

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

01.03.2024 жылғы жағдай бойынша «Jýsan Invest» АҚ (бұдан әрі - Jýsan Invest) сенімгерлік басқаруындағы зейнетақы активтері 7 508,09 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	01.03.2024 жылға ағымдағы құны	01.03.2024 жылға үлесі	Кезең үшін өсуі/төмендеуі, %
ҚР ҚМ МБҚ	2 736,07	45,91%	2 874,32	38,28%	5,05%
Шетелдік мемлекеттердің МБҚ	331,06	5,55%	580,84	7,74%	75,45%
ХҚҰ	300,24	5,04%	307,34	4,09%	2,36%
ҚР Екінші деңгейдегі банктерінің облигациялары	430,93	7,23%	409,44	5,45%	-4,99%
ҚР эмитенттерінің акциялары мен депозитарлық қолхаттары	0,00	0,00%	128,42	1,71%	-
Инвестициялық шоттағы ақшалай қаражат	9,73	0,16%	203,10	2,71%	1987,41%
Exchange Traded Funds (ETF) пайлары	1 678,55	28,16%	1 976,45	26,32%	17,75%
Басқа активтер	3,09	0,05%	0,00	0,00%	-100,00%
Репо	470,42	7,89%	1 028,17	13,69%	118,56%
<b>«Jýsan Invest» АҚ басқаруындағы зейнетақы активтерінің жиынтығы [1]</b>	<b>5 960,09</b>	<b>100,00%</b>	<b>7 508,09</b>	<b>100,00%</b>	<b>25,97%</b>
Жасалған мәмілелер бойынша төлемге міндеттемелер	0,00	0,00%	0,00	0,00%	-
<b>Жиыны:</b>	<b>5 960,09</b>	<b>100,00%</b>	<b>7 508,09</b>	<b>100,00%</b>	<b>25,97%</b>

01.03.2024 жылғы жағдай бойынша теңгеге номинирленген борыштық қаржы құралдарын өтеуге орташа алынған кірістілік (YTM) жылдық 13,07% 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 2 874,32 млн.теңгені құрады. Олардың портфелдегі үлесі 38,28%.

Қаралып отырған кезеңде номиналды құны 12,20% кірістілікпен 281,68 млн теңге көлемінде ҚРҚМ МБҚ сатып алынды.

Есептік күнге теңгеге номиналданған ҚР ҚМ МБҚ бойынша өтеуге орташа алынған кірістілігі жылдық 12,34% құрады.

**Шетелдік мемлекеттердің мемлекеттік бағалы қағаздары**

Шетелдік мемлекеттердің мемлекеттік бағалы қағаздарының ағымдағы құны 580,84 млн. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 7,74% құрады.

Қарастырылып отырған кезеңде жылдық 4,60% кірістілікпен 650 мың АҚШ доллары көлемінде АҚШ қазынашылық облигациялары сатып алынды.

Есепті күнге шетелдік мемлекеттердің МБҚ өтеуге орташа алынған кірістілігі АҚШ долларымен номиналданған жылдық 4,56% құрады.

#### **Халықаралық қаржы ұйымдарының облигациялары**

Халықаралық қаржы ұйымдары (бұдан әрі – ХҚҰ) облигацияларының ағымдағы құны есепті айдың соңында 307,34 млн теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 4,09%.

Есепті күнге ХҚҰ облигацияларын өтеуге орташа алынған кірістілік жылдық 14,12% құрады.

#### **Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банктерінің облигациялары**

Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банктерінің (бұдан әрі – ҚР ЕДБ) облигацияларының ағымдағы құны есепті айдың соңында 409,44 млн теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 5,45% -ды құрады.

Есепті күнге ҚР ЕДБ облигацияларын өтеуге орташа алынған кірістілігі жылдық 14,74% -ды құрады.

#### **Exchange Traded Funds пайлары**

Exchange Traded Funds (бұдан әрі - ETF) пайларының ағымдағы құны 1 976,45 млн.теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 26,32% құрады.

