

Информация по инвестиционному управлению пенсионными активами, находящимся в доверительном управлении АО «Jýsan Invest»

По состоянию на 01.04.2021г. пенсионные активы, находящиеся в доверительном управлении АО «Jýsan Invest» (далее – Jýsan Invest), составили 663,97 млн тенге.

Структура инвестиционного портфеля финансовых инструментов, сформированного за счет пенсионных активов, переданных в доверительное управление Jýsan Invest, представлена в Таблице 1.

Таблица 1. Структура инвестиционного портфеля по пенсионным активам, переданным в доверительное управление Jýsan Invest, в разрезе финансовых инструментов

<i>млн тенге</i>					
Наименование	Текущая стоимость на 01.03.2021г.	Доля на 01.03.2021г.	Текущая стоимость на 01.04.2021г.	Доля на 01.04.2021г.	Прирост/снижение с 01.03.2021г.
Ноты НБРК	0,00	0,00%	399,09	60,11%	-
Паи Exchange Traded Funds (ETF)	0,00	0,00%	263,22	39,64%	-
Денежные средства на инвестиционных счетах	0,00	0,00%	1,66	0,25%	-
Итого ПА, находящиеся в управлении УИП	0,00	0,00%	663,97	100,00%	-
Обязательства к оплате по совершенным сделкам	0,00	0,00%	0,00	0,00	-
Итого пенсионные активы	0,00	0,00%	663,97	100,00%	-

По состоянию на 01.04.2021г. средневзвешенная доходность к погашению (YTM) долговых финансовых инструментов, номинированных в тенге, составила 8,93% годовых.

Ноты Национального Банка Республики Казахстан

Основную долю в портфеле пенсионных активов, переданных в доверительное управление Jýsan Invest, занимают ноты Национального Банка Республики Казахстан (далее – НБРК), текущая стоимость которых на конец отчетного месяца составила 399,09 млн. тенге. Их доля в портфеле составила 60,11%.

В рассматриваемом периоде были приобретены 182-дневные ноты НБРК в объеме 196,00 млн тенге с доходностью 9,05%, 182-дневные ноты НБРК в объеме 60,23 млн тенге с доходностью 9,16% и 27-дневные ноты НБРК в объеме 152,83 млн тенге с доходностью 8,70%.

На отчетную дату средневзвешенная доходность к погашению по нотам НБРК, номинированным в тенге, составила 8,93% годовых.

Паи Exchange Traded Funds

Текущая стоимость паев Exchange Traded Funds (далее - ETF), на конец отчетного месяца составила 263,22 млн тенге. Их доля в портфеле составила 39,64%.

В отчетном периоде были приобретены следующие паи ETF:

iShares Core S&P 500 ETF в объеме 30,84 млн тенге;

Vanguard S&P 500 ETF в объеме 46,62 млн тенге;

Schwab Fundamental US Large Company ETF в объеме 10,39 млн тенге;

Schwab Emerging Markets Equity ETF в объеме 36,46 млн тенге;

SPDR MSCI AWCI ex-US ETF в объеме 35,97 млн тенге;

ARK Innovation ETF в объеме 35,67 млн тенге;

iShares MSCI USA ESG Select ETF в объеме 10,22 млн тенге;

VanEck Vectors Gold Miners ETF в объеме 45,90 млн тенге;

iShares MSCI Global Gold Miners ETF в объеме 5,05 млн тенге.

Операции РЕПО

В отчетном месяце было открыто однодневное обратное РЕПО с корзиной государственных ценных бумаг (далее – ГЦБ) в объеме 40 млн тенге с доходностью 8,00%.

Валютная структура

Инвестиционный портфель финансовых инструментов в разрезе валют, в которых номинированы финансовые инструменты, приобретенные за счет пенсионных активов, переданных в доверительное управление Jýsan Invest, представлен в Таблице 2.

Таблица 2. Структура инвестиционного портфеля по пенсионным активам, переданным в доверительное управление Jýsan Invest, в разрезе валют

млн тенге

Валюта	Текущая стоимость на 01.03.2021г.	Доля на 01.03.2021г.	Текущая стоимость на 01.04.2021г.	Доля на 01.04.2021г.	Прирост/снижение с 01.03.2021г.
Национальная валюта	0,00	0,00 %	400,75	60,36%	-
Доллары США	0,00	0,00 %	263,22	39,64%	-
Итого:	0,00	0,00%	663,97	100,00%	-

Результаты инвестиционной деятельности

В результате инвестиционной деятельности, а также вследствие волатильности курсов иностранных валют и изменения рыночной стоимости финансовых инструментов, размер начисленного инвестиционного дохода составил 6,18 млн тенге. Доходность пенсионных активов составила 0,89%

Структура начисленного инвестиционного дохода представлена в Таблице 3.

