

## Информация по инвестиционному управлению пенсионными активами АО «ЕНПФ»

По состоянию на 1 мая 2019 года пенсионные активы (далее – ПА) ЕНПФ, находящиеся в доверительном управлении Национального Банка Республики Казахстан (далее – НБРК), составили 9 761,91 млрд. тенге<sup>1</sup>.

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**

| <i>млрд. тенге</i>  |                                    |                       |                                    |                       |                                |
|---|------------------------------------|-----------------------|------------------------------------|-----------------------|--------------------------------|
| Наименование  | Текущая стоимость на 01.01.2019 г. | Доля на 01.01.2019 г. | Текущая стоимость на 01.05.2019 г. | Доля на 01.05.2019 г. | Прирост/снижение с начала года |
| ГЦБ РК  | 4 057,98                           | 43,27%                | 4 150,35                           | 42,52%                | 2,28%                          |
| ГЦБ иностранных государств  | 1 191,92                           | 12,71%                | 1 489,75                           | 15,26%                | 24,99%                         |
| МФО   | 170,96                             | 1,82%                 | 240,95                             | 2,47%                 | 40,94%                         |
| Корпоративные облигации эмитентов РК  | 42,06                              | 0,45%                 | 30,96                              | 0,32%                 | -26,39%                        |
| Облигации квазигосударственных организаций РК   | 1 299,90                           | 13,86%                | 1 303,75                           | 13,36%                | 0,30%                          |
| Облигации БВУ РК  | 1 264,78                           | 13,49%                | 1 282,18                           | 13,13%                | 1,38%                          |
| Корпоративные облигации иностранных эмитентов   | 8,85                               | 0,09%                 | 9,17                               | 0,09%                 | 3,59%                          |
| Облигации иностранных эмитентов квазигосударственного сектора                                 | 232,92                             | 2,48%                 | 231,41                             | 2,37%                 | -0,65%                         |
| PPN (структурные ноты)  | 33,95                              | 0,36%                 | 34,37                              | 0,35%                 | 1,25%                          |
| Акции и депозитарные расписки эмитентов РК  | 224,40                             | 2,39%                 | 237,90                             | 2,44%                 | 6,02%                          |
| Акции и депозитарные расписки иностранных эмитентов   | 20,42                              | 0,22%                 | 24,21                              | 0,25%                 | 18,54%                         |
| Депозиты  | 277,65                             | 2,96%                 | 264,90                             | 2,71%                 | -4,59%                         |
| Депозиты НБРК   | 154,07                             | 1,64%                 | 185,00                             | 1,90%                 | 20,07%                         |
| Депозиты в иностранных банках   | 343,16                             | 3,66%                 | 224,12                             | 2,30%                 | -34,69%                        |
| Денежные средства на инвестиционных счетах  | 126,69                             | 1,35%                 | 43,47                              | 0,45%                 |                                |
| Прочие активы (дебиторская задолженность <sup>2</sup> , просроченная задолженность, провизии) | 15,23                              | 0,16%                 | 20,61                              | 0,21%                 |                                |
| Активы, находящиеся во внешнем управлении у Aviva Investors Global Services Limited*          | 82,80                              | 0,88%                 | 88,17                              | 0,90%                 | 6,49%                          |
| <b>Итого ПА, находящиеся в управлении НБРК</b>  | <b>9 378,03**</b>                  | <b>100,00%</b>        | <b>9 761,91***</b>                 | <b>100,00%</b>        | <b>4,09%</b>                   |
| Обязательства к оплате по совершенным сделкам   | 169,71                             |                       | 99,36                              |                       |                                |
| Деньги на счетах пенсионных взносов и выплат  | 7,12                               |                       | 2,47                               |                       |                                |
| <b>Итого пенсионные активы</b>  | <b>9 554,86</b>                    |                       | <b>9 863,74</b>                    |                       | <b>3,23%</b>                   |

\* - в рамках мандата «Глобальные облигации развивающихся рынков»

\*\* - с учетом обязательств к оплате по совершенным сделкам на сумму 169,71 млрд. тенге

\*\*\* - с учетом обязательств к оплате по совершенным сделкам на сумму 99,36 млрд. тенге

По состоянию на 01.05.2019г. средневзвешенная доходность к погашению (YTM) долговых финансовых инструментов, находящихся в инвестиционном портфеле ПА ЕНПФ, составила 7,0% годовых, в том числе по номинированным в тенге – 8,4% годовых, в иностранной валюте – 3,9% годовых.

