

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

01.08.2023 жылғы жағдай бойынша «Jýsan Invest» АҚ (бұдан әрі - Jýsan Invest) сенімгерлік басқаруындағы зейнетақы активтері 3 931,61млн. 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	01.01.2023 жылға ағымдағы құны	01.01.2023 жылғы үлесі	01.08.2023 жылға ағымдағы құны	01.08.2023 жылға үлесі	Кезең үшін өсуі/төмендеуі, %
ҚР ҚМ МБҚ	718,26	17,14%	1 428,18	36,33%	98,84%
ҚРҰБ ноталары	1 792,94	42,79%	688,36	17,51%	-61,61%
Шетелдік мемлекеттердің МБҚ	369,93	8,83%	267,94	6,82%	-27,57%
Exchange Traded Funds (ETF) пайлары	1 274,83	30,43%	1 211,35	30,81%	-4,98%
Инвестициялық шоттағы ақшалай қаражат	31,43	0,75%	0,27	0,01%	-99,16%
Репо	0,00	0,00%	333,29	8,48%	-
Басқа активтер	2,30	0,05%	2,22	0,06%	-3,58%
«Jýsan Invest» АҚ басқаруындағы зейнетақы активтерінің жиынтығы [1]	4 189,69	100,00%	3,931,61	100,00%	-6,16%
Жасалған мәмілелер бойынша төлемге міндеттемелер	0,00	0,00%	0,00	0,00%	-
Жиыны:	4 189,69	100,00%	3 931,61	100,00%	-6,16%

01.08.2023 жылғы жағдай бойынша теңгеге номинирленген борыштық қаржы құралдарын өтеуге орташа алынған кірістілік (YTM) жылдық 15,03% құрады.

Қазақстан Республикасы Ұлттық Банк ноталары

Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкінің ноталарының ағымдағы құны 688,36 млн теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 17,51%.

Есептік кезеңде ҚР ҰБ ноталары 895,09 млн. теңге сомасына өтелді.

Қарастырылып отырған кезеңде 16,50% кірістілікпен 338,94 млн. теңге және 16,60% кірістілікпен 354,08 млн. теңге көлемінде ҚРҰБ-тың 28-күндік ноталары сатып алынды.

Есептік күнге теңгеге номинирленген ҚРҰБ ноталары бойынша өтеуге орташа алынған кірістілік жылдық 16,55% құрады.

Exchange Traded Funds пайлары

Exchange Traded Funds (бұдан әрі - ETF) пайларының ағымдағы құны 1 211,35 млн. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 30,81% 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 1 428,18 млн. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 36,33%.

Есептік күнге теңгеге номиналданған ҚР ҚМ МБҚ бойынша өтеуге орташа алынған кірістілігі жылдық 14,30% құрады.

Шетелдік мемлекеттердің мемлекеттік бағалы қағаздары

Шетелдік мемлекеттердің мемлекеттік бағалы қағаздарының ағымдағы құны 267,94 млн. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 6,82% құрады.

Есептік күнге шетелдік мемлекеттердің МБҚ өтеуге орташа алынған кірістілігі АҚШ долларымен номиналданған жылдық 5,38% құрады.

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	01.01.2023 жылға ағымдағы құны	01.01.2023 жылға үлесі	01.08.2023 жылға ағымдағы құны	01.08.2023 жылға үлесі	Кезең үшін өсуі/төмендеуі, %
Ұлттық валюта	2 531,86	60,43%	2 450,09	62,32%	-3,23%
АҚШ доллары	1 657,83	39,57%	1 481,51	37,68%	-10,64%
Жиынтығы:	4 189,69	100,00%	3 931,61	100,00%	-6,16%

Инвестициялық қызметтің нәтижелері

Инвестициялық қызметтің нәтижесінде, сондай-ақ шетелдік валюталар бағамының құбылмалылығы салдарынан және қаржы құралдарының нарықтық құнының өзгеруі нәтижесінде 2023 жыл үшін есептелген инвестициялық табыс көлемі 301,62 млн. теңгені құрады. Зейнетақы активтерінің кірістілігі 7,21% құрады.

Есептелген инвестициялық кіріс құрылымы 3-кестеде берілген.

