

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

По состоянию на 01.10.2021г. пенсионные активы, находящиеся в доверительном управлении АО «Jusan Invest» (далее – Jusan Invest), составили 2 448,70 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 01.04.2021	Доля на 01.04.2021	Текущая стоимость на 01.10.2021	Доля на 01.10.2021	Прирост/снижение за период, %
ГЦБ МФ РК	0,00	0,00%	415,31	16,96%	
Ноты НБРК	399,09	60,11%	873,56	35,67%	118,89
Паи Exchange Traded Funds (ETF)	263,22	39,64%	1 122,50	45,85%	326,90
Денежные средства на инвестиционных счетах	1,66	0,25%	71,55	2,92%	4 218,57
Прочие активы (дебиторская задолженность, просроченная задолженность, провизии)	0,00	0,00%	1,20	0,05%	
Итого пенсионные активы, находящиеся в управлении АО «Jusan Invest»¹	663,97	100,00%	2 448,70	100,00%	268,80
Обязательства к оплате по совершенным сделкам	0,00	0,00%	35,43	1,45%	
Итого:	663,97		2 484,12		274,13

По состоянию на 01.10.2021г. средневзвешенная доходность к погашению (YTM) долговых финансовых инструментов, номинированных в тенге, составила 9,18% годовых.

Паи Exchange Traded Funds

Основную долю в портфеле пенсионных активов, переданных в доверительное управление Jusan Invest, занимают паи Exchange Traded Funds (далее - ETF), текущая стоимость которых на конец отчетного месяца составила 1 122,50 млн тенге. Их доля в портфеле составила 45,85%.

В отчетном периоде были приобретены следующие паи ETF:

Vanguard S&P 500 ETF в объеме 21,42 млн тенге;

SPDR MSCI AWCI ex-US ETF в объеме 20,71 млн тенге;

Schwab Fundamental U.S. Large Company Index ETF в объеме 13,53 млн тенге;

iShares MSCI USA ESG Select ETF в объеме 12,71 млн тенге;

iShares Core S&P 500 ETF в объеме 12,35 млн тенге;

Schwab Emerging Markets Equity ETF в объеме 11,89 млн тенге;

VanEck Vectors Gold Miners ETF в объеме 10,22 млн тенге;

Fidelity MSCI Real Estate Index ETF в объеме 8,19 млн тенге.

Ноты Национального Банка Республики Казахстан

Текущая стоимость нот Национального Банка Республики Казахстан (далее – НБРК) составила 873,56 млн тенге. Их доля в портфеле составила 35,67%.

В рассматриваемом периоде были приобретены 28-дневные ноты НБРК в объеме 53,59 млн тенге с доходностью 8,33%, 91-дневные ноты НБРК в объеме 82,47 млн тенге с доходностью 8,82%, 28-дневные ноты НБРК в объеме 50,92 млн тенге с доходностью 8,31% и 182-дневные ноты НБРК в объеме 95,25 млн тенге с доходностью 9,37%.

В отчетном периоде произошли погашения нот НБРК на сумму 243,07 млн тенге.

¹ Суммарная текущая стоимость пенсионных активов, находящихся в доверительном управлении АО «Jusan Invest» с учетом обязательств к оплате по совершенным сделкам

На отчетную дату средневзвешенная доходность к погашению по нотам НБРК, номинированным в тенге, составила 8,90% годовых.

Государственные ценные бумаги Министерства финансов Республики Казахстан

Текущая стоимость государственных ценных бумаг (далее – ГЦБ) Министерства финансов Республики Казахстан (далее – МФ РК) составила 415,31 млн тенге. Их доля в портфеле составила 16,96%.

В отчетном периоде были приобретены облигации МФ РК 2025 года погашения в объеме 37,80 млн тенге и доходностью 10,02%.

В отчетном периоде продаж и погашений ГЦБ МФ РК не было.

На отчетную дату средневзвешенная доходность к погашению по ГЦБ МФ РК, номинированным в тенге, составила 9,78% годовых.

Операции РЕПО

В отчетном месяце открывались однодневные обратные РЕПО с корзиной ГЦБ в общем объеме 363,17 млн тенге со средней доходностью 8,73%.

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 01.04.2021	Доля на 01.04.2021	Текущая стоимость на 01.10.2021	Доля на 01.10.2021	Прирост/снижение за период, %
Национальная валюта	400,75	60,36%	1 324,98	54,11%	230,62
Доллары США	263,22	39,64%	1 123,72	45,89%	326,91
Итого¹:	663,97	100,00%	2 448,70	100,00%	268,80

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 35,85 млн тенге. Доходность пенсионных активов составила 4,10%

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 2021 год
Доходы в виде вознаграждения по ценным бумагам, в том числе по размещенным вкладам и операциям «обратное РЕПО»	49,76
Доходы (убытки) от рыночной переоценки ценных бумаг	-11,36
Доходы (убытки) от переоценки иностранной валюты	-0,81
Доходы (убытки) от переоценки прочих активов (ПФИ)	0,00
Доходы (убытки) по активам, находящимся во внешнем управлении	0,00
Прочие доходы (убытки)	-1,74
Итого:	35,85

¹ Суммарная текущая стоимость пенсионных активов, находящихся в доверительном управлении АО «Jusan Invest» с учетом обязательств к оплате по совершенным сделкам

