

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

По состоянию на 01.07.2023г. пенсионные активы, находящиеся в доверительном управлении АО «Jusan Invest» (далее – Jusan Invest), составили 3 747,38 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 01.07.2023	Доля на 01.07.2023	Прирост/снижение с начала года, %
ГЦБ МФ РК	718,26	17,14%	1 457,13	38,88%	102,87%
Ноты НБРК	1 792,94	42,79%	452,31	12,07%	-74,77%
ГЦБ иностранных государств	369,93	8,83%	270,78	7,23%	-26,80%
Паи Exchange Traded Funds (ETF)	1 274,83	30,43%	1 167,93	31,17%	-8,39%
Денежные средства на инвестиционных счетах	31,43	0,75%	339,28	9,05%	979,39%
Репо	0,00	0,00%	57,00	1,52%	-
Прочие активы	2,30	0,05%	2,95	0,08%	28,33%
Итого пенсионные активы, находящиеся в управлении АО «Jusan Invest» [1]	4 189,69	100,00%	3 747,38	100,00%	-10,56%
Обязательства к оплате по совершенным сделкам	0,00	0,00%	0,00	0,00%	-
Итого:	4 189,69	100,00%	3 747,38	100,00%	-10,56%

По состоянию на 01.07.2023г. средневзвешенная доходность к погашению (YTM) долговых финансовых инструментов, номинированных в тенге, составила 14,79% годовых.

Ноты Национального Банка Республики Казахстан

Текущая стоимость нот Национального Банка Республики Казахстан составила 452,31 млн тенге. Их доля в портфеле занимает 12,07%.

В отчетном периоде произошли погашения нот НБРК на сумму 607,06 млн тенге.

В рассматриваемом периоде были приобретены 29-дневные ноты НБРК номинальной стоимостью 151,82 млн тенге с доходностью 16,39% и 455,25 млн тенге с доходностью 16,38%.

На отчетную дату средневзвешенная доходность к погашению по нотам НБРК, номинированным в тенге, составила 16,38% годовых.

Паи Exchange Traded Funds

Текущая стоимость паев Exchange Traded Funds (далее - ETF) составила 1 167,93 млн тенге. Их доля в портфеле составила 31,17%.

В отчетном периоде были осуществлены продажи паёв ETF на сумму 154,65 млн тенге.

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 1 457,13 млн тенге. Их доля в портфеле составила 38,88%.

На отчетную дату средневзвешенная доходность к погашению по ГЦБ МФ РК, номинированным в тенге, составила 14,30% годовых.

Государственные ценные бумаги иностранных государств

Текущая стоимость ГЦБ иностранных государств составила 270,78 млн тенге. Их доля в портфеле составила 7,23%.

В рассматриваемом периоде были осуществлены продажи ГЦБ иностранных государств на сумму 88,91 млн тенге.

На отчетную дату средневзвешенная доходность к погашению по ГЦБ иностранных государств, номинированным в долларах США, составила 5,30% 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 01.01.2023	Доля на 01.01.2023	Текущая стоимость на 01.07.2023	Доля на 01.07.2023	Прирост/снижение с начала года, %
Национальная валюта	2 531,86	60,43%	2 166,79	57,82%	-14,42%
Доллары США	1 657,83	39,57%	1 580,59	42,18%	-4,66%
Итого:	4 189,69	100,00%	3 747,38	100,00%	-10,56%

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 233,28 млн тенге. Доходность пенсионных активов составила 5,39%.

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 2023 год
Доходы в виде вознаграждения по ценным бумагам, в том числе по размещенным вкладам и операциям «обратное РЕПО»	188,49
Доходы (убытки) от рыночной переоценки ценных бумаг	53,28
Доходы (убытки) от переоценки иностранной валюты	-6,46
Доходы (убытки) от переоценки прочих активов (ПФИ)	0,00
Доходы (убытки) по активам, находящимся во внешнем управлении	0,00
Прочие доходы (убытки)	-2,03
Итого:	233,28