<sup>1</sup> без учета денег на счетах пенсионных взносов и выплат.

<sup>2</sup> 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, а также денежные средства к получению от продажи ФИ

### **Государственные ценные бумаги Республики Казахстан**

Основную долю в портфеле ПА ЕНПФ занимают ГЦБ РК, текущая стоимость которых за отчетный месяц увеличилась на 230,00 млрд. тенге и составила 4 150,35 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 42,52%.

В отчетном периоде были приобретены следующие финансовые инструменты:

- краткосрочные дисконтные ноты НБРК в объеме 476,42 млрд. тенге со средневзвешенной доходностью 8,73% годовых;
- ГЦБ Министерства финансов РК, номинированные в тенге, в объеме 46,00 млрд. тенге со средневзвешенной доходностью 8,69% годовых.

В рассматриваемом периоде произошло погашение ГЦБ Министерства финансов РК и дисконтных нот НБРК на общую сумму 275,67 млрд. тенге.

На отчетную дату средневзвешенная доходность к погашению по ГЦБ РК, номинированным в тенге, составила 7,3% годовых, в долларах США – 4,4% годовых.

### **Государственные ценные бумаги иностранных государств**

Текущая стоимость государственных ценных бумаг иностранных государств за отчетный месяц уменьшилась на 16,26 млрд. тенге и составила 1 489,75 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 15,26%.

В отчетном периоде были приобретены краткосрочные ГЦБ США в объеме 168,71 млрд. тенге по номинальной стоимости с доходностью 2,43% годовых.

В рассматриваемом периоде были реализованы и погашены ГЦБ США на общую сумму 132,64 млрд. тенге, а также осуществлена продажа всей оставшейся части государственных ценных бумаг Правительства Республики Азербайджан на сумму 54,36 млрд. тенге (143,46 млн. долларов США).

Средневзвешенная доходность к погашению ГЦБ иностранных государств в портфеле ПА ЕНПФ на отчетную дату составила 3,4% годовых.

### **Облигации Международных финансовых организаций**

Текущая стоимость облигаций международных финансовых организаций за отчетный месяц увеличилась на 30,78 млрд. тенге и составила 240,95 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 2,47%.

В отчетном периоде были приобретены индексированные облигации Европейского Банка Реконструкции и Развития в объеме 30,00 млрд. тенге по номинальной стоимости с доходностью, равной инфляции и премии в размере 1,00% годовых.

Продаж и погашений ценных бумаг международных финансовых организаций не было.

Средневзвешенная доходность к погашению по облигациям международных финансовых организаций, номинированным в тенге, составила 5,9% годовых, в долларах США – 5,0% годовых.

### **Депозиты в банках второго уровня Республики Казахстан**

Текущая стоимость вкладов в БВУ РК, имеющих средневзвешенный срок погашения 5,08 лет, за отчетный месяц уменьшилась на 1,25 млрд. тенге и составила 264,90 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 2,71%.

В отчетном периоде произошло частичное досрочное погашение вкладов БВУ РК на сумму 1,62 млрд. тенге. Размещений во вклады БВУ РК не было.

Средневзвешенная доходность к погашению вкладов БВУ РК на отчетную дату составила 9,4% годовых.

### **Депозиты в иностранных банках**

Текущая стоимость вкладов в иностранных банках, имеющих средневзвешенный срок погашения 2 месяца, за отчетный месяц увеличилась на 6,89 млрд. тенге и составила 224,12 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 2,30%.

В отчетном месяце в иностранных банках были размещены вклады, номинированные в долларах США, на общую сумму 213,00 млрд. тенге со средневзвешенной доходностью 2,65% годовых.

В отчетном периоде произошло погашение вклада на сумму 205,81 млрд. тенге.

