

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

01.07.2021 жылғы жағдай бойынша «Jusan Invest» АҚ (бұдан әрі - Jusan Invest) сенімгерлік басқаруындағы зейнетақы активтері 1 869,37 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

Атауы	01.04.2021 жылға ағымдағы құны	01.04.2021 жылға үлесі	01.07.2021 жылға ағымдағы құны	01.07.2021 жылға үлесі	Кезең үшін өсуі/төмендеуі %
ҚР ҚМ МБҚ	0,00	0,00%	320,73	17,16%	
ҚРҰБ ноталары	399,09	60,11%	684,89	36,64%	71,61
Exchange Traded Funds (ETF) пайлары	263,22	39,64%	796,15	42,59%	202,46
Инвестициялық шоттағы ақшалай қаражат	1,66	0,25%	2,57	0,14%	55,33
Репо	0,00	0,00	65,03	3,48%	
«Jusan Invest» АҚ басқаруындағы зейнетақы активтерінің жиынтығы¹	663,97	100,00%	1 869,37	100,00%	181,54
Жасалған мәмілелер бойынша төлемге міндеттемелер	0,00	0,00%	0,00	0,00%	
Барлығы:	663,97		1 869,37		181,54

01.07.2021 жылғы жағдай бойынша теңгеге номинирленген борыштық қаржы құралдарын өтеуге орташа алынған кірістілік (YTM) жылдық 9,03% құрайды.

Exchange Traded Funds пайлары

Jusan Invest сенімгерлік басқаруына берілген зейнетақы активтерінің портфелінде негізгі үлесті Exchange Traded Funds алады (бұдан әрі - ETF), олардың есепті айдың соңындағы ағымдағы құны 796,15 млн.теңгені құрады. Олардың портфелдегі үлесі 42,59% құрады.

Есепті кезеңде келесі ETF пайлары сатып алынды:

Fidelity MSCI Real Estate Index ETF 22,43 млн теңге көлемінде;

VanEck Vectors Gold Miners ETF 13,86 млн теңге көлемінде;

SPDR MSCI AWCI ex-US ETF 7,57 млн теңге көлемінде;

iShares Core S&P 500 ETF 6,32 млн теңге көлемінде;

Vanguard S&P 500 ETF 6,30 млн теңге көлемінде;

Schwab Emerging Markets Equity ETF 6,17 млн теңге көлемінде.

Қазақстан Республикасы Ұлттық Банк ноталары

Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкі (бұдан әрі - ҚРҰБ) ноталарының ағымдағы құны 684,89 млн.теңге құрады. Олардың портфелдегі үлесі 36,64%.

Қарастырылып отырған кезеңде 8,13% кірістілікпен 65,41 млн.теңге көлемінде, ҚРҰБ-тың 28-күндік ноталары, 8,65% кірістілікпен 80,70 млн.теңге көлемінде, ҚРҰБ-тың 91-күндік ноталары, 8,90% кірістілікпен 159,79 млн.теңге көлемінде, ҚРҰБ-тың 182-күндік ноталары сатып алынды.

Есепті айда 65,41 млн.теңге сомасына ҚРҰБ ноталары өтелді.

Есепті күнге теңгеге номинирленген ҚРҰБ ноталары бойынша өтеуге орташа алынған кірістілік жылдық 8,81% құрады.

¹ Жасалған мәмілелер бойынша төлеуге міндеттемелер есебімен «Jusan Invest» АҚ сенімгерлік басқаруындағы зейнетақы активтерінің жиынтық ағымдағы құны

Қазақстан Республикасы Қаржы министрлігінің Мемлекеттік бағалы қағаздары

Қазақстан Республикасы Қаржы министрлігінің (бұдан әрі – ҚР ҚМ) МБҚ ағымдағы құны 320,73 млн.теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 17,16%.

Есепті кезеңде ҚР ҚМ МБҚ сатулары, өтеулері және сатып алулар болған жоқ.

Есепті күнге теңгеге номиналданған ҚР Қаржы министрлігінің МБҚ бойынша өтеуге орташа алынған кірістілігі жылдық 9,60% құрады.

РЕПО операциялары

Есепті айда 8,50% кірістілікпен жалпы көлемі 65,03 млн.теңге мемлекеттік бағалы қағаздар (бұдан әрі - МБҚ) қоржынымен апталық кері РЕПО ашылған. Олардың портфельдегі үлесі 3,48%.

