

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

01.08.2024 ж. жағдай бойынша «Jusan Invest» АҚ (бұдан әрі - Jusan Invest) сенімгерлік басқаруындағы зейнетақы активтері 9 314,62 млн. теңгені құрады.

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

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

млн теңге

Атауы	01.01.2024 жылға ағымдағы құны	01.01.2024 жылғы үлесі	01.08.2024 жылға ағымдағы құны	01.08.2024 жылға үлесі	Кезең үшін өсуі/төмендеуі, %
ҚР ҚМ МБҚ	2 736,07	45,91%	3 012,88	32,35%	10,12%
Шетелдік мемлекеттердің МБҚ	331,06	5,55%	616,41	6,62%	86,19%
МҚҰ	300,24	5,04%	347,03	3,73%	15,58%
ҚР квазимемлекеттік ұйымдарының облигациялары	0,00	0,00%	375,17	4,03%	–
ҚР екінші деңгейдегі банктерінің облигациялары	430,93	7,23%	701,08	7,53%	62,69%
Шетелдік эмитенттердің корпоративтік облигациялары	0,00	0,00%	809,25	8,69%	–
ҚР эмитенттерінің акциялары және депозитарлық қолхаттары	0,00	0,00%	235,10	2,52%	–
Инвестициялық шоттардағы ақша қаражаты	9,73	0,16%	53,40	0,57%	448,85%
Exchange Traded Funds (ETF) пайлары	1 678,55	28,16%	2 621,24	28,14%	56,16%
Басқа активтер	3,09	0,05%	0,00	0,00%	-
Кері Репо	470,42	7,89%	543,05	5,83%	15,44%
«Jusan Invest» АҚ басқаруындағы зейнетақы активтерінің жиынтығы [1]	5 960,09	100,00%	9 314,62	100,00%	56,28%
Жасалған мәмілелер бойынша төлемге міндеттемелер	0,00	0,00%	0,00	0,00%	448,85%
Жиыны:	5 960,09	100,00%	9 314,62	100,00%	56,16%

01.08.2024 ж. жағдай бойынша теңгемен номиналданған борыштық қаржы құралдарын өтеуге орташа алынған кірістілік (ҮТМ) жылдық 12,88% құрады. АҚШ долларымен номиналданған борыштық қаржы құралдарын өтеуге орташа алынған кірістілік жылдық 4,56%-ды құрды.

Қазақстан Республикасы Қаржы министрлігінің мемлекеттік бағалы қағаздары

Jusan Invest сенімгерлік басқаруына берілген зейнетақы активтері портфеліндегі негізгі үлесті, ағымдағы құны 3 012,88 млн. теңгені құрайтын, Қазақстан Республикасы Қаржы

министрлігінің (бұдан әрі - ҚР ҚМ) мемлекеттік бағалы қағаздары (бұдан әрі - МБҚ) алады. Олардың портфельдегі үлесі 32,35% құрайды.

Есепті күні теңгемен номиналданған ҚР ҚМ МБҚ бойынша өтеуге орташа алынған кірістілік жылдық 12,97% құрады.

Шет мемлекеттердің мемлекеттік бағалы қағаздары

Шетелдік мемлекеттердің МБҚ ағымдағы құны 616,41 млн теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі – 6,62%.

Есепті күні АҚШ долларымен номиналданған шет мемлекеттердің МБҚ бойынша өтеуге орташа алынған кірістілік жылдық 4,56% құрады.

Халықаралық қаржы ұйымдарының облигациялары

Халықаралық қаржы ұйымдары (бұдан әрі - МҚҰ) облигацияларының ағымдағы құны есепті айдың аяғында 347,03 млн. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 3,73%.

Есепті күні МҚҰ облигацияларын өтеуге орташа алынған кірістілік жылдық 11,10% құрады.

Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банктерінің облигациялары

Қазақстан Республикасы екінші деңгейдегі банктерінің (бұдан әрі - ҚР ЕДБ) облигацияларының ағымдағы құны есепті айдың аяғында 701,08 млн. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 7,53%.

Есепті күні ҚР ЕДБ облигацияларын өтеудің орташа алынған кірістілігі жылдық 11,59% -ды құрады.

Қазақстан Республикасы квазимемлекеттік ұйымдарының облигациялары

Қазақстан Республикасының квазимемлекеттік ұйымдары облигацияларының ағымдағы құны есепті айдың аяғында 375,17 млн. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 4,03%.

Есепті күні квазимемлекеттік ұйымдардың облигацияларын өтеудің орташа алынған кірістілігі Қазақстан Республикасы жылдық 13,66% құрады.

Шетелдік эмитенттердің корпоративтік облигациялары

Шетелдік эмитенттердің корпоративтік облигацияларының ағымдағы құны есепті айдың аяғында 809,25 млн. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 8,69%.

Есепті күні шетелдік эмитенттердің корпоративтік облигацияларын өтеуге орташа алынған кірістілік жылдық 13,52% құрады.