Средневзвешенная доходность к погашению вкладов в иностранных банках на отчетную дату составила 2,9% годовых.

#### **Депозиты в Национальном Банке РК**

Текущая стоимость депозитов в Национальном Банке РК составила 185,00 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 1,90%.

В отчетном месяце в рамках управления текущей ликвидностью с целью поддержания доходности по пенсионным активам осуществлено инвестирование в однодневные депозиты Национального Банка РК на общую сумму 5 806,00 млрд. тенге со средневзвешенной доходностью 8,14% годовых. В отчетном периоде произошло погашение депозитов на общую сумму 5 886,0 млрд. тенге.

Средневзвешенная доходность к погашению вкладов в Национальном Банке РК на отчетную дату составила 8,00% годовых.

#### **Корпоративные облигации эмитентов Республики Казахстан**

Текущая стоимость корпоративных облигаций эмитентов РК за отчетный месяц увеличились на 0,18 млрд. тенге и составила 30,96 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 0,32%.

В отчетном периоде покупок, продаж и погашений корпоративных облигаций эмитентов РК не было.

Средневзвешенная доходность к погашению корпоративных облигаций эмитентов РК в портфеле ПА ЕНПФ на отчетную дату составила 8,0% годовых.

#### **Облигации квазигосударственных организаций Республики Казахстан**

Текущая стоимость облигаций квазигосударственных организаций РК за отчетный месяц увеличилась на 0,66 млрд. тенге и составила 1 303,75 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 13,36%.

В рассматриваемом периоде произошло погашение облигаций АО «КазМунайГаз» на сумму 3,86 млрд. тенге.

Покупок и продаж облигаций квазигосударственных организаций РК не было.

На отчетную дату средневзвешенная доходность к погашению по облигациям квазигосударственных организаций РК, номинированным в тенге, составила 10,3% годовых, в долларах США – 5,0% годовых.

#### **Облигации банков второго уровня Республики Казахстан**

Текущая стоимость облигаций БВУ РК за отчетный месяц уменьшилась на 13,31 млрд. тенге и составила 1 282,18 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 13,13%.

В рассматриваемом периоде произошло погашение облигаций АО «Народный Банк Казахстана» и АО «Цеснабанк» на сумму 5,48 млрд. тенге, а также облигаций АО «БанкЦентрКредит» на сумму 14,98 млрд. тенге (выплата ожидается в период с 26.04.2019г. по 15.05.2019г.). Продаж и покупок облигаций БВУ РК не было.

На отчетную дату средневзвешенная доходность к погашению по облигациям БВУ РК, номинированным в тенге, составила 10,0% годовых, в долларах США – 6,5% годовых.

#### **Корпоративные облигации иностранных эмитентов**

Текущая стоимость корпоративных облигаций иностранных эмитентов за отчетный месяц увеличилась на 0,06 млрд. тенге и составила 9,17 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 0,09%.

В отчетном периоде 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 7,8% годовых.

#### **Облигации иностранных эмитентов квазигосударственного сектора**

Текущая стоимость облигаций иностранных эмитентов квазигосударственного сектора за отчетный месяц увеличилась на 0,80 млрд. тенге и составила 231,41 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 2,37%.

В отчетном периоде покупок, продаж и погашений облигаций иностранных эмитентов квазигосударственного сектора не было.

Средневзвешенная доходность к погашению облигаций иностранных эмитентов квазигосударственного сектора в портфеле ПА ЕНПФ на отчетную дату составила 4,6% годовых.

#### **PPN (структурные ноты) иностранных эмитентов**

Текущая стоимость PPN (структурных нот) иностранных эмитентов за отчетный месяц увеличилась на 0,21 млрд. тенге и составила 34,37 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 0,35%.

Продаж, погашений и покупок 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 увеличилась на 9,46 млрд. тенге и составила 237,90 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 2,44%.

В отчетном периоде покупок и 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 0,56 млрд. тенге и составила 24,21 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 0,25%.

