

«БЖЗҚ» АҚ ЗЕЙНЕТАҚЫ АКТИВТЕРІН ИНВЕСТИЦИЯЛЫҚ БАСҚАРУ БОЙЫНША АҚПАРАТ

2017 жылғы 1 қазандағы жағдай бойынша Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкінің басқаруындағы (бұдан әрі – ҚРҰБ) БЖЗҚ зейнетақы активтері (бұдан әрі – ЗА) 7 544,70 млрд. теңгені құрады¹.

БЖЗҚ зейнетақы активтерінің есебінен құрылған қаржы құралдарының инвестициялық портфелінің құрылымы 1-кестеде көрсетілген.

1-кесте. Қаржы құралдарының бөлігінде ҚРҰБ басқаруындағы БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфелінің құрылымы

Атауы	01.01.2017 жылға ағымдағы құны	01.01.2017 жылға үлесі	01.10.2017 жылға ағымдағы құны	01.10.2017 жылға үлесі	млрд. теңге Жыл басынан өсуі/төмендеуі %
ҚР МБҚ	2 910,82	43,57%	3 264,72	43,27%	12,16%
Шетелдік мемлекеттердің МБҚ	365,01	5,46%	830,99	11,01%	127,66%
ХҚҰ	86,63	1,30%	110,76	1,47%	27,85%
ҚР эмитенттерінің корпоративтік облигациялары	84,03	1,26%	59,31	0,79%	-29,42%
ҚР квазимемлекеттік ұйымдардың облигациялары	900,17	13,48%	852,85	11,30%	-5,26%
ҚР ЕДБ облигациялары	1 450,20	21,71%	1 265,47	16,77%	-12,74%
Шетелдік эмитенттердің корпоративтік облигациялары	137,92	2,07%	63,97	0,85%	-53,62%
PPN (құрылымдық ноталар)	31,64	0,47%	31,72	0,42%	0,25%
ҚР эмитенттерінің акциялары және депозитарлық қолхаттары	127,46	1,91%	170,82	2,27%	34,03%
Шетелдік эмитенттердің акциялары және депозитарлық қолхаттары	18,33	0,27%	21,95	0,29%	19,79%
Депозиттер	399,91	5,99%	329,17	4,36%	-17,69%
Шетелдік банктердегі депозиттер	-	-	479,02	6,35%	-
РЕПО	-	-	1,50	0,02%	-
Инвестициялық шоттардағы ақшалай қаражаттар	151,84	2,27%	26,73	0,36%	-82,39%
Басқа активтер (дебиторлық берешек ² , мерзімі өткен берешек, провизиялар)	16,18	0,24%	35,72	0,47%	120,71%
ҚРҰБ басқаруындағы ЗА жиынтығы	6 680,14	100,00%	7 544,70	100,00%	12,94%
Зейнетақы жарналары және төлемдері шоттарындағы ақшалар	9,52		32,17		
Зейнетақы активтерінің жиыны	6 689,66		7 576,87		12,81%

БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфеліндегі борыштық қаржы құралдарын өтеуге орташа алынған кірістілік (ҮТМ) 01.10.2017 жылғы жағдай бойынша жылына 7,8% құрады.

Қазақстан Республикасының мемлекеттік бағалы қағаздары

БЖЗҚ ЗА портфелінде негізгі үлесті ҚР МБҚ құрайды, олардың есепті айдағы ағымдағы құны 160,41 млрд. теңгеге көбейді және 3 264,72 млрд. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 43,27% құрады.

¹ Зейнетақы жарналары мен төлемдері шоттарындағы ақшалар, сондай-ақ ҚҚ-мен мәмілелер бойынша есеп айырысулар үшін қаражат есебінсіз.

² Дебиторлық берешекке қаржы құралдары шығарылымы проспектісінің талаптарына сәйкес Эмитент тарапынан берешекті өтеу күні келіп жеткен сыйақы және/немесе негізгі борыш бойынша алынатын сома енеді.

Есепті кезеңде орташа алынған кірістілігі жылдық 9,3% құрайтын номиналды құны бойынша 1 367,62 млрд. теңге көлемінде ҚРҰБ қысқа мерзімді дисконтты ноттары сатып алынды.

Есепті күнге 1 210,88 млрд.теңге сомасына ҚРҰБ дисконтты ноттары өтелді.

Есепті кезеңде БЖЗҚ ЗА портфелінде ҚР МБҚ өтеуге орташа алынған кірістілік жылдық 8,6% құрады.

Шетелдік мемлекеттердің мемлекеттік бағалы қағаздары

Есепті айға шетелдік мемлекеттердің мемлекеттік бағалы қағаздарының ағымдағы құны 30,09 млрд. теңгеге кеміді және 830,99 млрд. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 11,01% құрады.

Есепті кезеңде ерікті қайта құрылымдау аясында номинал құны бойынша 1-дің 1-ге қатынасында Халықаралық Азербайжан Банкінің облигациялары Азербайжан Республикасының мемлекеттік бағалы қағаздарына ауыстырылды.

Қаралып отырған кезеңде шетелдік мемлекеттердің АҚШ долларына номиналданған 115,88 млрд. теңге көлеміндегі мемлекеттік бағалы қағаздары өтелді.

Есепті кезеңде БЖЗҚ ЗА портфеліндегі шетелдік мемлекеттердің МБҚ өтеуге орташа алынған кірістілік жылдық 2,3% құрады.

Халықаралық қаржы ұйымдарының облигациялары

Есепті айда Халықаралық қаржы ұйымдары облигацияларының ағымдағы құны 29,80 млрд. теңгеге ұлғайды және 110,76 млрд. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 1,47% құрады.

Есепті кезеңде ҚР Ұлттық қорды басқару жөніндегі кеңестің 2017 жылғы 14 наурыздағы шешіміне сәйкес кірістілігі құнсыздану мен сыйлықақы деңгейінде жылдық 0,1% мөлшерін құрайтын номинал құны бойынша 30,00 млрд.теңге сомасына «ААА» деңгейіндегі халықаралық шәкілі бойынша кредиттік рейтингісі бар Халықаралық қаржы ұйымдарының облигациялары сатып алынды.

БЖЗҚ ЗА портфелінде Халықаралық қаржы ұйымдарының бағалы қағаздары сатылмады және өтелмеді.

Есепті күнге БЖЗҚ ЗА портфелінде Халықаралық қаржы ұйымдарының облигацияларын өтеуге орташа алынған кірістілік жылдық 7,2% құрады.

Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банктеріндегі депозиттер

Орташа алынған өтеу мерзімі 5,7 жыл құрайтын ҚР ЕДБ-дағы салымдардың ағымдағы құны есепті айда 7,24 млрд. теңгеге кеміді және 329,17 млрд. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 4,36% құрады.