Есептік кезеңде төмендегі ETF пайлары жүзеге асырылды:

108,73 млн теңге көлемінде Schwab Intermediate-Term U.S. Treasury ETF;

118,63 млн теңге көлемінде Vanguard Long-Term Treasury ETF;

146,58 млн теңге көлемінде The Fidelity MSCI Health Care Index ETF;

146,60 млн теңге көлемінде iShares U.S. Consumer Staples ETF;

101,85 млн теңге көлемінде Fidelity MSCI Information Technology Index ETF;

101,93 млн теңге көлемінде First Trust Nasdaq-100-Technology Sector Index Fund.

#### **ҚР эмитенттерінің акциялары мен депозитарлық қолхаттары**

Акцияның ағымдағы құны және ҚР эмитенттерінің депозитарлық қолхаттары 128,42 млн теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 1,71% құрады.

Есепті кезеңде 128,62 млн теңге көлемінде "Эйр Астана" АҚ акциялары сатып алынды.

#### **Валюталық құрылым**

Jysan Invest сенімгерлік басқаруына берілген зейнетақы активтерінің есебінен сатып алынған қаржы құралдары номиналданған валюталар бөлігінде қаржы құралдарының инвестициялық портфельі 2-кестеде келтірілген.

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

*млн теңге*

Валюта	01.01.2024 жылға ағымдағы құн	01.01.2024 ж. ағымдағы үлесі	01.03.2024 жылға ағымдағы құн	01.03.2024 ж. ағымдағы үлесі	Кезең үшін өсуі/төмендеуі, %
Ұлттық валюта	3 938,39	66,08%	4 821,72	64,22%	22,43%
АҚШ доллары	2 021,69	33,92%	2 686,37	35,78%	32,88%

Басқа валюталар	0,00	0,00%	0,00	0,00%	–
<b>Жиыны:</b>	<b>5 960,09</b>	<b>100,00%</b>	<b>7 508,09</b>	<b>100,00%</b>	<b>25,97%</b>

### 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 137,63 млн. теңгені құрады. Зейнетақы активтерінің кірістілігі 1,88% 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	103,05
Бағалы қағаздарды нарықтық қайта бағалаудан кірістер (шығындар)	36,95
Шетелдік валютаны қайта бағалаудан кірістер (шығындар)	3,08
Басқа активтерді қайта бағалаудан кірістер (шығындар) (БҚК)	0,00
Сыртқы басқарудағы активтер бойынша кірістер (шығындар)	0,00
Басқа табыстар (шығындар)	-5,45
<b>Жиыны:</b>	<b>137,63</b>

### Шартты бірлік құны туралы ақпарат

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

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

№ р/с	Күні	Бір шартты бірлік құны
1	01.02.2024	1 143,4476687
2	02.02.2024	1 143,4476687
3	03.02.2024	1 143,4476687
4	04.02.2024	1 143,4476687
5	05.02.2024	1 151,0735143
6	06.02.2024	1 151,0735143
7	07.02.2024	1 151,0735143
8	08.02.2024	1 151,0735143
9	09.02.2024	1 151,0735143
10	10.02.2024	1 151,0735143
11	11.02.2024	1 151,0735143
12	12.02.2024	1 147,4245253
13	13.02.2024	1 147,4245253
14	14.02.2024	1 147,4245253
15	15.02.2024	1 147,4245253
16	16.02.2024	1 147,4245253
17	17.02.2024	1 147,4245253
18	18.02.2024	1 147,4245253
19	19.02.2024	1 153,2478429

20	20.02.2024	1 153,2478429
21	21.02.2024	1 153,2478429
22	22.02.2024	1 153,2478429
23	23.02.2024	1 153,2478429
24	24.02.2024	1 153,2478429
25	25.02.2024	1 153,2478429
26	26.02.2024	1 159,5702332
27	27.02.2024	1 159,5702332
28	28.02.2024	1 159,5702332
29	29.02.2024	1160,4849310