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

млн тенге

Наименование	Инвестиционный доход за 2021 год
Доходы в виде вознаграждения по ценным бумагам, в том числе по размещенным вкладам и операциям «обратное РЕПО»	1,00
Доходы (убытки) от рыночной переоценки ценных бумаг	4,89
Доходы (убытки) от переоценки иностранной валюты	0,39
Доходы (убытки) от переоценки прочих активов (ПФИ)	0,00
Доходы (убытки) по активам, находящимся во внешнем управлении	0,00
Прочие доходы (убытки)	-0,10
Итого:	6,18

Информация о стоимости условной единицы

Динамика стоимости условной пенсионной единицы пенсионных активов АО «Единый накопительный пенсионный фонд» (далее – ПА ЕНПФ), находящихся в доверительном управлении Jýsan Invest представлена в Таблице 4.

Таблица 4. Стоимость одной условной единицы ПА ЕНПФ, находящихся в доверительном управлении Jýsan Invest

№	Дата	Стоимость одной условной единицы
1	15.03.2021	899,4814074
2	16.03.2021	899,4814074
3	17.03.2021	899,4814074
4	18.03.2021	899,4814074
5	19.03.2021	899,4814074
6	20.03.2021	899,4814074
7	21.03.2021	899,4814074
8	22.03.2021	899,4814074
9	23.03.2021	899,4814074
10	24.03.2021	899,4814074
11	25.03.2021	899,9002202
12	26.03.2021	899,9002202
13	27.03.2021	899,9002202
14	28.03.2021	899,9002202
15	29.03.2021	906,5168967
16	30.03.2021	906,5168967

Информация о соблюдении параметров инвестиционной декларации

Структурное распределение пенсионных активов, находящихся в доверительном управлении Jýsan 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 Jýsan Invest, по состоянию на 1 апреля 2021 года представлены в Таблице 5.

Таблица 5. Лимиты инвестирования по пенсионным активам, переданным в доверительное управление Jýsan Invest

№	Вид финансового инструмента	Фактическое значение (в процентах от общего объема ПА)	Выполнение (да/нет)
1	По валюте		
1.1	Иностранная валюта	39,64%	да
1.2	Казахстанский тенге	60,36%	да
2	По эмитенту		
2.1	ГУ "Национальный Банк Республики Казахстан"	60,11%	да
2.2	ARK ETF Trust	5,42%	да
2.3	Vanguard S&P 500 ETF	7,20%	да
2.4	VanEck Vectors Gold Miners ETF	7,06%	да
2.5	ISHARES CORE S&P 500 ETF	7,14%	да
2.6	SCHWAB EMERGING MARKETS EQUITY ETF	7,27%	да
2.7	ISHARES MSCI GLOBAL GOLD MINERS ETF	7,14%	да
2.8	SCHWAB FUNDAMENTAL U.S. LARGE COMPANY INDEX ETF	7,27%	да
2.9	SPDR State Street Global Advisors	5,55%	да
2.10	ISHARES MSCI USA ESG SELECT ETF	7,14%	да
3	По виду финансового инструмента:		
3.1	Долговые ценные бумаги, выпущенные юридическим лицом, сто процентов акций которого принадлежат Национальному Банку Республики Казахстан		да
3.2	Паи Exchange Traded Funds (ETF), Exchange Traded Commodities (ETC), Exchange Traded Notes (ETN), имеющие рейтинговую оценку не ниже «3 звезды» рейтингового агентства Morningstar	39,64%	да
3.3	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	11,98%	да
3.4	Государственные ценные бумаги Республики Казахстан (в том числе эмитированные в соответствии с законодательством других государств)	60,11%	да
3.5	Паи интервальных ПИФов, управляющая компания которых является юридическим лицом, включенные в официальный список фондовой биржи		да
3.6	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		да
3.7	Аффинированные драгоценные металлы, металлические депозиты		да

¹ Инвестиционная декларация по доверительному управлению пенсионными активами утверждена решением Совета Директоров АО «Jýsan Invest» №18/02/21-01 от 18 февраля 2021 года

3.8	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		да
3.9	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		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		да
3.11	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		да
3.12	Долговые ценные бумаги, выпущенные местными исполнительными органами		да
3.13	Долговые ценные бумаги, выпущенные Акционерным обществом «Фонд национального благосостояния «Самрук-Казына» и его дочерними организациями		да
3.14	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		да
3.15	Иностранная валюта стран, имеющих суверенный рейтинг не ниже ВВВ по S&P или рейтинг аналогичного уровня другого агентства		да
3.16	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)		да

Информация по покупкам, продажам и погашениям финансовых инструментов, находящихся в инвестиционном портфеле пенсионных активов, переданных в доверительное управление Jýsan Invest