Валюталық құрылым

Jusan 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 Jusan Invest сенімгерлік басқаруына берілген зейнетақы активтері бойынша инвестициялық портфель құрылымы

млн теңге

Валюта	01.04.2021 жылғы ағымдағы құны	01.04.2021 жылғы үлесі	01.07.2021 жылғы ағымдағы құны	01.07.2021 жылғы үлесі	Жыл басынан бері өсуі/төмендеуі
Ұлттық валюта	400,75	60,36%	1 071,52	57,32%	167,38
АҚШ доллары	263,22	39,64%	797,85	42,68%	203,11
Жиыны²:	663,97	100,00%	1 869,37	100,00%	181,54

Инвестициялық қызметтің нәтижелері

Инвестициялық қызметтің нәтижесінде, сондай-ақ шетелдік валюталар бағамының құбылмалылығы салдарынан және қаржы құралдарының нарықтық құнының өзгеруі нәтижесінде 2021 жыл үшін есептелген инвестициялық табыс көлемі 41,42 млн. теңгені құрады. Зейнетақы активтерінің кірістілігі 4,30% құрады.

Есептелген инвестициялық кіріс құрылымы 3-кестеде берілген.

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

млн теңге

Атауы	2021 жылғы инвестициялық кіріс
Бағалы қағаздар, орналастырылған салымдар және «кері РЕПО» операциялары бойынша сыйақы түріндегі табыстар	20,64
Бағалы қағаздарды нарықтық қайта бағалаудан кірістер (шығындар)	22,17
Шетелдік валютаны қайта бағалаудан кірістер (шығындар)	-0,38
Басқа активтерді қайта бағалаудан кірістер (шығындар) (БҚК)	0,00
Сыртқы басқарудағы активтер бойынша кірістер (шығындар)	0,00
Басқа табыстар (шығындар)	-1,01
Жиынтығы:	41,42

Шартты бірлік құны туралы ақпарат

² Жасалған мәмілелер бойынша төлеуге міндеттемелер есебімен «Jusan Invest» АҚ сенімгерлік басқаруындағы зейнетақы активтерінің жиынтық ағымдағы құны

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

№ п/п	Күні	Бір шартты бірлік құны
1	01.06.2021	941,5790960
2	02.06.2021	941,5790960
3	03.06.2021	941,5790960
4	04.06.2021	941,5790960
5	05.06.2021	941,5790960
6	06.06.2021	941,5790960
7	07.06.2021	943,4105001
8	08.06.2021	943,4105001
9	09.06.2021	943,4105001
10	10.06.2021	943,4105001
11	11.06.2021	943,4105001
12	12.06.2021	943,4105001
13	13.06.2021	943,4105001
14	14.06.2021	944,1458833
15	15.06.2021	944,1458833
16	16.06.2021	944,1458833
17	17.06.2021	944,1458833
18	18.06.2021	944,1458833
19	19.06.2021	944,1458833
20	20.06.2021	944,1458833
21	21.06.2021	928,6026663
22	22.06.2021	928,6026663
23	23.06.2021	928,6026663
24	24.06.2021	928,6026663
25	25.06.2021	928,6026663
26	26.06.2021	928,6026663
27	27.06.2021	928,6026663
28	28.06.2021	935,8555059
29	29.06.2021	935,8555059
30	30.06.2021	938,1702183

Инвестициялық декларация параметрлерін сақтау туралы ақпарат

Jusan Invest сенімгерлік басқаруындағы зейнетақы активтерін құрылымдық үлестіру зейнетақы активтерін сенімгерлік басқару бойынша Инвестициялық декларация³ талаптарына сәйкес келеді. Валюталық позициялар үлесі рұқсат етілген деңгей шегінде қалады және зейнетақы активтерін сенімгерлік басқару бойынша Инвестициялық декларацияның талаптарын бұзбайды. 2021 жылғы 1 шілдедегі 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

³ Зейнетақы активтерін сенімгерлік басқару бойынша инвестициялық декларация «Jusan Invest» АҚ Директорлар кеңесінің 2021 жылғы 18 ақпандағы №18/02/21-01 шешімімен бекітілген.

