка	Сумма к погашению в тенге
Итого			0