Таблица 6. Сведения по приобретению финансовых инструментов в инвестиционный портфель по пенсионным активам, переданным в доверительное управление Jýsan Invest, в отчетном месяце

Вид инструмента	Валюта	Эмитент ценной бумаги	Номинальная стоимость в тенге
ГЦБ, дата сделки 15.03.2021	KZT	ГУ «Национальный Банк Республики Казахстан» (NTK182_2702 KZW100012662)	196 000 000
Паи ETF, дата сделки 25.03.2021	USD	ISHARES CORE S&P 500 ETF (IVV US US4642872000)	15 623 550
Паи ETF, дата сделки 25.03.2021	USD	Vanguard S&P 500 ETF (VOO US US9229083632)	23 037 549
Паи ETF, дата сделки 25.03.2021	USD	SCHWAB FUNDAMENTAL U.S. LARGE COMPANY INDEX ETF (FNDX US US8085247711)	5 281 827
Паи ETF, дата сделки 25.03.2021	USD	SCHWAB EMERGING MARKETS EQUITY ETF (SCHE US US8085247067)	18 439 402
Паи ETF, дата сделки 25.03.2021	USD	SPDR State Street Global Advisors (CWI US US78463X8487)	17 765 773
Паи ETF, дата сделки 25.03.2021	USD	ARK ETF Trust (ARKK US US00214Q1040)	17 488 155
Паи ETF, дата сделки 25.03.2021	USD	ISHARES MSCI USA ESG SELECT ETF (SUSA US US4642888022)	5 173 184
Паи ETF, дата сделки 25.03.2021	USD	VanEck Vectors Gold Miners ETF (GDX US US92189F1066)	23 165 154
Паи ETF, дата сделки 25.03.2021	USD	ISHARES MSCI GLOBAL GOLD MINERS ETF (RING US US46434G8556)	2 549 995
Паи ETF, дата сделки 25.03.2021	USD	ISHARES CORE S&P 500 ETF (IVV US US4642872000)	15 219 394
Паи ETF, дата сделки 25.03.2021	USD	Vanguard S&P 500 ETF (VOO US US9229083632)	23 584 370
Паи ETF, дата сделки 25.03.2021	USD	SCHWAB FUNDAMENTAL U.S. LARGE COMPANY INDEX ETF (FNDX US US8085247711)	5 107 288
Паи ETF, дата сделки 25.03.2021	USD	SCHWAB EMERGING MARKETS ETF (SCHE US EQUITY US8085247067)	18 016 483
Паи ETF, дата сделки 25.03.2021	USD	SPDR State Street Global Advisors (CWI US US78463X8487)	18 205 433
Паи ETF, дата сделки 25.03.2021	USD	ARK ETF Trust (ARKK US US00214Q1040)	18 182 867
Паи ETF, дата сделки 25.03.2021	USD	ISHARES MSCI USA ESG SELECT ETF (SUSA US US4642888022)	5 046 875
Паи ETF, дата сделки 25.03.2021	USD	VanEck Vectors Gold Miners ETF (GDX US US92189F1066)	22 732 391
Паи ETF, дата сделки 25.03.2021	USD	ISHARES MSCI GLOBAL GOLD MINERS ETF (RING US US46434G8556)	2 501 126
ГЦБ, дата сделки 25.03.2021	KZT	ГУ «Национальный Банк Республики Казахстан» (NTK027_2708 KZW100012720)	152 833 200
ГЦБ, дата сделки 26.03.2021	KZT	ГУ «Национальный Банк Республики Казахстан» (NTK182_2709 KZW100012738)	60 233 000
Итого			666 187 016

Таблица 7. Сведения по продаже финансовых инструментов с инвестиционного портфеля по пенсионным активам, переданным в доверительное управление Jýsan Invest, в отчетном месяце

Вид инструмента	Валюта	Эмитент ценной бумаги	Сумма сделки в тенге
Итого			0

Таблица 8. Сведения по погашениям основного долга по ценным бумагам в инвестиционном портфеле по пенсионным активам, переданным в доверительное управление Jýsan Invest, в отчетном месяце

Вид инструмента	Валюта	Эмитент ценной бумаги	Сумма сделки в тенге
Итого			0

Таблица 9. Сведения по размещениям во вклады иностранных банков пенсионных активов, переданных в доверительное управление Jysan Invest, в отчетном месяце

Вид инструмента	Валюта	Наименование банка	Сумма сделки в тенге
Итого			0

Таблица 10. Сведения по погашениям основного долга по вкладам в инвестиционном портфеле по пенсионным активам, переданным в доверительное управление Jysan Invest, в отчетном месяце

Вид инструмента	Валюта	Наименование банка	Сумма к погашению в тенге
Итого			0