

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

01.02.2024 жылғы жағдай бойынша «Jýsan Invest» АҚ (бұдан әрі - Jýsan Invest) сенімгерлік басқаруындағы зейнетақы активтері 6 314,53 млн. теңгені құрады.

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

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

млн теңге

Атауы	01.01.2024 жылға ағымдағы құны	01.01.2024 жылға үлесі	01.02.2024 жылға ағымдағы құны	01.02.2024 жылға үлесі	Кезең үшін өсуі/төмендеуі, %
ҚР ҚМ МБҚ	2 736,07	45,91%	2 650,58	41,98%	-3,12%
Шетелдік мемлекеттердің МБҚ	331,06	5,55%	322,65	5,11%	-2,54%
ХҚҰ	300,24	5,04%	303,79	4,81%	1,18%
ҚР Екінші деңгейдегі банктерінің облигациялары	430,93	7,23%	436,30	6,91%	1,25%
Инвестициялық шоттағы ақшалай қаражат	9,73	0,16%	207,09	3,28%	2 028,37%
Exchange Traded Funds (ETF) пайлары	1 678,55	28,16%	1 335,67	21,15%	-20,43%
Басқа активтер	3,09	0,05%	302,36	4,79%	9 685,11%
Репо	470,42	7,89%	756,09	11,97%	60,73%
«Jýsan Invest» АҚ басқаруындағы зейнетақы активтерінің жиынтығы [1]	5 960,09	100,00%	6 314,53	100,00%	5,95%
Жасалған мәмілелер бойынша төлемге міндеттемелер	0,00	0,00%	0,00	0,00%	–
Жиыны:	5 960,09	100,00%	6 314,53	100,00%	5,95%

01.02.2024 жылғы жағдай бойынша теңгеге номинирленген борыштық қаржы құралдарын өтеуге орташа алынған кірістілік (ҮТМ) жылдық 13,25% құрады.

Қазақстан Республикасы Қаржы министрлігінің Мемлекеттік бағалы қағаздары

Jusan Invest сенімгерлік басқаруына берілген зейнетақы активтері портфеліндегі негізгі үлесін Қазақстан Республикасы Қаржы министрлігінің (бұдан әрі – ҚР ҚМ) мемлекеттік бағалы қағаздары (бұдан әрі – МБҚ) құрайды, оның ағымдағы құны 2 650,58 млн.теңгені құрады. Олардың портфелдегі үлесі 41,98%.

Есепті кезеңде ҚР ҚМ МБҚ 98,08 млн теңге сомасына өтелді.

Есептік күнге теңгеге номиналданған ҚР ҚМ МБҚ бойынша өтеуге орташа алынған кірістілігі жылдық 12,58% құрады.

Шетелдік мемлекеттердің мемлекеттік бағалы қағаздары

Шетелдік мемлекеттердің мемлекеттік бағалы қағаздарының ағымдағы құны 322,65 млн. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 5,11% құрады.

Есепті күнге шетелдік мемлекеттердің МБҚ өтеуге орташа алынған кірістілігі АҚШ долларымен номиналданған жылдық 4,40% құрады.

Халықаралық қаржы ұйымдарының облигациялары

Халықаралық қаржы ұйымдары (бұдан әрі – ХҚҰ) облигацияларының ағымдағы құны есепті айдың соңында 303,79 млн теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 4,81%.

Есепті күнге ХҚҰ облигацияларын өтеуге орташа алынған кірістілік жылдық 14,11% құрады.

Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банктерінің облигациялары

Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банктерінің (бұдан әрі – ҚР ЕДБ) облигацияларының ағымдағы құны есепті айдың соңында 436,30 млн теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 6,91% -ды құрады.

Есепті күнге ҚР ЕДБ облигацияларын өтеуге орташа алынған кірістілігі жылдық 14,80% -ды құрады.

Exchange Traded Funds пайлары

Exchange Traded Funds (бұдан әрі - ETF) пайларының ағымдағы құны 1 335,67 млн.теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 21,15% құрады.

Есептік кезеңде төмендегі ETF пайлары жүзеге асырылды:

201,35 млн теңге көлемінде Schwab Intermediate-Term U.S. Treasury ETF;

201,30 млн теңге көлемінде Vanguard Long-Term Treasury ETF.