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

#### **Валютная структура**

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 01.01.2019г. | Доля на 01.01.2019г. | Текущая стоимость на 01.05.2019г. | Доля на 01.05.2019г. | Прирост/снижение с начала года |
| Национальная валюта | 6 304,73                          | 67,23%               | 6 613,15                          | 67,74%               | 4,89%                          |
| Доллары США         | 3 035,86                          | 32,37%               | 3 107,63                          | 31,83%               | 2,36%                          |
| Российские рубли    | 30,28                             | 0,32%                | 32,96                             | 0,34%                | 8,84%                          |
| Другие валюты       | 7,16                              | 0,08%                | 8,17                              | 0,08%                | 14,10%                         |
| <b>Итого:</b>       | <b>9 378,03</b>                   | <b>100,00%</b>       | <b>9 761,91</b>                   | <b>100,00%</b>       | <b>4,09%</b>                   |

### **Результаты инвестиционной деятельности**

В результате инвестиционной деятельности, а также вследствие волатильности курсов иностранных валют и изменения рыночной стоимости финансовых инструментов, размер начисленного инвестиционного дохода с начала 2019 года составил 172,39 млрд. тенге. Доходность пенсионных активов ЕНПФ, распределенная на счета вкладчиков (получателей) с начала 2019 года, составила 1,62%.

При этом по состоянию на 1 мая 2019 года доходность пенсионных активов за последние 12 месяцев (с мая 2018 года по апрель 2019 года) для вкладчиков (получателей) ЕНПФ составила 10,70% при инфляции в размере 4,90%. Таким образом, за последние 12 месяцев реальная доходность по пенсионным активам ЕНПФ составила 5,80%.

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**

| <i>млрд. тенге</i>   |                                  |
|--|----------------------------------|
| Наименование   | Инвестиционный доход за 2019 год |
| Доходы в виде вознаграждения по ценным бумагам, в том числе по размещенным вкладам и операциям «обратное РЕПО» | 214,31                           |
| Доходы (убытки) от рыночной переоценки ценных бумаг  | -29,51                           |
| Доходы (убытки) от переоценки иностранной валюты   | -20,82                           |
| Доходы (убытки) от внешнего управления   | 5,38                             |
| Прочие доходы (убытки)   | 3,03                             |
| <b>Итого:</b>  | <b>172,39</b>                    |

### **Информация о соблюдении параметров инвестиционной декларации**

Структурное распределение ПА ЕНПФ, находящихся в доверительном управлении, соответствует требованиям Инвестиционной декларации ЕНПФ<sup>3</sup>. 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 01.05.2019г. представлены в Таблице 4.

**Таблица 4. Лимиты инвестирования по ПА ЕНПФ**

| №        | Вид финансового инструмента   | Фактическое значение<br>(в процентах от ПА) | Выполнение<br>(да/нет) |
|----------|---|---|------------------------|
| <b>1</b> | <b>Зарубежные эмитенты:</b>   | <b>23,99%</b>                               | <b>да</b>              |
| 1.1      | Государственные, агентские и ценные бумаги международных финансовых организаций (МФО):  | 18,58%                                      | да                     |
| 1)       | с рейтингом не ниже «BBB-» по международной шкале агентства «Standard & Poor's» или рейтингом аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств   | 18,08%                                      | да                     |
| 2)       | с рейтингом от «BB+» до «BB-» по международной шкале агентства «Standard & Poor's» или рейтингом аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств  | 0,50%                                       | да                     |
| 1.2      | Корпоративные долговые ценные бумаги:   | 2,51%                                       | 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                      | 2,40%                                       | 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                   | 0,11%                                       | 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 | 0,00%                                       | да                     |

