

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

По состоянию на 01.06.2023г. пенсионные активы, находящиеся в доверительном управлении АО «Jusan Invest» (далее – Jusan Invest), составили 3 874,21 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

млн тенге

Наименование	Текущая стоимость на 01.01.2023	Доля на 01.01.2023	Текущая стоимость на 01.06.2023	Доля на 01.06.2023	Прирост/снижение с начала года, %
ГЦБ МФ РК	718,26	17,14%	1 456,10	37,58%	102,73%
Ноты НБРК	1 792,94	42,79%	452,03	11,67%	-74,79%
ГЦБ иностранных государств	369,93	8,83%	356,48	9,20%	-3,64%
Паи Exchange Traded Funds (ETF)	1 274,83	30,43%	1 298,02	33,50%	1,82%
Денежные средства на инвестиционных счетах	31,43	0,75%	264,21	6,82%	740,57%
Репо	0,00	0,00%	45,14	1,17%	-
Прочие активы	2,30	0,05%	2,23	0,06%	-3,14%
Итого пенсионные активы, находящиеся в управлении АО «Jusan Invest» [1]	4 189,69	100,00%	3 874,21	100,00%	-7,53%
Обязательства к оплате по совершенным сделкам	0,00	0,00%	0,00	0,00%	-
Итого:	4 189,69	100,00%	3 874,21	100,00%	-7,53%

По состоянию на 01.06.2023г. средневзвешенная доходность к погашению (YTM) долговых финансовых инструментов, номинированных в тенге, составила 14,47% годовых.

Ноты Национального Банка Республики Казахстан

Текущая стоимость нот Национального Банка Республики Казахстан составила 452,03 млн тенге. Их доля в портфеле занимает 11,67%.

В отчетном периоде произошли погашения нот НБРК на сумму 1 163,38 млн тенге.

В рассматриваемом периоде были приобретены 28-дневные ноты НБРК номинальной стоимостью 252,91 млн тенге с доходностью 16,33% и 455,25 млн тенге с доходностью 16,37%.

На отчетную дату средневзвешенная доходность к погашению по нотам НБРК, номинированным в тенге, составила 16,37% годовых.

Паи Exchange Traded Funds

Текущая стоимость паев Exchange Traded Funds (далее - ETF) составила 1 298,02 млн тенге. Их доля в портфеле составила 33,50%.

Государственные ценные бумаги Министерства финансов Республики Казахстан

Основную долю в портфеле пенсионных активов, переданных в доверительное управление Jusan Invest, занимают государственные ценные бумаги (далее – ГЦБ) Министерства финансов Республики Казахстан (далее – МФ РК), текущая стоимость которых составила 1 456,10 млн тенге. Их доля в портфеле составила 37,58%.

На отчетную дату средневзвешенная доходность к погашению по ГЦБ МФ РК, номинированным в тенге, составила 13,88% годовых.

Государственные ценные бумаги иностранных государств

Текущая стоимость ГЦБ иностранных государств составила 356,48 млн тенге. Их доля в портфеле составила 9,20%.

На отчетную дату средневзвешенная доходность к погашению по ГЦБ иностранных государств, номинированным в долларах США, составила 5,23% 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

<i>млн тенге</i>					
Валюта	Текущая стоимость на 01.01.2023	Доля на 01.01.2023	Текущая стоимость на 01.06.2023	Доля на 01.06.2023	Прирост/снижение с начала года, %
Национальная валюта	2 531,86	60,43%	2 213,45	57,13%	-12,58%
Доллары США	1 657,83	39,57%	1 660,76	42,87%	0,18%
Итого:	4 189,69	100,00%	3 874,21	100,00%	-7,53%

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 2023 г. составил 187,94 млн тенге. Доходность пенсионных активов составила 4,23%.

Структура начисленного инвестиционного дохода представлена в Таблице 3.

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

<i>млн тенге</i>	
Наименование	Инвестиционный доход за 2023 год
Доходы в виде вознаграждения по ценным бумагам, в том числе по размещенным вкладам и операциям «обратное РЕПО»	156,99
Доходы (убытки) от рыночной переоценки ценных бумаг	43,38
Доходы (убытки) от переоценки иностранной валюты	-11,84
Доходы (убытки) от переоценки прочих активов (ПФИ)	0,00
Доходы (убытки) по активам, находящимся во внешнем управлении	0,00
Прочие доходы (убытки)	-0,59
Итого:	187,94