Есепті кезеңде ҚР ЕДБ салымдары бойынша 4,5 млрд.теңге сомасына негізгі борыш ішінара өтелді.

ҚР ЕДБ салымдарына БЖЗҚ ЗА орналастырылған жоқ.

Есепті күнге ҚР ЕДБ салымдарын өтеуге орташа алынған кірістілік жылдық 10,7% құрады.

Шетелдік банктердегі депозиттер

Орташа алынған өтеу мерзімі 1,8 ай құрайтын шетелдік банктердегі салымдардың ағымдағы құны есепті айда 69,04 млрд. теңгеге ұлғайды және 479,02 млрд. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 6,35% құрады.

Есепті күнге шетелдік банктердегі салымдарды өтеуге орташа алынған кірістілік жылдық 1,3% құрады.

Қазақстан Республикасы эмитенттерінің корпоративтік облигациялары

Есепті айда ҚР эмитенттерінің корпоративтік облигацияларының ағымдағы құны 0,55 млрд. теңгеге ұлғайды және 59,31 млрд. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 0,79% құрады.

БЖЗҚ ЗА портфелінде ҚР эмитенттерінің корпоративтік облигациялары сатып алынбады, сатылмады және өтелмеді.

Есепті кезеңде БЖЗҚ ЗА портфелінде ҚР эмитенттерінің корпоративтік облигацияларын өтеуге орташа алынған кірістілік жылдық 11,4% құрады.

Қазақстан Республикасы квазимемлекеттік ұйымдардың облигациялары

Есепті айда ҚР квазимемлекеттік ұйымдары облигацияларының ағымдағы құны «Самрұқ-Қазына» ҰӘҚ» АҚ облигацияларын жоспарлы өтеу есебінен (өтеу кезеңі 24.09.2017 жылдан бастап 06.10.2017 жылға дейін) 18,00 млрд.теңгеге кеміді және 852,85 млрд.теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 11,30% құрады.

Есепті кезеңде БЖЗҚ ЗА портфелінде ҚР квазимемлекеттік ұйымдарының облигациялары сатылмады, сатып алынбады және өтелмеді.

Есепті күнге БЖЗҚ ЗА портфелінде квазимемлекеттік ұйымдардың облигацияларын өтеуге орташа алынған кірістілік жылдық 9,7% құрады.

Қазақстан Республикасы екінші деңгейдегі банктерінің облигациялары

Есепті айда ҚР ЕДБ облигацияларының ағымдағы құны 1,05 млрд.теңгеге кеміді және 1 265,47 млрд.теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 16,77% құрады.

Есепті кезеңде БЖЗҚ ЗА портфелінде 9,09 млрд. теңге сомасына теңгеге номиналданған ҚР ЕДБ облигацияларының негізгі борышы өтелді.

Қаралған кезеңде БЖЗҚ ЗА портфелінде ҚР ЕДБ облигациялары сатылған жоқ және сатып алынған жоқ.

Есепті кезеңде БЖЗҚ ЗА портфелінде ҚР ЕДБ облигацияларын өтеуге орташа алынған кірістілік жылдық 9,9% құрады.

Шетелдік эмитенттердің корпоративтік облигациялары

Есепті айда шетелдік эмитенттердің корпоративтік облигацияларының ағымдағы құны 70,39 млрд. теңгеге кеміді және 63,97 млрд. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 0,85% құрады.

Есепті кезеңде ерікті қайта құрылымдау аясында номинал құны бойынша 1-дің 1-ге қатынасында Халықаралық Азербайжан Банкінің облигациялары Азербайжан Республикасының мемлекеттік бағалы қағаздарына ауыстырылды.

Есепті кезеңде БЖЗҚ ЗА портфелінде шетелдік эмитенттердің облигациялары сатып алынбады, сатылмады және өтелмеді.

Есепті күнге БЖЗҚ ЗА портфелінде шетелдік эмитенттердің корпоративтік облигацияларын өтеуге орташа алынған кірістілік жылдық 5,8 % құрады.

Шетелдік эмитенттердің PPN (құрылымдық ноттар)

Есепті айда шетелдік эмитенттердің PPN (құрылымдық ноттар) ағымдағы құны 0,49 млрд. теңгеге ұлғайды және 31,72 млрд. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 0,42% құрады.

Есепті кезеңде БЖЗҚ ЗА портфелінде шетелдік эмитенттердің PPN (құрылымдық ноттар) сатып алынбады, сатылмады және өтелмеді.

Қазақстан Республикасы эмитенттерінің акциялары және депозитарлық қолхаттары

Есепті айда ҚР эмитенттері акцияларының және депозитарлық қолхаттарының ағымдағы құны 1,43 млрд. теңгеге кеміді және 170,82 млрд. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 2,27% құрады.

Есепті кезеңде БЖЗҚ ЗА портфелінде ҚР эмитенттерінің акциялары мен депозитарлық қолхаттары сатып алынбады, сатылмады.

Шетелдік эмитенттердің акциялары және депозитарлық қолхаттары

Есепті айда шетелдік эмитенттердің акциялары мен депозитарлық қолхаттарының ағымдағы құны 0,66 млрд. теңгеге ұлғайды және 21,95 млрд. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 0,29% құрады.

Есепті кезеңде шетелдік эмитенттердің акциялары мен депозитарлық қолхаттары сатып алынбады және сатылмады.

БЖЗҚ зейнетақы активтерінің есебінен сатып алынған қаржы құралдары номиналданған валюталар бөлігінде қаржы құралдарының инвестициялық портфелі 2-кестеде келтірілген.

2-кесте. Валюталар бөлігінде ҚРҰБ сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфелінің құрылымы

Валюта	<i>млрд. теңге</i>				
	01.01.2017 жылға ағымдағы құны	01.01.2017 жылға үлесі	01.10.2017 жылға ағымдағы құны	01.10.2017 жылға үлесі	Жыл басынан өсуі/төмендеуі, %
Ұлттық валюта	5 142,38	76,98%	5 292,64	71,20%	2,92%
АҚШ доллары	1 492,44	22,34%	2 096,74	28,20%	40,49%
Ресей рублі	35,12	0,53%	36,24	0,49%	3,21%
Басқа валюталар	10,20	0,15%	8,04	0,11%	-21,16%
Жиыны:	6 680,14	100,00%	7 433,66	100,00%	11,28%

Инвестициялық қызметтің нәтижелері

Инвестициялық қызметтің нәтижесінде, сондай-ақ шетелдік валюталар бағамының құбылмалығы салдарынан, сонымен қатар қаржы құралдарының нарықтық құнының өзгеруі нәтижесінде 2017 жылғы 9 айда есептелген инвестициялық табыс көлемі 494,5 млрд. теңгені құрады. Осылайша, салымшылардың (алушылардың) шоттарына бөлінген БЖЗҚ зейнетақы активтерінің табыстылығы 2017 жылғы 1 қаңтардан 30 қыркүйекке дейінгі кезең үшін 8,91% құрады.