Қарастырылып отырған кезеңде JPMorgan Chase Bank корпоративтік облигациялары жылдық 13,80% кірістілігімен номиналды құны бойынша 300,00 млн теңге көлемінде сатып алынды.

ҚР эмитенттерінің акциялары және депозитарлық қолхаттары

ҚР эмитенттерінің депозитарлық қолхаттары мен акцияның ағымдағы құны 235,10 млн теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 2,52% құрады.

Exchange Traded Funds пайлары

Exchange Traded Funds (бұдан әрі - ETF) пайларының ағымдағы құны 2 621,24 млн. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 28,14% құрайды.

Есепті кезеңде мынадай ETF пайлары сатылды:

Fidelity MSCI Real Estate Index ETF 116,06 млн. теңге көлемінде;

Schwab Emerging Markets Equity ETF 160,54 млн. теңге көлемінде.

Валюталық құрылым

Jusan Invest сенімгерлік басқаруына берілген зейнетақы активтері есебінен сатып алынған қаржы құралдарымен номиналданған валюталар бөлінісіндегі қаржы құралдарының инвестициялық портфелі 2-кестеде берілген.

2-кесте. Валюта бөлігінде Jusan Invest сенімгерлік басқаруына берілген зейнетақы активтері бойынша инвестициялық портфель құрылымы

млн теңге

Валюта	01.01.2024 жылға ағымдағы құны	01.01.202. жылға үлесі	01.08.2024 жылға ағымдағы құны	01.08.2024 жылға үлесі	Кезең үшін өсуі/төмендеуі, %
Ұлттық валюта	3 938,39	66,08%	5 897,00	63,3%	49,73%
АҚШ доллары	2 021,69	33,92%	3 417,62	36,7%	69,05%
Бвчкв валюталар	0,00	0,00%	0,00	0,00%	–
Жиынтығы:	5 960,09	100,00%	9 314,62	100,00%	56,28%

Инвестициялық қызмет нәтижелері

Инвестициялық қызмет нәтижесінде 2024 жылға есептелген инвестициялық кіріс мөлшері 743,19 млн теңгені құрады. Жыл басынан бері зейнетақы активтерінің кірістілігі 8,91% -ды құрайды.

Есептелген инвестициялық кіріс құрылымы 3-кестеде берілген.

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

млн теңге

Атауы	2024 жылға инвестициялық кіріс
Бағалы қағаздар бойынша, оның ішінде орналастырылған салымдар мен «кері РЕПО» операциялары бойынша сыйақы түріндегі кірістер	430,70
Бағалы қағаздарды нарықтық қайта бағалаудан кірістер (шығындар)	288,06
Шетелдік валютаны қайта бағалаудан кірістер (шығындар)	30,71
Басқа активтерді қайта бағалаудан кірістер (шығындар) (БҚК)	0,00
Сыртқы басқарудағы активтер бойынша кірістер (шығындар)	0,00
Басқа табыстар (шығындар)	-6,28
Жиыны:	743,19

Шартты бірлік құны туралы ақпарат

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

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

№ р/с	Күні	Бір шартты бірлік құны
1	01.07.2024	1 233,45109011189
2	02.07.2024	1 233,45109011189
3	03.07.2024	1 233,45109011189
4	04.07.2024	1 233,45109011189
5	05.07.2024	1 233,45109011189
6	06.07.2024	1 233,45109011189
7	07.07.2024	1 233,45109011189

8	08.07.2024	1 233,45109011189
9	09.07.2024	1 244,36706496115
10	10.07.2024	1 244,36706496115
11	11.07.2024	1 244,36706496115
12	12.07.2024	1 244,36706496115
13	13.07.2024	1 244,36706496115
14	14.07.2024	1 244,36706496115
15	15.07.2024	1 241,77191114835
16	16.07.2024	1 241,77191114835
17	17.07.2024	1 241,77191114835
18	18.07.2024	1 241,77191114835
19	19.07.2024	1 241,77191114835
20	20.07.2024	1 241,77191114835
21	21.07.2024	1 241,77191114835
22	22.07.2024	1 236,99419168995
23	23.07.2024	1 236,99419168995
24	24.07.2024	1 236,99419168995
25	25.07.2024	1 236,99419168995
26	26.07.2024	1 236,99419168995
27	27.07.2024	1 236,99419168995
28	28.07.2024	1 236,99419168995
29	29.07.2024	1 240,17320030134
30	30.07.2024	1 240,17320030134
31	31.07.2024	1 240,57000973314

Инвестициялық декларация параметрлерін сақтау туралы ақпарат

Jusan Invest сенімгерлік басқаруындағы зейнетақы активтерін құрылымдық үлестіру зейнетақы активтерін сенімгерлік басқару бойынша Инвестициялық декларация¹ талаптарына сәйкес келеді. Валюталық позициялар үлесі рұқсат етілген деңгей шегінде қалады және зейнетақы активтерін сенімгерлік басқару бойынша Инвестициялық декларацияның талаптарын бұзбайды. 2024 жылғы 1 тамыздағы жағдай бойынша Jusan Invest сенімгерлік басқаруындағы зейнетақы активтері бойынша инвестициялау лимиттерін сақтау туралы мәліметтер 5-кестеде берілген.