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	01.09.2021	945,3678143
2	02.09.2021	945,3678143
3	03.09.2021	945,3678143
4	04.09.2021	945,3678143
5	05.09.2021	945,3678143
6	06.09.2021	953,7056848
7	07.09.2021	953,7056848
8	08.09.2021	953,7056848
9	09.09.2021	953,7056848
10	10.09.2021	953,7056848
11	11.09.2021	953,7056848
12	12.09.2021	953,7056848
13	13.09.2021	943,8991303
14	14.09.2021	943,8991303
15	15.09.2021	943,8991303
16	16.09.2021	943,8991303
17	17.09.2021	943,8991303
18	18.09.2021	943,8991303
19	19.09.2021	943,8991303
20	20.09.2021	939,3717647
21	21.09.2021	939,3717647
22	22.09.2021	939,3717647
23	23.09.2021	939,3717647
24	24.09.2021	939,3717647
25	25.09.2021	939,3717647
26	26.09.2021	939,3717647
27	27.09.2021	936,0917552
28	28.09.2021	936,0917552
29	29.09.2021	936,0917552
30	30.09.2021	936,3771851

Информация о соблюдении параметров инвестиционной декларации

Структурное распределение пенсионных активов, находящихся в доверительном управлении Jusan Invest, соответствует требованиям Инвестиционной декларации по доверительному управлению пенсионными активами². 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 октября 2021 года представлены в Таблице 5.

² Инвестиционная декларация по доверительному управлению пенсионными активами утверждена решением Совета Директоров АО «Jusan Invest» №18/02/21-01 от 18 февраля 2021 года

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	53,34%	да
1.2	Иностранная валюта	46,61%	да
2	По эмитенту		
2.1	МИНИСТЕРСТВО ФИНАНСОВ РК	51,88%	да
2.2	ГУ "Национальный Банк Республики Казахстан"	51,88%	да
2.3	ДБ АО "Сбербанк"	0,00%	Да
2.4	Vanguard S&P 500 ETF	8,89%	да
2.5	VanEck Vectors Gold Miners ETF	6,46%	да
2.6	ISHARES CORE S&P 500 ETF	8,69%	да
2.7	SCHWAB EMERGING MARKETS EQUITY ETF	8,51%	да
2.8	ISHARES MSCI GLOBAL GOLD MINERS ETF	8,79%	да
2.9	SCHWAB FUNDAMENTAL U.S. LARGE COMPANY INDEX ETF	8,51%	да
2.10	SPDR State Street Global Advisors	6,86%	да
2.11	ISHARES MSCI USA ESG SELECT ETF	8,69%	да
2.12	FIDELITY MSCI REAL ESTATE INDEX ETF	5,82%	да
3	По виду финансового инструмента:		
3.1	Государственные ценные бумаги Республики Казахстан (в том числе эмитированные в соответствии с законодательством других государств)	51,88%	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	0,00%	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	45,19%	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	14,91%	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
Паи ETF, дата сделки 07.09.2021	USD	Vanguard S&P 500 ETF (VOO US US9229083632)	12 365 562
Паи ETF, дата сделки 07.09.2021	USD	SCHWAB FUNDAMENTAL U.S. LARGE COMPANY INDEX ETF (FNDX US EQUITY US8085247711)	13 532 499
Паи ETF, дата сделки 07.09.2021	USD	ISHARES MSCI USA ESG SELECT ETF (SUSA US US4642888022)	12 714 409
ГЦБ, дата сделки 08.09.2021	KZT	ГУ "Национальный Банк Республики Казахстан" (NTK028_2742 KZW100013066)	53 590 000
ГЦБ, дата сделки 10.09.2021	KZT	ГУ "Национальный Банк Республики Казахстан" (NTK091_2743 KZW100013074)	82 474 000
ГЦБ, дата сделки 10.09.2021	KZT	МИНИСТЕРСТВО ФИНАНСОВ РК (MUM120_0016 KZKD00000865)	37 800 000
Паи ETF, дата сделки 16.09.2021	USD	ISHARES CORE S&P 500 ETF (IVV US US4642872000)	12 345 774
Паи ETF, дата сделки 16.09.2021	USD	SCHWAB EMERGING MARKETS EQUITY ETF (SCHE US EQUITY US8085247067)	11 893 511
Паи ETF, дата сделки 16.09.2021	USD	SPDR State Street Global Advisors (CWI US EQUITY US78463X8487)	12 743 351
ГЦБ, дата сделки 22.09.2021	KZT	ГУ "Национальный Банк Республики Казахстан" (NTK028_2745 KZW100013090)	50 922 000
ГЦБ, дата сделки 24.09.2021	KZT	ГУ "Национальный Банк Республики Казахстан" (NTK182_2746 KZW100013108)	95 250 000
Паи ETF, дата сделки 29.09.2021	USD	Vanguard S&P 500 ETF (VOO US US9229083632)	9 056 691
Паи ETF, дата сделки 29.09.2021	USD	SPDR State Street Global Advisors (CWI US EQUITY US78463X8487)	7 961 893
Паи ETF, дата сделки 29.09.2021	USD	FIDELITY MSCI REAL ESTATE INDEX ETF (FREL US3160928574)	8 189 286
Паи ETF, дата сделки 29.09.2021	USD	VanEck Vectors Gold Miners ETF (GDX US US92189F1066)	10 215 335
Итого			431 054 312

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, дата сделки 08.09.2021	KZT	ГУ "Национальный Банк Республики Казахстан" (NTK028_2737 KZW100013017)	51 518 000
ГЦБ, дата сделки 10.09.2021	KZT	ГУ "Национальный Банк Республики Казахстан" (NTK091_2724 KZW100012886)	80 703 100
ГЦБ, дата сделки 22.09.2021	KZT	ГУ "Национальный Банк Республики Казахстан" (NTK028_2740 KZW100013041)	50 619 000
ГЦБ, дата сделки 24.09.2021	KZT	ГУ "Национальный Банк Республики Казахстан" (NTK182_2709 KZW100012738)	60 233 000
Итого			243 073 100