Көрсетілген кезеңге есептелген инвестициялық табыс құрылымы 3-кестеде көрсетілген.

3-кесте. ҚРҰБ сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА бойынша алынған инвестициялық табыс құрылымы

Атауы	<i>млрд. теңге</i>
	2017 жылдың басынан инвестициялық табыс
Бағалы қағаздар, орналастырылған салымдар және «кері РЕПО» операциялары бойынша сыйақы түріндегі табыстар	380,65
Бағалы қағаздарды нарықтық қайта бағалаудан табыстар (шығындар)	30,44
Шетелдік валютаны қайта бағалаудан табыстар (шығындар)	79,27
Басқа табыстар (шығындар)	4,11
Жиыны:	494,47

Инвестициялық декларация параметрлерін сақтау туралы ақпарат

Сенімгерлік басқарудағы БЖЗҚ ЗА құрылымдық үйлестіруі БЖЗҚ Инвестициялық декларациясының талаптарына сәйкес келеді³. Валюталық позициялар үлесі рұқсат етілген деңгей шегінде қалады және БЖЗҚ Инвестициялық декларациясының талаптарын бұзбайды, 01.10.2017 жылғы жағдай бойынша деректер 4-кестеде көрсетілген.

4-кесте. БЖЗҚ ЗА инвестициялау лимиттері

³ БЖЗҚ Инвестициялық декларациясы Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкінің 2016 жылғы 17 наурыздағы №86 қаулысымен бекітілген

№ р/р	Қаржы құралдарының түрі	Нақты мәні (зейнетақы активтерінен пайызбен)	Орындалуы (иә/жоқ)
1	Шетелдік эмитенттер:	20,39%	да
1.1	мемлекеттік, агенттік және халықаралық қаржы ұйымдарының (ХҚҰ) бағалы қағаздары:	12,48%	да
1)	«Standard&Poor's» агенттігінің халықаралық шәкілі бойынша «BBB-» төмен емес рейтинг бағасы бар немесе басқа рейтинг агенттіктерінің бірінің осыған ұқсас деңгейінің рейтинг бағасы бар;	9,30%	да
2)	«Standard&Poor's» агенттігінің халықаралық шәкілі бойынша «BB+»-дан «BB-» дейін рейтинг бағасы бар немесе басқа рейтинг агенттіктерінің бірінің осыған ұқсас деңгейінің рейтинг бағасы бар;	3,19%	иә
1.2	Корпоративтік борыштық бағалы қағаздар:	0,85%	иә
1)	«Standard&Poor's» агенттігінің халықаралық шәкілі бойынша «BBB-» төмен емес бағалы қағаздар және/немесе эмитент рейтинг бағасы бар немесе басқа рейтинг агенттіктерінің бірінің осыған ұқсас деңгейінің рейтингтік бағасы бар	0,09%	иә
2)	Standard&Poor's» агенттігінің халықаралық шәкілі бойынша «BB+»-дан «BB-» дейін бағалы қағаздар және/немесе эмитент рейтинг бағасы бар немесе басқа рейтинг агенттіктерінің бірінің осыған ұқсас деңгейінің рейтингтік бағасы бар;	0,76%	иә
1.3	«Standard&Poor's» агенттігінің халықаралық шәкілі бойынша «BBB-» төмен емес бағалы қағаздар және/немесе эмитент рейтинг бағасы бар немесе басқа рейтинг агенттіктерінің бірінің осыған ұқсас деңгейінің рейтингтік бағасы бар жылжымайтын мүлік (MBS) пен активтерге (ABS) салынған бағалы қағаздар	0,00%	иә
1.4	Акциялар, акцияларға депозитарлық қолхаттар	0,29%	иә
1.5	«Standard&Poor's» агенттігінің халықаралық шәкілі бойынша «A-» төмен емес рейтингтік бағасы бар немесе басқа рейтинг агенттіктерінің бірінің осыған ұқсас деңгейінің рейтингтік бағасы бар шетелдік банктердегі депозиттер (салымдар)	6,35%	иә
1.6	«Standard&Poor's» агенттігінің халықаралық шәкілі бойынша «BBB-» төмен емес рейтинг бағасы бар немесе басқа рейтинг агенттіктерінің бірінің осыған ұқсас деңгейінің рейтингтік бағасы бар ұйымдар шығарған құрылымдық өнімдер	0,42%	иә
1.7	Ислам қаржыландыру құралдары:	0,00%	иә
1)	«Standard&Poor's» агенттігінің халықаралық шәкілі бойынша «BBB-» төмен емес бағалы қағаздар және/немесе эмитент рейтинг бағасы бар немесе басқа рейтинг агенттіктерінің бірінің осыған ұқсас деңгейінің рейтингтік бағасы бар;	0,00%	иә
2)	Standard&Poor's» агенттігінің халықаралық шәкілі бойынша «BB+»-дан «BB-» дейін бағалы қағаздар және/немесе эмитент рейтинг бағасы бар немесе басқа рейтинг агенттіктерінің бірінің осыған ұқсас деңгейінің рейтингтік бағасы бар;	0,00%	иә
2	Қазақстандық эмитенттер:	78,01%	иә
2.1	Қазақстан Республикасының Қаржы министрлігі, Қазақстан Республикасының Ұлттық Банкі шығарған Қазақстан Республикасының мемлекеттік бағалы қағаздары	43,27%	иә
2.1-1	Қазақстан Республикасының жергілікті атқарушы органдары шығарған Қазақстан Республикасының мемлекеттік бағалы қағаздары	0,00%	иә
2.1-2	Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкінің депозиттері	0,00%	иә
2.2	Квазимемлекеттік сектор субъектілерінің бағалы қағаздары	12,29%	иә
2.3	Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банктерінің қаржы құралдары	22,10%	иә
2.4	«Standard&Poor's» агенттігінің халықаралық шәкілі бойынша «B-» төмен емес бағалы қағаздар және/немесе эмитент рейтинг бағасы бар немесе басқа рейтинг агенттіктерінің бірінің осыған ұқсас деңгейінің рейтингтік бағасы бар Қазақстан Республикасының квазимемлекеттік секторы мен екінші деңгейдегі банктері субъектілерінің борыштық бағалы қағаздарын қоспағанда мемлекеттік емес борыштық бағалы қағаздары	0,08%	иә
2.4-1	Қазақстан Республикасы Үкіметінің кепілдігі және/немесе кепілдемесімен шығарылған мемлекеттік емес борышты бағалы қағаздары	0,00%	иә
2.5	Қазақстан қор биржасының ресми тізімінің бірінші санатына кіретін Қазақстан Республикасының квазимемлекеттік секторы мен екінші деңгейдегі банктері субъектілерінің үлесті бағалы қағаздарын қоспағанда мемлекеттік емес үлесті бағалы қағаздары	0,27%	иә
2.6	Қазақстан қор биржасының ресми тізіміне енгізілген ислам қаржыландыру құралдары	0,00%	иә