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	01.06.2023	1 046,2274863
2	02.06.2023	1 046,2274863
3	03.06.2023	1 046,2274863
4	04.06.2023	1 046,2274863
5	05.06.2023	1 053,5284097
6	06.06.2023	1 053,5284097
7	07.06.2023	1 053,5284097
8	08.06.2023	1 053,5284097
9	09.06.2023	1 053,5284097
10	10.06.2023	1 053,5284097
11	11.06.2023	1 053,5284097
12	12.06.2023	1 054,8435891
13	13.06.2023	1 054,8435891
14	14.06.2023	1 054,8435891
15	15.06.2023	1 054,8435891
16	16.06.2023	1 054,8435891
17	17.06.2023	1 054,8435891
18	18.06.2023	1 054,8435891
19	19.06.2023	1 060,7807198
20	20.06.2023	1 060,7807198
21	21.06.2023	1 060,7807198
22	22.06.2023	1 060,7807198
23	23.06.2023	1 060,7807198
24	24.06.2023	1 060,7807198
25	25.06.2023	1 060,7807198
26	26.06.2023	1 056,5418313
27	27.06.2023	1 056,5418313
28	28.06.2023	1 056,5418313
29	29.06.2023	1 056,5418313
30	30.06.2023	1 057,9228892

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 июля 2023 года представлены в Табл. 5.

Таблица 5. Лимиты инвестирования по пенсионным активам, находящимся в доверительном управлении Jusan Invest

¹ Инвестиционная декларация по доверительному управлению пенсионными активами утверждена решением Совета Директоров АО «Jusan Invest» №18/02/23-01 от 18 января 2023 года

№	Вид финансового инструмента	Фактическое значение (в процентах от общего объема ПА)	Выполнение (да/нет)
1	По валюте		
1.1	Казахстанский тенге	57,82%	да
1.2	Иностранная валюта	42,18%	да
2	По эмитенту		
2.1	МИНИСТЕРСТВО ФИНАНСОВ РК	52,47%	да
2.2	ГУ "Национальный Банк Республики Казахстан"	52,47%	да
2.3	US TREASURY N/B	7,23%	да
2.4	Vanguard S&P 500 ETF	7,84%	да
2.5	VanEck Vectors Gold Miners ETF	4,11%	да
2.6	ISHARES CORE S&P 500 ETF	7,04%	да
2.7	SCHWAB EMERGING MARKETS EQUITY ETF	5,05%	да
2.8	ISHARES MSCI GLOBAL GOLD MINERS ETF	7,04%	да
2.9	SCHWAB FUNDAMENTAL U.S. LARGE COMPANY INDEX ETF	5,05%	да
2.10	ISHARES MSCI USA ESG SELECT ETF	7,04%	да
2.11	FIDELITY MSCI REAL ESTATE INDEX ETF	3,16%	да
2.12	ISHARES FLOATING RATE BOND ETF	7,04%	да
2.13	VANGUARD SHORT-TERM TREASURY ETF	7,84%	да
2.14	USA TREASURY N/B	7,23%	да
2.15	SPDR MSCI ACWI (EX-US) ETF	4,05%	да
2.16	Fidelity MSCI Information Technology Index ETF	3,16%	да
3	По виду финансового инструмента:		
3.1	Государственные ценные бумаги Республики Казахстан (в том числе эмитированные в соответствии с законодательством других государств)	52,47%	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,	0,00%	да

	Межамериканский банк развития, Международный банк реконструкции и развития, Международная финансовая корпорация		
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	7,23%	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	31,25%	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	8,78%	да
3.14	Иностранная валюта стран, имеющих суверенный рейтинг не ниже BBB по S&P или рейтинг аналогичного уровня другого агентства	3,71%	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"	607 067 000,00
Итого			607 067 000,00

Таблица 7. Сведения по продаже финансовых инструментов в отчетном месяце

Вид инструмента	Валюта	Эмитент ценной бумаги	Сумма сделки в тенге
Паи ETF	USD	VANGUARD SHORT-TERM TREASURY ETF	83 861 655,60
Паи ETF	USD	ISHARES 1-3 YEAR TREASURY BOND ETF	70 788 875,98
ГЦБ	USD	Казначейские облигации США	88 912 633,52
Итого			243 563 165,10

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"	607 063 000,00
Итого			607 063 000,00

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			-