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	01.01.2024 жылға ағымдағы құн	01.01.2024 жылға үлесі	01.02.2024 жылға ағымдағы құн	01.02.2024 жылға үлесі	Кезең үшін өсуі/төмендеуі, %
Ұлттық валюта	3 938,39	66,08%	4 151,59	65,75%	5,41%
АҚШ доллары	2 021,69	33,92%	2 162,94	34,25%	6,99%
Басқа валюталар	0,00	0,00%	0,00	0,00%	–
Жиыны:	5 960,09	100,00%	6 314,53	100,00%	5,95%

Инвестициялық қызметтің нәтижелері

Инвестициялық қызметтің нәтижесінде, сондай-ақ шетелдік валюталар бағамының құбылмалылығы салдарынан және қаржы құралдарының нарықтық құнының өзгеруі нәтижесінде 2024 жыл үшін есептелген инвестициялық табыс көлемі 26,45 млн. теңгені құрады. Зейнетақы активтерінің кірістілігі 0,38% құрады.

Есептелген инвестициялық кіріс құрылымы 3-кестеде берілген.

3-кесте. Jýsan Invest сенімгерлік басқаруындағы зейнетақы активтерін басқарудан алынған инвестициялық кіріс құрылымы

млн теңге

Атауы	2024 жылға инвестициялық кіріс
Бағалы қағаздар, орналастырылған салымдар және «кері РЕПО» операциялары бойынша сыйақы түріндегі табыстар	49,15

Бағалы қағаздарды нарықтық қайта бағалаудан кірістер (шығындар)	-12,39
Шетелдік валютаны қайта бағалаудан кірістер (шығындар)	-6,07
Басқа активтерді қайта бағалаудан кірістер (шығындар) (БҚК)	0,00
Сыртқы басқарудағы активтер бойынша кірістер (шығындар)	0,00
Басқа табыстар (шығындар)	-4,24
Жиыны:	26,45

Шартты бірлік құны туралы ақпарат

Јұсан Invest сенімгерлік басқаруындағы «Бірыңғай жинақтаушы зейнетақы қоры» АҚ (бұдан әрі – БЖЗҚ ЗА) зейнетақы активтерінің шартты зейнетақы бірлігі құнының динамикасы 4-кестеде берілген.

4-кесте. Јұсан Invest сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА бір шартты бірлігінің құны

№ р/с	Күні	Бір шартты бірлік құны
1	01.01.2024	1 139,1076438
2	02.01.2024	1 139,1076438
3	03.01.2024	1 140,5551978
4	04.01.2024	1 140,5551978
5	05.01.2024	1 140,5551978
6	06.01.2024	1 140,5551978
7	07.01.2024	1 140,5551978
8	08.01.2024	1 133,2818259
9	09.01.2024	1 133,2818259
10	10.01.2024	1 133,2818259
11	11.01.2024	1 133,2818259
12	12.01.2024	1 133,2818259
13	13.01.2024	1 133,2818259
14	14.01.2024	1 133,2818259
15	15.01.2024	1 140,1314936
16	16.01.2024	1 140,1314936
17	17.01.2024	1 140,1314936
18	18.01.2024	1 140,1314936
19	19.01.2024	1 140,1314936
20	20.01.2024	1 140,1314936
21	21.01.2024	1 140,1314936
22	22.01.2024	1 136,8759461
23	23.01.2024	1 136,8759461
24	24.01.2024	1 136,8759461
25	25.01.2024	1 136,8759461
26	26.01.2024	1 136,8759461
27	27.01.2024	1 136,8759461
28	28.01.2024	1 136,8759461
29	29.01.2024	1 144,1910276
30	30.01.2024	1 144,1910276
31	31.01.2024	1 143,4476687

Инвестициялық декларация параметрлерін сақтау туралы ақпарат

Јұсан Invest сенімгерлік басқаруындағы зейнетақы активтерін құрылымдық үлестіру зейнетақы активтерін сенімгерлік басқару бойынша Инвестициялық декларация¹