5-кесте. Қаржы құралдарының жекелеген түрлеріне БЖЗҚ зейнетақы активтерін инвестициялау лимиттері

№ р/р	Қаржы құралдарының түрі	Нақты мәні (зейнетақы активтерінен пайызбен)	Орындалуы (иә/жоқ)
1	Стандартты туынды қаржы құралдары	0,00%	иә

1)	егер туынды қаржы құралдары инвестициялық тәуекелді хеджирлеуге пайдаланылған жағдайда	0,00%	иә
2	Құймадағы және металл шоттардағы алтын	0,00%	иә

БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфеліндегі қаржы құралдарды сатып алу, сату және өтеу бойынша ақпарат

6-кесте. Есепті айда сатып алынған қаржы құралдары жөніндегі мәліметтер

Мәміле жасалған күн	Өтеу күні	Құрал түрі	Бағалы қағаз эмитенті	ҰСН (ISIN)	Валюта	Тенгемен номиналды құны	Шетелдік валютадағы номиналды құны
04.09.2017	11.09.2017	Ноттар	ҚР Ұлттық Банкі	KZW1KD070343	KZT	130 000 000 000	
05.09.2017	12.09.2017	Ноттар	ҚР Ұлттық Банкі	KZW1KD070350	KZT	60 000 000 000	
06.09.2017	04.10.2017	Ноттар	ҚР Ұлттық Банкі	KZW1KD280371	KZT	48 700 000 000	
07.09.2017	14.09.2017	Ноттар	ҚР Ұлттық Банкі	KZW1KD070384	KZT	134 400 000 000	
08.09.2017	15.09.2017	Ноттар	ҚР Ұлттық Банкі	KZW1KD070392	KZT	15 400 000 000	
11 09 2017	18.09.2017	Ноттар	ҚР Ұлттық Банкі	KZW1KD070418	KZT	82 875 028 700	
12 09 2017	19.09.2017	Ноттар	ҚР Ұлттық Банкі	KZW1KD070426	KZT	59 525 471 700	
13 09 2017	11.10.2017	Ноттар	ҚР Ұлттық Банкі	KZW1KD280447	KZT	60 300 000 000	
14 09 2017	21.09.2017	Ноттар	ҚР Ұлттық Банкі	KZW1KD070459	KZT	116 366 053 900	
15 09 2017	22.09.2017	Ноттар	ҚР Ұлттық Банкі	KZW1KD070467	KZT	4 166 355 500	
18 09 2017	25.09.2017	Ноттар	ҚР Ұлттық Банкі	KZW1KD070483	KZT	21 000 000 000	
19 09 2017	26.09.2017	Ноттар	ҚР Ұлттық Банкі	KZW1KD070491	KZT	70 811 049 900	
20 09 2017	18.10.2017	Ноттар	ҚР Ұлттық Банкі	KZW1KD280512	KZT	63 745 408 300	
21 09 2017	28.09.2017	Ноттар	ҚР Ұлттық Банкі	KZW1KD070525	KZT	55 692 029 000	
22 09 2017	29.09.2017	Ноттар	ҚР Ұлттық Банкі	KZW1KD070533	KZT	63 000 000 000	
25.09.2017	02.10.2017	Ноттар	ҚР Ұлттық Банкі	KZW1KD070541	KZT	60 475 226 900	
26.09.2017	03.10.2017	Ноттар	ҚР Ұлттық Банкі	KZW1KD070558	KZT	76 451 083 100	
27 09 2017	25.10.2017	Ноттар	ҚР Ұлттық Банкі	KZW1KD280579	KZT	113 816 093 400	
28 09 2017	05.10.2017	Ноттар	ҚР Ұлттық Банкі	KZW1KD070582	KZT	65 300 000 000	
28.09.2017	21.11.2021	ХҚҰ	Еуропалық Қайта құру және Даму Банкі	XS1693027580	KZT	15 000 000 000	
28.09.2017	15.12.2021	ХҚҰ	Еуропалық Қайта құру және Даму Банкі	XS1693029446	KZT	15 000 000 000	
29 09 2017	06.10.2017	Ноттар	ҚР Ұлттық Банкі	KZW1KD070590	KZT	65 600 000 000	
Жиыны						1 397 623 800 400	

7-кесте. Есепті айға шетелдік банктердегі салымдарға орналастырулар бойынша мәліметтер

Мәміле жасалған күн	Өтеу күні	Бағалы қағаз эмитенті	Номинал валютасы	Тенгемен мәміле сомасы	Шетелдік валютада мәміле сомасы
04.09.2017	04.12.2017	Credit Agricole Corporate & Investment Bank	USD	40 586 400 000	120 000 000
07.09.2017	11.12.2017	Bank of Montreal	USD	58 578 840 000	174 000 000
08.09.2017	07.12.2017	Mizuho Bank, LTD	USD	33 763 290 000	101 000 000
14.09.2017	15.12.2017	Natixis Capital Market Paris	USD	32 793 760 000	97 000 000
21.09.2017	21.12.2017	Rabobank Nederland	USD	45 947 250 000	135 000 000
Жиыны				211 669 540 000	627 000 000

8-кесте. Есепті айдағы банк салымдарына орналастыру жөніндегі мәліметтер

ҰСН (ISIN)	Құрал түрі	Бағалы қағаз эмитенті	Нақты өтелген күн	Тенгемен өтелетін сома	Шет. валютадағы өтеуге сома	номинал валют асы
KZW1KD070301	Ноттар	ҚР Ұлттық Банкі	04.09.2017	138 000 000 000		KZT