<sup>3</sup> Инвестиционная декларация ЕНПФ утверждена постановлением Правления Национального Банка Республики Казахстан от 17 марта 2016 года №86

|          |   |               |           |
|----------|---|---------------|-----------|
|          | одного из других рейтинговых агентств   |               |           |
| 1.4      | Акции, депозитарные расписки на акции   | 0,25%         | да        |
| 1.5      | Депозиты (вклады) в иностранных банках, имеющих рейтинговую оценку не ниже «А-» по международной шкале агентства «Standard & Poor's» или рейтинговую оценку аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств   | 2,30%         | 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  | 0,35%         | 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        |
| <b>2</b> | <b>Казахстанские эмитенты:</b>  | <b>76,11%</b> | <b>да</b> |
| 2.1      | Государственные ценные бумаги Республики Казахстан, выпущенные Министерством финансов Республики Казахстан, Национальным Банком Республики Казахстан  | 42,52%        | 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   | 1,90%         | да        |
| 2.2      | Ценные бумаги субъектов квазигосударственного сектора   | 14,49%        | да        |
| 2.3      | Финансовые инструменты банков второго уровня Республики Казахстан   | 16,85%        | 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 | 0,09%         | 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                     | ISIN         | Номинальная стоимость в тенге |
|-------------|----------------|-----------------|---|--------------|-------------------------------|
| 01.04.2019  | 02.05.2019     | ГЦБ РК          | Национальный Банк РК                      | KZW100011037 | 100 000 000 000               |
| 03.04.2019  | 08.08.2019     | ГЦБ США         | Правительство США                         | US912796SC42 | 56 874 000 000                |
| 04.04.2019  | 15.08.2019     | ГЦБ США         | Правительство США                         | US912796QV41 | 56 743 500 000                |
| 08.04.2019  | 08.05.2019     | ГЦБ РК          | Национальный Банк РК                      | KZW100011052 | 11 492 857 900                |
| 08.04.2019  | 10.05.2031     | ГЦБ РК          | Правительство РК                          | KZKD00000964 | 10 000 000 000                |
| 08.04.2019  | 08.05.2019     | ГЦБ РК          | Национальный Банк РК                      | KZW100011052 | 79 900 000 000                |
| 15.04.2019  | 15.05.2019     | ГЦБ РК          | Национальный Банк РК                      | KZW100011078 | 93 981 174 500                |
| 16.04.2019  | 05.09.2019     | ГЦБ США         | Правительство США                         | US912796SG55 | 55 094 200 000                |
| 22.04.2019  | 22.05.2019     | ГЦБ РК          | Национальный Банк РК                      | KZW100011086 | 91 041 644 600                |
| 22.04.2019  | 11.02.2037     | ГЦБ РК          | Правительство РК                          | KZKD00001079 | 16 000 000 000                |
| 23.04.2019  | 25.04.2024     | Еврооблигация   | Европейский Банк Реконструкции и Развития | XS1982112069 | 30 000 000 000                |

|              |            |        |                      |              |                        |
|--------------|------------|--------|----------------------|--------------|------------------------|
| 29.04.2019   | 29.05.2019 | ГЦБ РК | Национальный Банк РК | KZW100011102 | 100 000 000 000        |
| 29.04.2019   | 29.01.2035 | ГЦБ РК | Правительство РК     | KZKD00000832 | 20 000 000 000         |
| <b>Итого</b> |            |        |                      |              | <b>721 127 377 000</b> |

**Таблица 7. Сведения по продаже финансовых инструментов в отчетном месяце**

| Дата сделки  | Дата погашения | Вид инструмента  | Эмитент ценной бумаги                | ISIN         | Сумма сделки в тенге  |
|--------------|----------------|------------------|--------------------------------------|--------------|-----------------------|
| 08.04.2019   | 01.09.2032     | ГЦБ Азербайджана | Правительство Республики Азербайджан | XS1678623734 | 18 309 705 912        |
| 09.04.2019   | 01.09.2032     | ГЦБ Азербайджана | Правительство Республики Азербайджан | XS1678623734 | 9 959 308 991         |
| 10.04.2019   | 01.09.2032     | ГЦБ Азербайджана | Правительство Республики Азербайджан | XS1678623734 | 8 348 001 274         |
| 11.04.2019   | 01.09.2032     | ГЦБ Азербайджана | Правительство Республики Азербайджан | XS1678623734 | 1 667 744 467         |
| 15.04.2019   | 01.09.2032     | ГЦБ Азербайджана | Правительство Республики Азербайджан | XS1678623734 | 1 665 337 711         |
| 16.04.2019   | 01.09.2032     | ГЦБ Азербайджана | Правительство Республики Азербайджан | XS1678623734 | 9 993 299 655         |
| 17.04.2019   | 01.09.2032     | ГЦБ Азербайджана | Правительство Республики Азербайджан | XS1678623734 | 4 415 809 345         |
| 30.04.2019   | 16.05.2019     | ГЦБ США          | Правительство США                    | US912796RQ47 | 38 067 385 340        |
| <b>Итого</b> |                |                  |                                      |              | <b>92 426 592 695</b> |