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

млн теңге

Атауы	2023 жылға инвестициялық кіріс
Бағалы қағаздар, орналастырылған салымдар және «кері РЕПО» операциялары бойынша сыйақы түріндегі табыстар	215,13
Бағалы қағаздарды нарықтық қайта бағалаудан кірістер (шығындар)	101,38
Шетелдік валютаны қайта бағалаудан кірістер (шығындар)	-12,60
Басқа активтерді қайта бағалаудан кірістер (шығындар) (БҚҚ)	0,00
Сыртқы басқарудағы активтер бойынша кірістер (шығындар)	0,00
Басқа табыстар (шығындар)	-2,29
Жиыны:	301,62

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	01.07.2023	1 057,9228892
2	02.07.2023	1 057,9228892
3	03.07.2023	1 063,1709751
4	04.07.2023	1 063,1709751
5	05.07.2023	1 063,1709751
6	06.07.2023	1 063,1709751
7	07.07.2023	1 063,1709751
8	08.07.2023	1 063,1709751
9	09.07.2023	1 063,1709751
10	10.07.2023	1 058,2055614
11	11.07.2023	1 058,2055614
12	12.07.2023	1 058,2055614
13	13.07.2023	1 058,2055614
14	14.07.2023	1 058,2055614
15	15.07.2023	1 058,2055614
16	16.07.2023	1 058,2055614
17	17.07.2023	1 071,8721212
18	18.07.2023	1 071,8721212
19	19.07.2023	1 071,8721212
20	20.07.2023	1 071,8721212
21	21.07.2023	1 071,8721212
22	22.07.2023	1 071,8721212
23	23.07.2023	1 071,8721212
24	24.07.2023	1 072,4341151
25	25.07.2023	1 072,4341151
26	26.07.2023	1 072,4341151
27	27.07.2023	1 072,4341151
28	28.07.2023	1 072,4341151
29	29.07.2023	1 072,4341151
30	30.07.2023	1 072,4341151

Инвестициялық декларация параметрлерін сақтау туралы ақпарат

Jýsan 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. 2023 жылғы 1 тамыздағы 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

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

№	Қаржы құралының түрі	Нақты мәні (ЗА жалпы көлемінен пайызбен)	Орындалуы (иә/жоқ)
1	Валюта бойынша		
1.1	Қазақстан теңгесі	62,32%	иә
1.2	Шетелдік валюта	37,68%	иә
2	Эмитент бойынша		
2.1	ҚР ҚАРЖЫ МИНИСТРЛІГІ	53,83%	иә
2.2	«Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкі» ММ	53,83%	иә
2.3	«ҚАЗАҚСТАННЫҢ ОРНЫҚТЫЛЫҚ ҚОРЫ» АҚ	8,48%	иә
2.4	ISHARES 1-3 YEAR TREASURY BOND ETF	6,89%	иә
2.5	US TREASURY N/B	6,82%	иә
2.6	Vanguard S&P 500 ETF	7,65%	иә
2.7	VanEck Vectors Gold Miners ETF	4,00%	иә
2.8	ISHARES CORE S&P 500 ETF	6,89%	иә
2.9	SCHWAB EMERGING MARKETS EQUITY ETF	5,10%	иә
2.10	ISHARES MSCI GLOBAL GOLD MINERS ETF	6,89%	иә
2.11	SCHWAB FUNDAMENTAL U.S. LARGE COMPANY INDEX ETF	5,10%	иә
2.12	ISHARES MSCI USA ESG SELECT ETF	6,89%	иә
2.13	FIDELITY MSCI REAL ESTATE INDEX ETF	3,18%	иә
2.14	ISHARES FLOATING RATE BOND ETF	6,89%	иә
2.15	VANGUARD SHORT-TERM TREASURY ETF	7,65%	иә
2.16	USA TREASURE N/B	6,82%	иә
2.17	SPDR MSCI ACWI (EX-US) ETF	4,04%	иә
2.18	Fidelity MSCI Information Technology Index ETF	3,18%	иә
3	Қаржы құралының түрі бойынша:		
3.1	Қазақстан Республикасының мемлекеттік бағалы қағаздары (оның ішінде басқа мемлекеттердің заңнамасына сәйкес эмитирлинген)	53,83%	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	8,48%	иә
3.4	«Самұқ-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 «А-» 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	0,00%	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	6,82%	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	30,87%	иә
3.12	Интервалды ПИК 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	8,72%	иә
3.14	S&P бойынша BBB төмен емес тәуелсіз рейтингісі немесе басқа агенттіктің ұқсас деңгейдегі рейтингісі бар елдердің шетелдік валютасы	0,00%	иә
3.15	Тазартылған қымбат металлдар, металд депозиттер	0,00%	иә
3.16	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

Jýsan 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
Дисконттық ноттар	KZT	«Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкі» ММ	202 067 100
Дисконттық ноттар	KZT	«Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкі» ММ	354 082 500
Дисконттық ноттар	KZT	«Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкі» ММ	338 937 500
Жиынтығы			895 087 100,00

7-кесте. Есептік айда қаржы құралдарын сату бойынша мәліметтер

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

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

Құрал түрі	Валюта	Бағалы қағаз эмитенті	Теңгемен мәміле сомасы
Дисконттық ноттар	KZT	«Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкі» ММ	455 249 000,00
Дисконттық ноттар	KZT	«Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкі» ММ	202 067 000,00
Жиынтығы			657 316 100,00

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			-