KZW1KD100280	Ноттар	ҚР Ұлттық Банкі	04.09.2017	17 800 000 000		KZT
US912796LT40	МБҚ дисконт	АҚШ Үкіметі	08.09.2017	38 109 060 000	114 000 000	USD
KZW1KD070327	Ноттар	ҚР Ұлттық Банкі	07.09.2017	141 840 184 100		KZT
KZW1KD070343	Ноттар	ҚР Ұлттық Банкі	11.09.2017	130 000 000 000		KZT
KZW1KD070350	Ноттар	ҚР Ұлттық Банкі	12.09.2017	60 000 000 000		KZT
US912796KL23	МБҚ дисконт	АҚШ Үкіметі	15.09.2017	32 873 300 000	97 000 000	USD
KZW1KD070384	Ноттар	ҚР Ұлттық Банкі	14.09.2017	134 400 000 000		KZT
KZW1KD070392	Ноттар	ҚР Ұлттық Банкі	15.09.2017	15 400 000 000		KZT
KZW1KD070418	Ноттар	ҚР Ұлттық Банкі	18.09.2017	82 875 028 700		KZT
KZW1KD070426	Ноттар	ҚР Ұлттық Банкі	19.09.2017	59 525 471 700		KZT
KZW1KD070459	Ноттар	ҚР Ұлттық Банкі	21.09.2017	116 366 053 900		KZT
US912796LU13	МБҚ дисконт	АҚШ Үкіметі	22.09.2017	44 894 520 000	132 000 000	USD
KZW1KD070467	Ноттар	ҚР Ұлттық Банкі	22.09.2017	4 166 355 500		KZT
KZW1KD070483	Ноттар	ҚР Ұлттық Банкі	25.09.2017	21 000 000 000		KZT
KZW1KD070491	Ноттар	ҚР Ұлттық Банкі	26.09.2017	70 811 049 900		KZT
KZW1KD270331	Ноттар	ҚР Ұлттық Банкі	27.09.2017	100 000 000 000		KZT
KZW1KD070525	Ноттар	ҚР Ұлттық Банкі	28.09.2017	55 692 029 000		KZT
KZW1KD070533	Ноттар	ҚР Ұлттық Банкі	29.09.2017	63 000 000 000		KZT
KZP01Y10C727	Облигациялар	"Қазкоммерцбанк" АҚ	11.09.2017	9 094 600 000		KZT
Жиыны				1 335 847 652 800	343 000 000	

9-кесте. Есепті айдағы шетелдік банктердегі салымдар бойынша негізгі борышты өтеу бойынша мәліметтер

Төлем күні	Жабу күні	Бағалы қағаз эмитенті	Теңгемен өтеуге сомасы	Шетелдік валютада өтеуге сома	Номинал валютасы
05.09.2017	05.09.2017	Credit Agricole Corporate & Investment Bank	40 869 600 000	120 000 000	USD
11.09.2017	11.09.2017	Mizuho Bank, LTD	53 838 400 000	160 000 000	USD
29.09.2017	29.09.2017	Mizuho Bank, LTD	54 590 400 000	160 000 000	USD
Жиыны			149 298 400 000	440 000 000	

пенсионными активами АО «ЕНПФ»

По состоянию на 1 октября 2017 года пенсионные активы (далее – ПА) ЕНПФ, находящиеся в доверительном управлении Национального Банка Республики Казахстан (далее – НБРК), составили 7 544,70 млрд. тенге⁴.

Структура инвестиционного портфеля финансовых инструментов, сформированного за счет пенсионных активов ЕНПФ, представлена в Таблице 1.

Таблица 1. Структура инвестиционного портфеля ПА ЕНПФ, находящихся в доверительном управлении НБРК, в разрезе финансовых инструментов

млрд. тенге

Наименование	Текущая стоимость на 01.01.2017 г.	Доля на 01.01.2017 г.	Текущая стоимость на 01.10.2017 г.	Доля на 01.10.2017 г.	Прирост/снижение с начала года
ГЦБ РК	2 910,82	43,57%	3 264,72	43,27%	12,16%
ГЦБ иностранных государств	365,01	5,46%	830,99	11,01%	127,66%
МФО	86,63	1,30%	110,76	1,47%	27,85%
Корпоративные облигации эмитентов РК	84,03	1,26%	59,31	0,79%	-29,42%
Облигации квазигосударственных организаций РК	900,17	13,48%	852,85	11,30%	-5,26%
Облигации БВУ РК	1 450,20	21,71%	1 265,47	16,77%	-12,74%
Корпоративные облигации иностранных эмитентов	137,92	2,07%	63,97	0,85%	-53,62%
PPN (структурные ноты)	31,64	0,47%	31,72	0,42%	0,25%
Акции и депозитарные расписки эмитентов РК	127,46	1,91%	170,82	2,27%	34,03%
Акции и депозитарные расписки иностранных эмитентов	18,33	0,27%	21,95	0,29%	19,79%
Депозиты	399,91	5,99%	329,17	4,36%	-17,69%
Депозиты в иностранных банках	-	-	479,02	6,35%	-
РЕПО	-	-	1,50	0,02%	-
Денежные средства на инвестиционных счетах (за вычетом обязательств по сделкам с финансовыми инструментами)	151,84	2,27%	26,73	0,36%	-82,39%
Прочие активы (дебиторская задолженность ⁵ , просроченная задолженность, провизии)	16,18	0,24%	35,72	0,47%	120,71%
Итого ПА, находящиеся в управлении НБРК	6 680,14	100,00%	7 544,70	100,00%	12,94%
Деньги на счетах пенсионных взносов и выплат, а также средства для расчетов по сделкам с ФИ	9,52		32,17		
Итого пенсионные активы	6 689,66		7 576,87		12,81%

По состоянию на 01.10.2017 года средневзвешенная доходность к погашению (УТМ) долговых финансовых инструментов, находящихся в инвестиционном портфеле ПА ЕНПФ, составила 7,8% годовых.

Государственные ценные бумаги Республики Казахстан

Основную долю в портфеле ПА ЕНПФ занимают ГЦБ РК, текущая стоимость которых за отчетный месяц увеличилась на 160,41 млрд. тенге и составила 3 264,72 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 43,27%.

⁴ без учета денег на счетах пенсионных взносов и выплат, а также средств для расчетов по сделкам с ФИ.

⁵ дебиторская задолженность включает суммы к получению по вознаграждению и/или основному долгу, по которым наступила дата начала погашения задолженности со стороны эмитента, в соответствии с условиями проспекта выпуска финансового инструмента.

В отчетном периоде были приобретены краткосрочные дисконтные ноты НБРК в объеме 1 367,62 млрд. тенге по номинальной стоимости со средневзвешенной доходностью 9,3% годовых.

В отчетном периоде произошло погашение дисконтных нот НБРК на сумму 1 210,88 млрд. тенге.

Средневзвешенная доходность к погашению ГЦБ РК в портфеле ПА ЕНПФ на отчетную дату составила 8,6% годовых.

Государственные ценные бумаги иностранных государств

Текущая стоимость государственных ценных бумаг иностранных государств за отчетный месяц уменьшилась на 30,09 млрд. тенге и составила 830,99 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 11,01%.