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	01.05.2023	1 054,9420866
2	02.05.2023	1 053,9029162
3	03.05.2023	1 053,9029162
4	04.05.2023	1 053,9029162
5	05.05.2023	1 053,9029162
6	06.05.2023	1 053,9029162
7	07.05.2023	1 053,9029162
8	08.05.2023	1 053,9029162
9	09.05.2023	1 053,9029162
10	10.05.2023	1 045,2950654
11	11.05.2023	1 045,2950654
12	12.05.2023	1 045,2950654
13	13.05.2023	1 045,2950654
14	14.05.2023	1 045,2950654
15	15.05.2023	1 052,9456373
16	16.05.2023	1 052,9456373
17	17.05.2023	1 052,9456373
18	18.05.2023	1 052,9456373
19	19.05.2023	1 052,9456373
20	20.05.2023	1 052,9456373
21	21.05.2023	1 052,9456373
22	22.05.2023	1 047,0968417
23	23.05.2023	1 047,0968417
24	24.05.2023	1 047,0968417
25	25.05.2023	1 047,0968417
26	26.05.2023	1 047,0968417
27	27.05.2023	1 047,0968417
28	28.05.2023	1 047,0968417
29	29.05.2023	1 045,2731745
30	30.05.2023	1 045,2731745
31	31.05.2023	1 046,2274863

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 июня 2023 года представлены в Табл. 5.

¹ Инвестиционная декларация по доверительному управлению пенсионными активами утверждена решением Совета Директоров АО «Jusan Invest» №18/02/23-01 от 18 января 2023 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	57,13%	да
1.2	Иностранная валюта	42,87%	да
2	По эмитенту		
2.1	МИНИСТЕРСТВО ФИНАНСОВ РК	50,42%	да
2.2	ГУ "Национальный Банк Республики Казахстан"	50,42%	да
2.3	ISHARES 1-3 YEAR TREASURY BOND ETF	8,44%	да
2.4	US TREASURY N/B	9,20%	да
2.5	Vanguard S&P 500 ETF	9,46%	да
2.6	VanEck Vectors Gold Miners ETF	4,01%	да
2.7	ISHARES CORE S&P 500 ETF	8,44%	да
2.8	SCHWAB EMERGING MARKETS EQUITY ETF	4,76%	да
2.9	ISHARES MSCI GLOBAL GOLD MINERS ETF	8,44%	да
2.10	SCHWAB FUNDAMENTAL U.S. LARGE COMPANY INDEX ETF	4,76%	да
2.11	ISHARES MSCI USA ESG SELECT ETF	8,44%	да
2.12	FIDELITY MSCI REAL ESTATE INDEX ETF	3,00%	да
2.13	ISHARES FLOATING RATE BOND ETF	8,44%	да
2.14	VANGUARD SHORT-TERM TREASURY ETF	9,46%	да
2.15	USA TREASURE N/B	9,20%	да
2.16	SPDR MSCI ACWI (EX-US) ETF	3,90%	да
2.17	Fidelity MSCI Information Technology Index ETF	3,00%	да
3	По виду финансового инструмента:		
3.1	Государственные ценные бумаги Республики Казахстан (в том числе эмитированные в соответствии с законодательством других государств)	50,42%	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 «А-» 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	9,20%	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	33,56%	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	8,09%	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 отчетном месяце

Вид инструмента	Валюта	Эмитент ценной бумаги	Номинальная стоимость в тенге
Дисконтные ноты	KZT	ГУ "Национальный Банк Республики Казахстан"	708 153 000,00
Итого			708 153 000,00

Таблица 7. Сведения по продаже финансовых инструментов в отчетном месяце

Вид инструмента	Валюта	Эмитент ценной бумаги	Сумма сделки в тенге
В отчетном месяце не осуществлялись продажи финансовых инструментов			
Итого			-

Таблица 8. Сведения по погашениям основного долга по ценным бумагам в отчетном месяце

Вид инструмента	Валюта	Эмитент ценной бумаги	Сумма сделки в тенге
Дисконтные ноты	KZT	ГУ "Национальный Банк Республики Казахстан"	1 163 383 000,00
Итого			1 163 383 000,00

Таблица 9. Сведения по размещениям во вклады иностранных банков отчетном месяце

Вид инструмента	Валюта	Наименование банка	Сумма сделки в тенге
В отчетном месяце не осуществлялись размещения во вклады иностранных банков			
Итого			-

Таблица 10. Сведения по погашениям основного долга по вкладам в отчетном месяце

Вид инструмента	Валюта	Наименование банка	Сумма сделки в тенге
В отчетном месяце не осуществлялись погашения основного долга по вкладам			
Итого			-