**Таблица 8. Сведения по размещениям во вклады в отчетном месяце**

| Дата сделки  | Дата погашения | Наименование банка       | Сумма сделки в тенге     |
|--------------|----------------|--------------------------|--------------------------|
| 01.04.2019   | 02.04.2019     | Национальный Банк РК     | 266 000 000 000          |
| 02.04.2019   | 03.04.2019     | Национальный Банк РК     | 271 000 000 000          |
| 03.04.2019   | 04.04.2019     | Национальный Банк РК     | 313 000 000 000          |
| 04.04.2019   | 05.04.2019     | Национальный Банк РК     | 315 000 000 000          |
| 05.04.2019   | 08.04.2019     | Национальный Банк РК     | 322 000 000 000          |
| 08.04.2019   | 09.04.2019     | Национальный Банк РК     | 312 000 000 000          |
| 09.04.2019   | 10.04.2019     | Национальный Банк РК     | 313 000 000 000          |
| 10.04.2019   | 11.07.2019     | CREDIT AGRICOLE          | 37 933 000 000           |
| 10.04.2019   | 11.04.2019     | Национальный Банк РК     | 256 000 000 000          |
| 11.04.2019   | 12.04.2019     | Национальный Банк РК     | 259 000 000 000          |
| 12.04.2019   | 15.04.2019     | Национальный Банк РК     | 259 000 000 000          |
| 15.04.2019   | 16.04.2019     | Национальный Банк РК     | 261 000 000 000          |
| 15.04.2019   | 17.07.2019     | DBS BANK LTD             | 60 729 600 000           |
| 16.04.2019   | 17.04.2019     | Национальный Банк РК     | 270 000 000 000          |
| 17.04.2019   | 18.04.2019     | Национальный Банк РК     | 280 000 000 000          |
| 18.04.2019   | 19.04.2019     | Национальный Банк РК     | 287 000 000 000          |
| 19.04.2019   | 22.04.2019     | Национальный Банк РК     | 289 000 000 000          |
| 22.04.2019   | 23.04.2019     | Национальный Банк РК     | 276 000 000 000          |
| 23.04.2019   | 24.04.2019     | Национальный Банк РК     | 290 000 000 000          |
| 24.04.2019   | 25.04.2019     | Национальный Банк РК     | 211 000 000 000          |
| 24.04.2019   | 25.07.2019     | ING BANK N.V.            | 54 891 200 000           |
| 25.04.2019   | 26.04.2019     | Национальный Банк РК     | 190 000 000 000          |
| 26.04.2019   | 29.04.2019     | Национальный Банк РК     | 198 000 000 000          |
| 29.04.2019   | 30.04.2019     | Национальный Банк РК     | 183 000 000 000          |
| 30.04.2019   | 01.08.2019     | BANK OF TOKYO-MITSUBISHI | 59 448 480 000           |
| 30.04.2019   | 02.05.2019     | Национальный Банк РК     | 185 000 000 000          |
| <b>Итого</b> |                |                          | <b>6 019 002 280 000</b> |