В отчетном периоде в рамках добровольной реструктуризации произведен обмен имевшихся облигаций Международного Банка Азербайджана на государственные ценные бумаги Азербайджанской Республики в соотношении 1 к 1 по номинальной стоимости.

В рассматриваемом периоде произошло погашение государственных ценных бумаг иностранных государств, номинированных в долларах США, на сумму 115,88 млрд. тенге.

Средневзвешенная доходность к погашению ГЦБ иностранных государств в портфеле ПА ЕНПФ на отчетную дату составила 2,3% годовых.

Облигации Международных финансовых организаций

Текущая стоимость облигаций Международных финансовых организаций за отчетный месяц увеличилась на 29,80 млрд. тенге и составила 110,76 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 1,47%.

В отчетном периоде в соответствии с решением Совета по управлению Национальным фондом РК от 14.03.2017г. были приобретены облигации Международной финансовой организации, имеющей кредитный рейтинг по международной шкале на уровне «AAA», на сумму 30,00 млрд. тенге по номинальной стоимости с доходностью на уровне инфляции и премии в размере 0,1% годовых.

В портфеле ПА ЕНПФ продаж и погашений ценных бумаг Международных финансовых организаций не было.

Средневзвешенная доходность к погашению облигаций Международных финансовых организаций в портфеле ПА ЕНПФ на отчетную дату составила 5,2% годовых.

Депозиты в банках второго уровня Республики Казахстан

Текущая стоимость вкладов в БВУ РК, имеющих средневзвешенный срок погашения 5,7 лет, за отчетный месяц уменьшилась на 7,24 млрд. тенге и составила 329,17 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 4,36%.

В отчетном периоде произошло частичное погашения основного долга по вкладам БВУ РК на сумму 4,5 млрд. тенге.

Размещений ПА ЕНПФ во вклады БВУ РК не было.

Средневзвешенная доходность к погашению вкладов БВУ РК на отчетную дату составила 10,7% годовых.

Депозиты в иностранных банках

Текущая стоимость вкладов в иностранных банках, имеющих средневзвешенный срок погашения 1,8 месяца, за отчетный месяц увеличилась на 69,04 млрд. тенге и составила 479,02 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 6,35%.

Средневзвешенная доходность к погашению вкладов в иностранных банках на отчетную дату составила 1,3% годовых.

Корпоративные облигации эмитентов Республики Казахстан

Текущая стоимость корпоративных облигаций эмитентов РК за отчетный месяц увеличилась на 0,55 млрд. тенге и составила 59,31 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 0,79%.

В портфеле ПА ЕНПФ покупок, погашений и продаж корпоративных облигаций эмитентов РК не было.

Средневзвешенная доходность к погашению корпоративных облигаций эмитентов РК в портфеле ПА ЕНПФ на отчетную дату составила 11,4% годовых.

Облигации квазигосударственных организаций Республики Казахстан

Текущая стоимость облигаций квазигосударственных организаций РК за отчетный месяц уменьшилась на 18,00 млрд. тенге и составила 852,85 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 11,30%.

В отчетном периоде в портфеле ПА ЕНПФ продаж, покупок и погашений облигаций квазигосударственных организаций РК не было.

Средневзвешенная доходность к погашению облигаций квазигосударственных организаций РК в портфеле ПА ЕНПФ на отчетную дату составила 9,7% годовых.

Облигации банков второго уровня Республики Казахстан

Текущая стоимость облигаций БВУ РК за отчетный месяц уменьшилась на 1,05 млрд. тенге и составила 1 265,47 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 16,77%.

В отчетном периоде в портфеле ПА ЕНПФ произошло погашение основного долга по облигациям БВУ РК, номинированным в тенге, на сумму 9,09 млрд. тенге.

В рассматриваемом периоде в портфеле ПА ЕНПФ продаж и покупок облигаций БВУ РК не было.

Средневзвешенная доходность к погашению облигаций БВУ РК в портфеле ПА ЕНПФ на отчетную дату составила 9,9% годовых.

Корпоративные облигации иностранных эмитентов

Текущая стоимость корпоративных облигаций иностранных эмитентов за отчетный месяц уменьшилась на 70,39 млрд. тенге и составила 63,97 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 0,85%.

В отчетном периоде в рамках добровольной реструктуризации произведен обмен имевшихся облигаций Международного Банка Азербайджана на государственные ценные бумаги Азербайджанской Республики в соотношении 1 к 1 по номинальной стоимости.

В отчетном периоде в портфеле ПА ЕНПФ покупок, продаж и погашений корпоративных облигаций иностранных эмитентов не было.

Средневзвешенная доходность к погашению корпоративных облигаций иностранных эмитентов в портфеле ПА ЕНПФ на отчетную дату составила 5,8% годовых.

PPN (структурные ноты) иностранных эмитентов

Текущая стоимость PPN (структурных нот) иностранных эмитентов за отчетный месяц увеличилась на 0,49 млрд. тенге и составила 31,72 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 0,42%.

В отчетном периоде в портфеле ПА ЕНПФ покупок, продаж и погашений PPN (структурных нот) иностранных эмитентов не было.

Акции и депозитарные расписки эмитентов Республики Казахстан

Текущая стоимость акций и депозитарных расписок эмитентов РК за отчетный месяц уменьшилась на 1,43 млрд. тенге и составила 170,82 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 2,27%.

В отчетном периоде в портфеле ПА ЕНПФ покупок, а также продаж акций и депозитарных расписок эмитентов РК не было.

Акции и депозитарные расписки иностранных эмитентов

Текущая стоимость акций и депозитарных расписок иностранных эмитентов за отчетный месяц увеличилась на 0,66 млрд. тенге и составила 21,95 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 0,29%.

В отчетном периоде продаж, а также покупок акций и депозитарных расписок иностранных эмитентов не было.

Инвестиционный портфель финансовых инструментов в разрезе валют, в которых номинированы финансовые инструменты, приобретенные за счет пенсионных активов ЕНПФ, представлен в Таблице 2.

Таблица 2. Структура инвестиционного портфеля ПА ЕНПФ, находящихся в доверительном управлении НБРК, в разрезе валют

Валюта	<i>млрд. тенге</i>				
	Текущая стоимость на 01.01.2017 г.	Доля на 01.01.2017 г.	Текущая стоимость на 01.10.2017 г.	Доля на 01.10.2017 г.	Прирост/снижение с начала года
Национальная валюта	5 142,38	76,98%	5 292,64	71,20%	2,92%
Доллары США	1 492,44	22,34%	2 096,74	28,20%	40,49%
Российские рубли	35,12	0,53%	36,24	0,49%	3,21%
Другие валюты	10,20	0,15%	8,04	0,11%	-21,16%
Итого:	6 680,14	100,00%	7 433,66	100,00%	11,28%

Результаты инвестиционной деятельности

В результате инвестиционной деятельности, а также вследствие волатильности курсов иностранных валют и изменения рыночной стоимости финансовых инструментов, размер начисленного инвестиционного дохода за 9 месяцев 2017 года составил 494,5 млрд. тенге. Таким образом, доходность пенсионных активов ЕНПФ, распределенная на счета вкладчиков (получателей) за период с 1 января по 30 сентября 2017 года, составила 6,68%, что в годовом выражении составляет 8,91% годовых.