5-кесте. Jusan Invest сенімгерлік басқаруына берілген зейнетақы активтері бойынша инвестициялау лимиттері

№	Қаржы құралының түрі	Нақты мәні (3А жалпы көлемінен пайызбен)	Орындал уы (иә/жоқ)
1	Валюта бойынша		
1.1	Қазақстан теңгесі	63,31%	иә
1.2	Шетелдік валюта	36,69%	иә
2	Қаржы құралының түрі бойынша:		
2.1	Қазақстан Республикасының мемлекеттік бағалы қағаздары (оның ішінде басқа мемлекеттердің заңнамасына сәйкес эмитирлінген)	32,35%	иә
2.2	Жергілікті атқарушы органдар шығарған борыштық бағалы қағаздар	0,00%	иә

¹ Зейнетақы активтерін сенімгерлік басқару бойынша инвестициялық декларация «Jusan Invest» АҚ Директорлар кеңесінің 2023 жылғы 18 қаңтардағы №18/02/23-01 шешімімен бекітілген.

2.3	Акцияларының жүз пайызы Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкіне тиесілі, заңды тұлға шығарған борыштық бағалы қағаздар	0,00%	иә
2.4	Қазақстан Республикасының және басқа мемлекеттердің заңнамасына сәйкес «Қазақстанның Даму Банкі», «Самұрық-Қазына» ұлттық әл-ауқат қоры», «Бәйтерек» Ұлттық басқарушы холдингі», «Проблемалық кредиттер қоры» акционерлік қоғамы шығарған борыштық бағалы қағаздар	2,38%	иә
2.5	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
2.6	«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
2.7	Келесі халықаралық қаржы ұйымдарының бағалы қағаздары: Азия даму банкі; Америкааралық даму банкі; Африка даму банкі; Еуропа қайта құру және даму банкі; Еуропа инвестициялық банкі; Еуропалық Кеңестің Даму банкі; Жеке секторды дамыту бойынша ислам корпорациясы; Ислам Даму банкі; Инвестициялар кепілдігінің көпжақты агенттігі; Скандинавия инвестиция банкі; Халықаралық валюта қоры; Халықаралық даму қауымдастығы; Инвестициялық дауларды реттеу жөніндегі халықаралық орталық; Халықаралық қайта құру және даму банкі; Халықаралық қаржы корпорациясы, сондай-ақ жарғылық капиталындағы Қазақстан Республикасының үлесі кемінде 25 % құрайтын халықаралық қаржы ұйымы шығарған бағалы қағаздар	9,56%	иә
2.8	«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	6,62%	иә
2.9	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	8,69%	иә

2.1 0	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	11,70%	иә
2.1 1	Morningstar рейтингтік агенттігінің «3 жұлдыз» төмен емес рейтингтік бағасы бар Exchange Traded Funds (ETF), Exchange Traded Commodities (ETC), Exchange Traded Notes (ETN) пайлары	28,14%	иә
2.1 2	Интервалды ПИК пайлары, оларды басқарушы компания қор биржасының ресми тізіміне енгізілген заңды тұлға болып табылады	0,00%	иә
2.1 3	Exchange Traded Funds (ETF) пайлары, олардың активтерінің құрылымы негізгі қор индекстерінің бірінің құрылымын немесе пайлары негізгі қор индекстеріне байлаулы баға құрушыны қайталайды	0,00%	иә
2.1 4	S&P бойынша BBB төмен емес тәуелсіз рейтингісі немесе басқа агенттіктің ұқсас деңгейдегі рейтингісі бар елдердің шетелдік валютасы	0,00%	иә
2.1 5	Тазартылған қымбат металдар, металд депозиттер	0,00%	иә
2.1 6	Базалық активтері ПИК 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

Јusan 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 мәліметтер

Құрал түрі	Валюта	Бағалы қағаз эмитенті	Теңгемен номинал құны
Облигациялар	KZT	JPMorgan Chase Bank	300 000 000,00
Жиыны			300 000 000,00

7-кесте. Есептік айда қаржы құралдарын сату бойынша мәліметтер

Құрал түрі	Валюта	Бағалы қағаз эмитенті	Теңгемен мәміле сомасы
ETF пайлары	USD	Fidelity MSCI Real Estate Index ETF	116 055 289,55
ETF пайлары	USD	Schwab Emerging Markets Equity ETF	160 538 123,68
Жиыны			276 593 413,23

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

Құрал түрі	Валюта	Бағалы қағаз эмитенті	Теңгемен мәміле сомасы
Есепті айда бағалы қағаздар бойынша негізгі қарызды өтеу жүргізілмеді			
Жиыны			-

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

Құрал түрі	Валюта	Бағалы қағаз эмитенті	Теңгемен мәміле сомасы
Есептік айда шетелдік банктердің салымдарына орналастыру жүзеге асырылмады			
Жиынтығы			-

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			-