

Информация по инвестиционному управлению пенсионными активами АО «ЕНПФ»

По состоянию на 1 сентября 2018 года пенсионные активы (далее – ПА) ЕНПФ, находящиеся в доверительном управлении Национального Банка Республики Казахстан (далее – НБРК), составили 8 800,73 млрд. тенге¹.

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

Наименование	млрд. тенге				
	Текущая стоимость на 01.01.2018 г.	Доля на 01.01.2018 г.	Текущая стоимость на 01.09.2018 г.	Доля на 01.09.2018 г.	Прирост/снижение с начала года
ГЦБ РК	3 587,63	46,14%	4 164,03	47,31%	16,07%
ГЦБ иностранных государств	948,84	12,20%	1 188,32	13,50%	25,24%
МФО	172,55	2,22%	160,14	1,82%	-7,19%
Корпоративные облигации эмитентов РК	58,30	0,75%	51,88	0,59%	-11,02%
Облигации квазигосударственных организаций РК	791,68	10,18%	707,46	8,04%	-10,64%
Облигации БВУ РК	1 246,49	16,03%	1 192,68	13,55%	-4,32%
Корпоративные облигации иностранных эмитентов	9,35	0,12%	9,46	0,11%	1,23%
Облигации иностранных эмитентов квазигосударственного сектора	53,39	0,69%	170,26	1,93%	218,86%
PPN (структурные ноты)	35,00	0,45%	30,02	0,34%	-14,23%
Акции и депозитарные расписки эмитентов РК	184,14	2,37%	155,68	1,77%	-15,45%
Акции и депозитарные расписки иностранных эмитентов	23,68	0,30%	19,28	0,22%	-18,58%
Депозиты	325,82	4,19%	296,86	3,37%	-8,89%
Депозиты НБРК	-	-	120,05	1,36%	
Депозиты в иностранных банках	277,41	3,57%	442,67	5,03%	59,57%
РЕПО	11,02	0,14%	-	0,00%	
Денежные средства на инвестиционных счетах (за вычетом обязательств по сделкам с ФИ)	20,88	0,27%	1,95	0,02%	
Прочие активы (дебиторская задолженность ² , просроченная задолженность, провизии)	28,62	0,37%	9,99	0,11%	-65,08%
Активы, находящиеся во внешнем управлении у Aviva Investors Global Services Limited*	-	-	79,99	0,91%	
Итого ПА, находящиеся в управлении НБРК	7 774,82	100,00%	8 800,73	100,00%	13,20%
Денежные средства на инвестиционных счетах для расчетов по совершенным сделкам			4,14		
Деньги на счетах пенсионных взносов и выплат	9,51		2,08		
Итого пенсионные активы	7 784,33		8 806,95		13,13%

* - в рамках мандата «Глобальные облигации развивающихся рынков»

По состоянию на 01.09.2018 года средневзвешенная доходность к погашению (YTM) долговых финансовых инструментов, находящихся в инвестиционном портфеле ПА ЕНПФ, составила 6,9% годовых, в том числе по номинированным в тенге – 8,3% годовых, в иностранной валюте – 3,8% годовых.

¹ без учета денег на счетах пенсионных взносов и выплат.

² 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.

Государственные ценные бумаги Республики Казахстан

Основную долю в портфеле ПА ЕНПФ занимают ГЦБ РК, текущая стоимость которых за отчетный месяц увеличилась на 92,33 млрд. тенге и составила 4 164,03 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 47,31%.

В отчетном периоде были приобретены следующие финансовые инструменты:

- краткосрочные дисконтные ноты НБРК в объеме 1 625,60 млрд. тенге со средневзвешенной доходностью 8,13% годовых;
- ГЦБ Министерства финансов РК, номинированные в тенге, в объеме 48,00 млрд. тенге со средневзвешенной доходностью 8,44% годовых;

В отчетном периоде произошло погашение дисконтных нот НБРК на сумму 1 611,48 млрд. тенге.

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

Государственные ценные бумаги иностранных государств

Текущая стоимость государственных ценных бумаг иностранных государств за отчетный месяц увеличилась на 223,45 млрд. тенге и составила 1 188,32 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 13,50%.