Структура начисленного инвестиционного дохода за указанный период представлена в Таблице 3.

Таблица 3. Структура инвестиционного дохода, полученного по ПА ЕНПФ, находящимся в доверительном управлении НБРК

Наименование	<i>млрд. тенге</i>
	Инвестиционный доход с начала 2017 года
Доходы в виде вознаграждения по ценным бумагам, в том числе по размещенным вкладам и операциям «обратное РЕПО»	380,65
Доходы (убытки) от рыночной переоценки ценных бумаг	30,44
Доходы (убытки) от переоценки иностранной валюты	79,27
Прочие доходы (убытки)	4,11
Итого:	494,47

Информация о соблюдении параметров инвестиционной декларации

Структурное распределение ПА ЕНПФ, находящихся в доверительном управлении, соответствует требованиям Инвестиционной декларации ЕНПФ⁶. Доли валютных позиций остаются в рамках допустимого уровня и не нарушают требований Инвестиционной декларации ЕНПФ. Сведения о соблюдении лимитов инвестирования по ПА ЕНПФ по состоянию на 01.10.2017г. представлены в Таблице 4.

⁶ Инвестиционная декларация ЕНПФ утверждена постановлением Правления Национального Банка Республики Казахстан от 17 марта 2016 года №86

Таблица 4. Лимиты инвестирования по ПА ЕНПФ

№	Вид финансового инструмента	Фактическое значение (в процентах от ПА)	Выполнение (да/нет)
1	Зарубежные эмитенты:	20,39%	да
1.1	Государственные, агентские и ценные бумаги международных финансовых организаций (МФО):	12,48%	да
1)	с рейтингом не ниже «BBB-» по международной шкале агентства «Standard & Poor's» или рейтингом аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств	9,30%	да
2)	с рейтингом от «BB+» до «BB-» по международной шкале агентства «Standard & Poor's» или рейтингом аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств	3,19%	да
1.2	Корпоративные долговые ценные бумаги:	0,85%	да
1)	с рейтинговой оценкой ценной бумаги и/или эмитента не ниже «BBB-» по международной шкале агентства «Standard & Poor's» или рейтинговой оценкой аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств	0,09%	да
2)	с рейтинговой оценкой ценной бумаги и/или эмитента от «BB+» до «BB-» по международной шкале агентства «Standard & Poor's» или рейтинговой оценкой аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств	0,76%	да
1.3	Ценные бумаги под залог недвижимости (MBS) и активов (ABS) с рейтинговой оценкой ценной бумаги и/или эмитента не ниже «BBB-» по международной шкале агентства «Standard & Poor's» или рейтинговой оценкой аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств	0,00%	да
1.4	Акции, депозитарные расписки на акции	0,29%	да
1.5	Депозиты (вклады) в иностранных банках, имеющих рейтинговую оценку не ниже «A-» по международной шкале агентства «Standard & Poor's» или рейтинговую оценку аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств	6,35%	да
1.6	Структурные продукты, выпущенные организациями, имеющими рейтинговую оценку не ниже «BBB-» по международной шкале агентства «Standard & Poor's» или рейтинговую оценку аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств	0,42%	да
1.7	Инструменты исламского финансирования:	0,00%	да
1)	с рейтинговой оценкой ценной бумаги и/или эмитента не ниже «BBB-» по международной шкале агентства «Standard & Poor's» или рейтинговой оценкой аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств	0,00%	да
2)	с рейтинговой оценкой ценной бумаги и/или эмитента от «BB+» до «BB-» по международной шкале агентства «Standard & Poor's» или рейтинговой оценкой аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств	0,00%	да
2	Казахстанские эмитенты:	78,01%	да
2.1	Государственные ценные бумаги Республики Казахстан, выпущенные Министерством финансов Республики Казахстан, Национальным Банком Республики Казахстан	43,27%	да
2.1-1	Государственные ценные бумаги Республики Казахстан, выпущенные местными исполнительными органами Республики Казахстан	0,00%	да
2.1-2	Депозиты Национального Банка Республики Казахстан	0,00%	да
2.2	Ценные бумаги субъектов квазигосударственного сектора	12,29%	да
2.3	Финансовые инструменты банков второго уровня Республики Казахстан	22,10%	да
2.4	Негосударственные долговые ценные бумаги, за исключением долговых ценных бумаг субъектов квазигосударственного сектора и банков второго уровня Республики Казахстан, имеющими рейтинговую оценку ценной бумаги и/или эмитента не ниже «B-» по международной шкале агентства «Standard & Poor's» или рейтинговой оценкой аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств	0,08%	да
2.4-1	Негосударственные долговые ценные бумаги, выпущенные под гарантию и/или поручительство Правительства Республики Казахстан	0,00%	да
2.5	Негосударственные долевые ценные бумаги, за исключением долевых ценных бумаг субъектов квазигосударственного сектора и банков второго уровня Республики Казахстан, входящие в первую категорию официального списка Казахстанской фондовой биржи	0,27%	да
2.6	Инструменты исламского финансирования, включенные в официальный список Казахстанской фондовой биржи	0,00%	да

Таблица 5. Лимиты инвестирования по ПА ЕНПФ в отдельные виды финансовых инструментов

№	Вид финансового инструмента	Фактическое значение (в процентах от ПА)	Выполнение (да/нет)
1	Стандартные производные финансовые инструменты	0,00%	да
1)	в случае если производные финансовые инструменты используются для хеджирования инвестиционного риска	0,00%	да
2	Золото в слитках и на металлических счетах	0,00%	да

Информация по покупкам, продажам и погашениям финансовых инструментов, находящихся в инвестиционном портфеле ПА ЕНПФ