### Инвестициялық декларация параметрлерін сақтау туралы ақпарат

Jýsan Invest сенімгерлік басқаруындағы зейнетақы активтерін құрылымдық үлестіру зейнетақы активтерін сенімгерлік басқару бойынша Инвестициялық декларация<sup>1</sup> талаптарына сәйкес келеді. Валюталық позициялар үлесі рұқсат етілген деңгей шегінде қалады және зейнетақы активтерін сенімгерлік басқару бойынша Инвестициялық декларацияның талаптарын бұзбайды. 2024 жылғы 1 наурыздағы 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 (ЗА жалпы көлемінен пайызбен)	Орындалуы (иә/жоқ)
<b>1</b>	<b>Валюта бойынша</b>		
1.1	Қазақстан теңгесі	64,22%	иә
1.2	Шетелдік валюта	35,78%	иә
<b>2</b>	<b>Эмитент бойынша</b>		
2.1	ҚР ҚАРЖЫ МИНИСТРЛІГІ	51,98%	иә
2.2	Еуразиялық даму банкі	4,09%	иә
2.3	US TREASURY N/B	7,74%	иә
2.4	VanEck Vectors Gold Miners ETF	1,83%	иә
2.5	Schwab Emerging Markets Equity ETF	5,97%	иә
2.6	iShares MSCI Global Gold Miners ETF	5,03%	иә
2.7	Vanguard Long-Term Treasury ETF	4,26%	иә
2.8	Fidelity MSCI Real Estate Index ETF	7,84%	иә
2.9	First Trust Nasdaq-100-Technology Sector Index Fund	1,40%	иә
2.10	АО "Home Credit Bank"	5,45%	иә
2.11	The Fidelity MSCI Health Care Index ETF	7,84%	иә
2.12	iShares U.S. Consumer Staples ETF	5,03%	иә
2.13	Fidelity MSCI Information Technology Index ETF	7,84%	иә
2.14	Schwab Intermediate-Term U.S. Treasury ETF	5,97%	иә
2.15	"Эйр Астана" АҚ	1,71%	иә
<b>3</b>	<b>Қаржы құралының түрі бойынша:</b>		

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

3.1	Қазақстан Республикасының мемлекеттік бағалы қағаздары (оның ішінде басқа мемлекеттердің заңнамасына сәйкес эмитирлинген)	51,98%	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	4,09%	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	7,74%	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	1,71%	иә

	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		
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	26,32%	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	0,00%	иә
3.14	S&P бойынша BBB төмен емес тәуелсіз рейтингісі немесе басқа агенттіктің ұқсас деңгейдегі рейтингісі бар елдердің шетелдік валютасы	0,01%	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	Vanguard Long-Term Treasury ETF	9 397 955,14
ETF пайлары	USD	Schwab Intermediate-Term U.S. Treasury ETF	146 583 630,87
ETF пайлары	USD	The Fidelity MSCI Health Care Index ETF	146 601 333,02
ETF пайлары	USD	Fidelity MSCI Information Technology Index ETF	101 853 306,53
ETF пайлары	USD	First Trust Nasdaq-100-Technology Sector Index Fund	101 931 997,76
МБҚ	USD	US Treasury N/B	255 579 922,02
МБҚ	KZT	ҚР Қаржы министрлігі	281 677 000,00
ETF пайлары	USD	Schwab Intermediate-Term U.S. Treasury ETF	108 733 765,42
ETF пайлары	USD	Vanguard Long-Term Treasury ETF	109 234 584,40
GDR	USD	"Эйр Астана" АҚ	128 623 350,00
<b>Жиыны</b>			<b>1 390 216 845,16</b>

**7-кесте. Есептік айда қаржы құралдарын сату бойынша мәліметтер**

Құрал түрі	Валюта	Бағалы қағаз эмитенті	Құрал түрі
ETF пайлары	USD	First Trust Nasdaq Oil & Gas ETF	114 794 193,56
<b>Жиыны</b>			<b>114 794 193,56</b>

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

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

**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			-