В отчетном периоде были приобретены краткосрочные ГЦБ США в объеме 244,81 млрд. тенге по номинальной стоимости со средневзвешенной доходностью 2,13% годовых, а также долгосрочные ГЦБ Российской Федерации, номинированные в долларах США, в объеме 19,92 млрд. тенге по номинальной стоимости со средневзвешенной доходностью 5,24% годовых.

В рамках нового стратегического распределения валютной части портфеля ПА, предусмотренного Инвестиционной декларацией ЕНПФ, приобретены ГЦБ Мексики, номинированные в долларах США, в объеме 20,36 млрд. тенге по номинальной стоимости со средневзвешенной доходностью 5,05% годовых.

В рассматриваемом периоде осуществлена продажа и погашение ГЦБ США на сумму 3,63 млрд. тенге и 105,99 млрд. тенге соответственно.

Средневзвешенная доходность к погашению ГЦБ иностранных государств в портфеле ПА ЕНПФ на отчетную дату составила 3,5% годовых.

Облигации Международных финансовых организаций

Текущая стоимость облигаций Международных финансовых организаций за отчетный месяц уменьшилась на 0,35 млрд. тенге и составила 160,14 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 1,82%.

В отчетном периоде продаж, покупок и погашений ценных бумаг Международных финансовых организаций не было.

Средневзвешенная доходность к погашению по облигациям Международных финансовых организаций, номинированным в тенге, составила 6,7% годовых, в долларах США – 5,0% годовых.

Депозиты в банках второго уровня Республики Казахстан

Текущая стоимость вкладов в БВУ РК, имеющих средневзвешенный срок погашения 5,3 лет, за отчетный месяц уменьшилась на 9,25 млрд. тенге и составила 296,86 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 3,37%.

В отчетном периоде произошло частичное досрочное погашение вкладов БВУ РК на сумму 11,37 млрд. тенге, в том числе за счет перевода части обусловленного вклада на сумму 3,1 млрд. тенге, размещенного в АО «Qazaq Banki», на депозит в АО «Банк «Bank RBK».

Средневзвешенная доходность к погашению вкладов БВУ РК на отчетную дату составила 10,0% годовых.

Депозиты в иностранных банках

Текущая стоимость вкладов в иностранных банках, имеющих средневзвешенный срок погашения 0,92 месяца, за отчетный месяц уменьшилась на 129,86 млрд. тенге и составила 442,67 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 5,03%.

В отчетном периоде произошло погашение вкладов на сумму 153,23 млрд. тенге. В отчетном месяце вклады в иностранных банках не размещались.

Средневзвешенная доходность к погашению вкладов в иностранных банках на отчетную дату составила 2,4% годовых.

Депозиты в Национальном Банке РК

Текущая стоимость депозитов в Национальном Банке РК составила 120,05 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 1,36%.

В отчетном месяце в рамках управления текущей ликвидностью с целью поддержания доходности по пенсионным активам осуществлено инвестирование в однодневные депозиты Национального Банка РК на сумму 288,41 млрд. тенге со средневзвешенной доходностью 8,0% годовых. В отчетном периоде произошло погашение депозитов на сумму 182,31 млрд. тенге.

Средневзвешенная доходность к погашению вкладов в Национальном Банке РК на отчетную дату составила 8,0% годовых.

Корпоративные облигации эмитентов Республики Казахстан

Текущая стоимость корпоративных облигаций эмитентов РК за отчетный месяц уменьшилась на 2,82 млрд. тенге и составила 51,88 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 0,59%.

В отчетном месяце произошло погашение облигаций АО «Атамекен-Агро» на сумму 2,27 млрд. тенге.

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

Средневзвешенная доходность к погашению корпоративных облигаций эмитентов РК в портфеле ПА ЕНПФ на отчетную дату составила 9,8% годовых.

Облигации квазигосударственных организаций Республики Казахстан

Текущая стоимость облигаций квазигосударственных организаций РК за отчетный месяц увеличились на 8,21 млрд. тенге и составила 707,46 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 8,14%.