№	Қаржы құралының түрі	Нақты мәні (ЗА жалпы көлемінен пайызбен)	Орындалуы (иә/жоқ)
1	Валюта бойынша		
1.1	Қазақстан теңгесі	57,32%	иә
1.2	Шетелдік валюта	42,68%	иә
2	Эмитент бойынша		
2.1	ҚР ҚАРЖЫ МИНИСТРЛІГІ	53,79%	иә
2.2	«Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкі» ММ	53,79%	иә
2.3	Vanguard S&P 500 ETF	8,02%	иә
2.4	VanEck Vectors Gold Miners ETF	7,00%	иә
2.5	«Қазақстан тұрақтылық қоры» АҚ	6,96%	иә
2.6	ISHARES CORE S&P 500 ETF	7,90%	иә
2.7	SCHWAB EMERGING MARKETS EQUITY ETF	7,97%	иә
2.8	ISHARES MSCI GLOBAL GOLD MINERS ETF	7,90%	иә
2.9	SCHWAB FUNDAMENTAL U.S. LARGE COMPANY INDEX ETF	7,97%	иә
2.10	SPDR State Street Global Advisors	6,31%	иә
2.11	ISHARES MSCI USA ESG SELECT ETF	7,90%	иә
2.12	FIDELITY MSCI REAL ESTATE INDEX ETF	5,38%	иә
3	Қаржы құралының түрі бойынша:		
3.1	Акцияларының жүз пайызы Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкіне тиесілі, заңды тұлға шығарған борыштық бағалы қағаздар	0,00%	
3.2	Morningstar рейтингтік агенттігінің «3 жұлдыз» төмен емес рейтингтік бағасы бар Exchange Traded Funds (ETF), Exchange Traded Commodities (ETC), Exchange Traded Notes (ETN) пайлары	37,21%	иә
3.3	Exchange Traded Funds (ETF) пайлары, олардың активтерінің құрылымы негізгі қор индекстерінің бірінің құрылымын немесе пайлары негізгі қор индекстеріне байлаулы баға құрушыны қайталайды	18,89%	иә
3.4	Қазақстан Республикасының мемлекеттік бағалы қағаздары (оның ішінде басқа мемлекеттердің заңнамасына сәйкес эмитирлинген)	53,79%	иә
3.5	Интервалды ПИҚ пайлары, оларды басқарушы компания қор биржасының ресми тізіміне енгізілген заңды тұлға болып табылады	0,00%	иә
3.6	«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	0,00%	иә
3.7	Тазартылған қымбат металлдар, металл депозиттер	0,00%	иә
3.8	Базалық активтері ПИҚ құрамына кіретін құралдар болып табылатын, хеджирлеу мақсатында жасалған туынды құралдар, шетелдік валюта, индекстер: SAC40, DAX, DJIA, ENXT 100, FTSE 100, KASE, MICEX, MSCI World Index, NIKKEI-225, RTSI, S&P 500	0,00%	иә
3.9	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

3.10	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	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
3.12	Жергілікті атқарушы органдар шығарған борыштық бағалы қағаздар	0,00%	иә
3.13	«Самұрқ-Қазына» Ұлттық әл-ауқат қоры» акционерлік қоғамы мен оның еншілес ұйымдары шығарған борыштық бағалы қағаздар	0,00%	иә
3.14	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	0,00%	иә
3.15	S&P бойынша BBB төмен емес тәуелсіз рейтингісі немесе басқа агенттіктің ұқсас деңгейдегі рейтингісі бар елдердің шетелдік валютасы	0,00%	иә
3.16	«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

Jusan Invest сенімгерлік басқаруына берілген зейнетақы активтерінің инвестициялық портфеліндегі қаржы құралдарды сатып алу, сату және өтеу бойынша ақпарат

6-кесте. Есептік айда Jusan Invest сенімгерлік басқаруына берілген зейнетақы активтері бойынша инвестициялық портфеліне қаржы құралдарын сатып алу бойынша мәліметтер

Құрал түрі	Валюта	Бағалы қағаз эмитенті	Теңгемен номинал құны
МБҚ мәміле күні 02.06.2021	KZT	«Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкі» ММ (NTK028_2722 KZW100012860)	65 405 500
МБҚ мәміле күні 11.06.2021	KZT	«Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкі» ММ (NTK091_2724 KZW100012886)	80 703 100
ETF пайлары, мәміле күні 16.06.2021	USD	ISHARES CORE S&P 500 ETF (IVV US US4642872000)	6 319 031
ETF пайлары, мәміле күні 16.06.2021	USD	Vanguard S&P 500 ETF (VOO US US9229083632)	6 300 720
ETF пайлары, мәміле күні 16.06.2021	USD	SCHWAB EMERGING MARKETS EQUITY ETF (SCHE US EQUITY US8085247067)	6 173 576
ETF пайлары, мәміле күні 16.06.2021	USD	SPDR State Street Global Advisors (CWI US EQUITY US78463X8487)	7 574 775
ETF пайлары, мәміле күні 16.06.2021	USD	FIDELITY MSCI REAL ESTATE INDEX ETF (FREL US3160928574)	22 434 702

ETF пайлары, мәміле күні 16.06.2021	USD	VanEck Vectors Gold Miners ETF (GDX US US92189F1066)	13 861 599
МБҚ, мәміле күні 25.06.2021	KZT	«Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкі» ММ (NTK182_2727 KZW100012910)	159 789 000
Жиыны			368 562 003

7-кесте. Есептік айда Jusan Invest сенімгерлік басқаруына берілген зейнетақы активтері бойынша инвестициялық портфельдегі бағалы қағаздар бойынша негізгі борышты өтеу бойынша мәліметтер

Құрал түрі	Валюта	Бағалы қағаз эмитенті	Теңгемен мәміле сомасы
МБҚ, мәміле жасалған күн 30.06.2021	KZT	«Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкі» ММ (NTK028_2722 KZW100012860)	65 405 500
Жиыны			65 405 500