Таблица 6. Сведения по приобретению финансовых инструментов в отчетном месяце

Дата сделки	Дата погашения	Вид инструмента	Эмитент ценной бумаги	НИИ (ISIN)	Валюта номинала	Номинальная стоимость в тенге	Номинальная стоимость в ин. валюте
04.09.2017	11.09.2017	Ноты	Национальный Банк РК	KZW1KD070343	KZT	130 000 000 000	
05.09.2017	12.09.2017	Ноты	Национальный Банк РК	KZW1KD070350	KZT	60 000 000 000	
06.09.2017	04.10.2017	Ноты	Национальный Банк РК	KZW1KD280371	KZT	48 700 000 000	
07.09.2017	14.09.2017	Ноты	Национальный Банк РК	KZW1KD070384	KZT	134 400 000 000	
08.09.2017	15.09.2017	Ноты	Национальный Банк РК	KZW1KD070392	KZT	15 400 000 000	
11.09.2017	18.09.2017	Ноты	Национальный Банк РК	KZW1KD070418	KZT	82 875 028 700	
12.09.2017	19.09.2017	Ноты	Национальный Банк РК	KZW1KD070426	KZT	59 525 471 700	
13.09.2017	11.10.2017	Ноты	Национальный Банк РК	KZW1KD280447	KZT	60 300 000 000	
14.09.2017	21.09.2017	Ноты	Национальный Банк РК	KZW1KD070459	KZT	116 366 053 900	
15.09.2017	22.09.2017	Ноты	Национальный Банк РК	KZW1KD070467	KZT	4 166 355 500	
18.09.2017	25.09.2017	Ноты	Национальный Банк РК	KZW1KD070483	KZT	21 000 000 000	
19.09.2017	26.09.2017	Ноты	Национальный Банк РК	KZW1KD070491	KZT	70 811 049 900	
20.09.2017	18.10.2017	Ноты	Национальный Банк РК	KZW1KD280512	KZT	63 745 408 300	
21.09.2017	28.09.2017	Ноты	Национальный Банк РК	KZW1KD070525	KZT	55 692 029 000	
22.09.2017	29.09.2017	Ноты	Национальный Банк РК	KZW1KD070533	KZT	63 000 000 000	
25.09.2017	02.10.2017	Ноты	Национальный Банк РК	KZW1KD070541	KZT	60 475 226 900	
26.09.2017	03.10.2017	Ноты	Национальный Банк РК	KZW1KD070558	KZT	76 451 083 100	
27.09.2017	25.10.2017	Ноты	Национальный Банк РК	KZW1KD280579	KZT	113 816 093 400	
28.09.2017	05.10.2017	Ноты	Национальный Банк РК	KZW1KD070582	KZT	65 300 000 000	
28.09.2017	21.11.2021	МФО	Европейский Банк Реконструкции и Развития	XS1693027580	KZT	15 000 000 000	
28.09.2017	15.12.2021	МФО	Европейский Банк Реконструкции и Развития	XS1693029446	KZT	15 000 000 000	
29.09.2017	06.10.2017	Ноты	Национальный Банк РК	KZW1KD070590	KZT	65 600 000 000	
Итого						1 397 623 800 400	

Таблица 7. Сведения по размещениям во вклады иностранных банков в отчетном месяце

Дата сделки	Дата погашения	Эмитент ценной бумаги	Валюта номинала	Сумма сделки в тенге	Сумма сделки в ин. валюте
04.09.2017	04.12.2017	Credit Agricole Corporate & Investment Bank	USD	40 586 400 000	120 000 000
07.09.2017	11.12.2017	Bank of Montreal	USD	58 578 840 000	174 000 000
08.09.2017	07.12.2017	Mizuho Bank, LTD	USD	33 763 290 000	101 000 000
14.09.2017	15.12.2017	Natixis Capital Market Paris	USD	32 793 760 000	97 000 000
21.09.2017	21.12.2017	Rabobank Nederland	USD	45 947 250 000	135 000 000
Итого				211 669 540 000	627 000 000

Таблица 8. Сведения по погашениям основного долга по ценным бумагам в отчетном месяце

НИИ (ISIN)	Вид инструмента	Эмитент ценной бумаги	Дата фактического погашения	Сумма к погашению в тенге	Сумма к погашению в ин. валюте	Валюта номинала
KZW1KD070301	Ноты	Национальный Банк РК	04.09.2017	138 000 000 000		KZT
KZW1KD100280	Ноты	Национальный Банк РК	04.09.2017	17 800 000 000		KZT
US912796LT40	ГЦБ дисконт	Правительство США	08.09.2017	38 109 060 000	114 000 000	USD
KZW1KD070327	Ноты	Национальный Банк РК	07.09.2017	141 840 184 100		KZT
KZW1KD070343	Ноты	Национальный Банк РК	11.09.2017	130 000 000 000		KZT
KZW1KD070350	Ноты	Национальный Банк РК	12.09.2017	60 000 000 000		KZT
US912796KL23	ГЦБ дисконт	Правительство США	15.09.2017	32 873 300 000	97 000 000	USD
KZW1KD070384	Ноты	Национальный Банк РК	14.09.2017	134 400 000 000		KZT
KZW1KD070392	Ноты	Национальный Банк РК	15.09.2017	15 400 000 000		KZT
KZW1KD070418	Ноты	Национальный Банк РК	18.09.2017	82 875 028 700		KZT
KZW1KD070426	Ноты	Национальный Банк РК	19.09.2017	59 525 471 700		KZT
KZW1KD070459	Ноты	Национальный Банк РК	21.09.2017	116 366 053 900		KZT
US912796LU13	ГЦБ дисконт	Правительство США	22.09.2017	44 894 520 000	132 000 000	USD
KZW1KD070467	Ноты	Национальный Банк РК	22.09.2017	4 166 355 500		KZT
KZW1KD070483	Ноты	Национальный Банк РК	25.09.2017	21 000 000 000		KZT
KZW1KD070491	Ноты	Национальный Банк РК	26.09.2017	70 811 049 900		KZT
KZW1KD270331	Ноты	Национальный Банк РК	27.09.2017	100 000 000 000		KZT
KZW1KD070525	Ноты	Национальный Банк РК	28.09.2017	55 692 029 000		KZT

KZW1KD070533	Ноты	Национальный Банк РК	29.09.2017	63 000 000 000		KZT
KZP01Y10C727	Облигации	АО "Казкоммерцбанк"	11.09.2017	9 094 600 000		KZT
Итого				1 335 847 652 800	343 000 000	

Таблица 9. Сведения по погашениям основного долга по вкладам в иностранных банках в отчетном месяце

Дата выплаты	Дата закрытия	Эмитент ценной бумаги	Сумма к погашению в тенге	Сумма к погашению в ин. валюте	Валюта номинала
05.09.2017	05.09.2017	Credit Agricole Corporate & Investment Bank	40 869 600 000	120 000 000	USD
11.09.2017	11.09.2017	Mizuho Bank, LTD	53 838 400 000	160 000 000	USD
29.09.2017	29.09.2017	Mizuho Bank, LTD	54 590 400 000	160 000 000	USD
Итого			149 298 400 000	440 000 000	