В рассматриваемом периоде осуществлена выплата основного долга по облигациям АО «КИК» на сумму 7,48 млрд. тенге (снижение текущей стоимости произошло в предыдущем месяце).

В отчетном периоде 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 10,7% годовых, в долларах США – 5,0% годовых.

Облигации банков второго уровня Республики Казахстан

Текущая стоимость облигаций БВУ РК за отчетный месяц увеличилась на 3,85 млрд. тенге и составила 1 192,68 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 13,55%.

В отчетном периоде Национальный Банк РК запустил программу по финансированию БВУ РК для поддержки экономики путем инвестирования пенсионных активов ЕНПФ на рыночных условиях в среднесрочные облигации БВУ РК. В рамках данной облигационной программы были приобретены облигации АО «Банк ЦентКредит» на сумму 3,35 млрд. тенге с доходностью 12,0% годовых.

Продаж и погашений облигаций БВУ РК не было.

На отчетную дату средневзвешенная доходность к погашению по облигациям БВУ РК, номинированным в тенге, составила 9,9% годовых, в долларах США – 6,6% годовых.

Корпоративные облигации иностранных эмитентов

Текущая стоимость корпоративных облигаций иностранных эмитентов за отчетный месяц уменьшилась на 0,01 млрд. тенге и составила 9,46 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 0,11%.

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

Средневзвешенная доходность к погашению корпоративных облигаций иностранных эмитентов в портфеле ПА ЕНПФ на отчетную дату составила 7,4% годовых.

Облигации иностранных эмитентов квазигосударственного сектора

Текущая стоимость облигаций иностранных эмитентов квазигосударственного сектора за отчетный месяц увеличилась на 35,03 млрд. тенге и составила 170,26 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 1,93%.

В рамках нового стратегического распределения валютной части портфеля ПА, предусмотренного Инвестиционной декларацией ЕНПФ, приобретены облигации иностранных эмитентов квазигосударственного сектора Индонезии и Мексики, номинированные в долларах США, в общем объеме 28,55 млрд. тенге по номинальной стоимости со средневзвешенной доходностью 4,71% годовых.

Продаж и погашений облигаций иностранных эмитентов квазигосударственного сектора в отчетном месяце не было.

Средневзвешенная доходность к погашению иностранных эмитентов квазигосударственного сектора в портфеле ПА ЕНПФ на отчетную дату составила 4,7% годовых.

PPN (структурные ноты) иностранных эмитентов

Текущая стоимость PPN (структурных нот) иностранных эмитентов за отчетный месяц увеличилась на 0,77 млрд. тенге и составила 30,02 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 0,34%.

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 уменьшилась на 0,77 млрд. тенге и составила 155,68 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 1,77%.

В отчетном периоде в портфеле ПА ЕНПФ 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 уменьшилась на 3,86 млрд. тенге и составила 19,28 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 0,22%.

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

<i>млрд. тенге</i>					
Валюта	Текущая стоимость на 01.01.2018 г.	Доля на 01.01.2018 г.	Текущая стоимость на 01.09.2018 г.	Доля на 01.09.2018 г.	Прирост/снижение с начала года
Национальная валюта	5 619,71	72,28%	5 947,16	67,58%	5,83%
Доллары США	2 110,34	27,14%	2 817,59	32,02%	33,51%
Российские рубли	36,90	0,47%	29,31	0,33%	-20,57%
Другие валюты	7,88	0,10%	6,68	0,08%	-15,22%
Итого:	7 774,82	100,00%	8 800,73	100,00%	13,20%

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 2018 года составил 619,45 млрд. тенге. Доходность пенсионных активов ЕНПФ, распределенная на счета вкладчиков (получателей) с начала 2018 года, составила 7,28%.

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 2018 год
Доходы в виде вознаграждения по ценным бумагам, в том числе по размещенным вкладам и операциям «обратное РЕПО»	359,69
Доходы (убытки) от рыночной переоценки ценных бумаг	6,42
Доходы (убытки) от переоценки иностранной валюты	244,48
Доходы (убытки) от внешнего управления	9,47
Прочие доходы (убытки)	-0,61
Итого:	619,45

Информация о соблюдении параметров инвестиционной декларации

Структурное распределение ПА ЕНПФ, находящихся в доверительном управлении, соответствует требованиям Инвестиционной декларации ЕНПФ³. 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 01.09.2018г. представлены в Таблице 4.