**Таблица 9. Сведения по погашениям основного долга по ценным бумагам в отчетном месяце**

| ISIN         | Вид инструмента | Эмитент ценной бумаги | Дата фактического погашения | Сумма к погашению в тенге |
|--------------|-----------------|-----------------------|-----------------------------|---------------------------|
| KZW100010963 | ГЦБ РК          | Национальный Банк РК  | 03.04.2019                  | 140 000 000 000           |
| US912796RD34 | ГЦБ США         | Правительство США     | 04.04.2019                  | 94 572 500 000            |
| XS1134544151 | Еврооблигации   | АО «КазМунайГаз»      | 04.04.2019                  | 3 858 558 000             |
| KZW100007977 | ГЦБ РК          | Национальный Банк РК  | 05.04.2019                  | 1 600 350 000             |
| KZW100010971 | ГЦБ РК          | Национальный Банк РК  | 10.04.2019                  | 32 071 113 000            |
| KZW100010997 | ГЦБ РК          | Национальный Банк РК  | 17.04.2019                  | 100 000 000 000           |
| KZ2C00002616 | Облигации       | АО «Цеснабанк»        | 22.04.2019                  | 2 981 480 000             |
| KZK200000620 | ГЦБ РК          | Правительство РК      | 24.04.2019                  | 2 000 000 000             |

|              |           |                               |            |                        |
|--------------|-----------|-------------------------------|------------|------------------------|
| KZ2C00000800 | Облигации | АО «Народный Банк Казахстана» | 26.04.2019 | 2 499 900 000          |
| <b>Итого</b> |           |                               |            | <b>379 583 901 000</b> |

**Таблица 10. Сведения по погашениям основного долга по вкладам в отчетном месяце**

| Дата операции | Наименование банка                     | Сумма сделки в тенге     |
|---------------|--|--------------------------|
| 01.04.2019    | Национальный Банк РК                   | 265 000 000 000          |
| 02.04.2019    | Национальный Банк РК                   | 266 000 000 000          |
| 03.04.2019    | Национальный Банк РК                   | 271 000 000 000          |
| 04.04.2019    | Национальный Банк РК                   | 313 000 000 000          |
| 04.04.2019    | АО «Банк Kassa Nova»                   | 23 000 000               |
| 05.04.2019    | Национальный Банк РК                   | 315 000 000 000          |
| 08.04.2019    | Национальный Банк РК                   | 322 000 000 000          |
| 09.04.2019    | Национальный Банк РК                   | 312 000 000 000          |
| 09.04.2019    | ДО АО Банк ВТБ (Казахстан)             | 60 000 000               |
| 10.04.2019    | Национальный Банк РК                   | 313 000 000 000          |
| 10.04.2019    | SOCIETE GENERALE PARIS                 | 60 692 800 000           |
| 11.04.2019    | Национальный Банк РК                   | 256 000 000 000          |
| 12.04.2019    | Национальный Банк РК                   | 259 000 000 000          |
| 15.04.2019    | Национальный Банк РК                   | 259 000 000 000          |
| 15.04.2019    | BANK OF TOKYO-MITSUBISHI               | 48 204 120 000           |
| 16.04.2019    | Национальный Банк РК                   | 261 000 000 000          |
| 17.04.2019    | Национальный Банк РК                   | 270 000 000 000          |
| 18.04.2019    | Национальный Банк РК                   | 280 000 000 000          |
| 19.04.2019    | Национальный Банк РК                   | 287 000 000 000          |
| 22.04.2019    | Национальный Банк РК                   | 289 000 000 000          |
| 22.04.2019    | DBS BANK LTD                           | 37 711 000 000           |
| 23.04.2019    | Национальный Банк РК                   | 276 000 000 000          |
| 24.04.2019    | Национальный Банк РК                   | 290 000 000 000          |
| 25.04.2019    | Национальный Банк РК                   | 211 000 000 000          |
| 26.04.2019    | Национальный Банк РК                   | 190 000 000 000          |
| 29.04.2019    | CREDIT AGRICOLE                        | 59 200 700 000           |
| 29.04.2019    | Национальный Банк РК                   | 198 000 000 000          |
| 30.04.2019    | Национальный Банк РК                   | 183 000 000 000          |
| 30.04.2019    | ДО АО Банк ВТБ (Казахстан)             | 65 000 000               |
| 30.04.2019    | АО «AsiaCredit Bank (АзияКредит Банк)» | 807 511 267              |
| 30.04.2019    | АО «AsiaCredit Bank (АзияКредит Банк)» | 661 045 886              |
| <b>Итого</b>  |  | <b>6 093 425 177 153</b> |