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

талаптарына сәйкес келеді. Валюталық позициялар үлесі рұқсат етілген деңгей шегінде қалады және зейнетақы активтерін сенімгерлік басқару бойынша Инвестициялық декларацияның талаптарын бұзбайды. 2024 жылғы 1 ақпандағы 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 (3А жалпы көлемінен пайызбен)	Орындалуы (иә/жоқ)
1	Валюта бойынша		
1.1	Қазақстан теңгесі	65,75%	иә
1.2	Шетелдік валюта	34,25%	иә
2	Эмитент бойынша		
2.1	ҚР ҚАРЖЫ МИНИСТРЛІГІ	53,95%	иә
2.2	«Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкі» ММ	53,95%	иә
2.3	ISHARES 1-3 YEAR TREASURY BOND ETF	3,57%	иә
2.4	Еуразиялық даму банкі	4,81%	иә
2.5	US Treasury N/B	5,11%	иә
2.6	Vanguard S&P 500 ETF	7,00%	иә
2.7	VanEck Vectors Gold Miners ETF	2,30%	иә
2.8	iShares Core S&P 500 ETF	3,57%	иә
2.9	Schwab Emerging Markets Equity ETF	6,25%	иә
2.10	iShares MSCI Global Gold Miners ETF	3,57%	иә
2.11	Schwab Fundamental U.S. Large Company Index ETF	6,25%	иә
2.12	iShares MSCI USA ESG Select ETF	3,57%	иә
2.13	Vanguard Long-Term Treasury ETF	7,00%	иә
2.14	Fidelity Msci Real Estate Index ETF	5,04%	иә
2.15	iShares Floating Rate Bond ETF	3,57%	иә
2.16	АО "Home Credit Bank"	6,91%	иә
2.17	Vanguard Short-Term Treasury ETF	7,00%	иә
2.18	First Trust Nasdaq Oil & Gas ETF	1,78%	иә
2.19	SPDR MSCI ACWI (EX-US) ETF	7,00%	иә
2.20	The Fidelity MSCI Health Care Index ETF	5,04%	иә
2.21	iShares U.S. Consumer Staples ETF	3,57%	иә
2.22	Schwab Intermediate-Term U.S. Treasury ETF	6,25%	иә
3	Қаржы құралының түрі бойынша:		
3.1	Қазақстан Республикасының мемлекеттік бағалы қағаздары (оның ішінде басқа мемлекеттердің заңнамасына сәйкес эмитирлинген)	53,95%	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	4,81%	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	5,12%	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	25,94%	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	0,01%	иә
3.14	S&P бойынша BBB төмен емес тәуелсіз рейтингісі немесе басқа агенттіктің ұқсас деңгейдегі рейтингісі бар елдердің шетелдік валютасы	3,20%	иә
3.15	Тазартылған қымбат металлдар, металл 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 қаржы құралдарын сатып алу бойынша ақпарат мәліметтер

Құрал түрі	Валюта	Бағалы қағаз эмитенті	Теңгемен номинал құны
ETF пайлары	USD	Schwab Intermediate-Term U.S. Treasury ETF	201 353 100,53
ETF пайлары	USD	Vanguard Long-Term Treasury ETF	201 299 351,50
Жиыны			402 652 452,03

7-кесте. Есептік айда қаржы құралдарын сату бойынша мәліметтер

Құрал түрі	Валюта	Бағалы қағаз эмитенті	Құрал түрі
ETF пайлары	USD	iShares MSCI USA ESG Select ETF	19 832 691,12
ETF пайлары	USD	iShares Core S&P 500 ETF	64 868 311,80
ETF пайлары	USD	Vanguard S&P 500 ETF	113 015 050,76
ETF пайлары	USD	iShares MSCI USA ESG Select ETF	19 838 060,23
ETF пайлары	USD	iShares Core S&P 500 ETF	65 376 613,24
ETF пайлары	USD	Vanguard S&P 500 ETF	113 686 044,53
ETF пайлары	USD	SPDR MSCI ACWI (EX-US) ETF	157 294 897,16
ETF пайлары	USD	Schwab Fundamental U.S. Large Company Index ETF	58 308 763,46
ETF пайлары	USD	Vanguard Short-Term Treasury ETF	84 893 988,26
Жиыны			697 114 420,54

8-кесте. Есептік айда бағалы қағаздар бойынша негізгі борышты өтеу бойынша мәліметтер

Құрал түрі	Валюта	Бағалы қағаз эмитенті	Теңгемен мәміле сомасы
МБҚ	KZT	ҚР Қаржы министрлігі	98 080 000,00
Жиыны			98 080 000,00

9-кесте. Есептік айдағы шетелдік банктердің салымдарына орналастырылғандар жөніндегі мәлімет

Құрал түрі	Валюта	Бағалы қағаз эмитенті	Құрал түрі
Есептік айда шетелдік банктердің салымдарына орналастыру жүзеге асырылмады			
Жиыны			-

10-кесте. Есептік айдағы салымдар бойынша негізгі борышты өтеу бойынша мәлімет

Құрал түрі	Валюта	Банк атауы	Өтелетін сомасы теңгемен
Есептік айда салымдар бойынша негізгі борышты өтеу жүзеге асырылмады			
Жиыны			-