Таблица 4. Лимиты инвестирования по ПА ЕНПФ

№	Вид финансового инструмента	Фактическое значение (в процентах от ПА)	Выполнение (да/нет)
1	Зарубежные эмитенты:	23,52%	да
1.1	Государственные, агентские и ценные бумаги международных финансовых организаций (МФО):	15,87%	да
1)	с рейтингом не ниже «ВВВ-» по международной шкале агентства «Standard & Poor's» или рейтингом аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств	11,73%	да
2)	с рейтингом от «ВВ+» до «ВВ-» по международной шкале агентства «Standard & Poor's» или рейтингом аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств	4,14%	да

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

1.2	Корпоративные долговые ценные бумаги:	2,06%	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	1,67%	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	0,39%	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	0,22%	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	5,03%	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	0,34%	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:	75,47%	да
2.1	Государственные ценные бумаги Республики Казахстан, выпущенные Министерством финансов Республики Казахстан, Национальным Банком Республики Казахстан	47,31%	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	1,36%	да
2.2	Ценные бумаги субъектов квазигосударственного сектора	8,50%	да
2.3	Финансовые инструменты банков второго уровня Республики Казахстан	17,93%	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 «В-» по международной шкале агентства «Standard & Poor's» или рейтинговой оценкой аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств	0,10%	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	0,26%	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	НИН (ISIN)	Номинальная стоимость в тенге
01.08.2018	29.08.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD283441	60 000 000 000
01.08.2018	20.05.2023	Еврооблигации	Pertamina Persero PT	USY7138AAE02	1 741 050 000
02.08.2018	09.08.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD073453	89 000 000 000
02.08.2018	04.04.2042	ГЦБ РФ	Правительство РФ	XS0767473852	2 447 760 000
02.08.2018	15.05.2027	Еврооблигации	Perusahaan Listrik Negara	US71568QAC15	1 748 400 000
02.08.2018	14.10.2025	Еврооблигации	Banco Nacional Com EXT	USP14517AA73	1 748 400 000

03.08.2018	10.08.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD073461	75 000 000 000
03.08.2018	04.04.2042	ГЦБ РФ	Правительство РФ	XS0767473852	4 546 880 000
03.08.2018	06.12.2018	ГЦБ США	Правительство США	US912796PE35	52 464 000 000
03.08.2018	23.11.2018	ГЦБ США	Правительство США	US912796QK85	52 464 000 000
06.08.2018	13.08.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD073479	85 000 000 000
06.08.2018	15.05.2027	Еврооблигации	Perusahaan Listrik Negara	US71568QAC15	1 744 000 000
06.08.2018	04.04.2042	ГЦБ РФ	Правительство РФ	XS0767473852	4 534 400 000
06.08.2018	04.02.2030	ГЦБ РК	Правительство РК	KZKDKY150123	18 000 000 000
07.08.2018	14.08.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD073487	80 000 000 000
07.08.2018	23.06.2047	ГЦБ РФ	Правительство РФ	RU000A0JXU14	2 302 212 000
07.08.2018	04.04.2042	ГЦБ РФ	Правительство РФ	XS0767473852	3 837 020 000
08.08.2018	05.09.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD283508	90 000 000 000
08.08.2018	08.03.2044	ГЦБ Мексики	Правительство Мексики	US91086QBB32	6 971 800 000
09.08.2018	16.08.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD073511	90 000 000 000
10.08.2018	17.08.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD073529	76 913 980 600
10.08.2018	10.01.2019	ГЦБ США	Правительство США	US912796QS12	42 816 000 000
10.08.2018	17.01.2019	ГЦБ США	Правительство США	US912796QT94	42 816 000 000
13.08.2018	20.08.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD073545	65 000 000 000
13.08.2018	21.05.2028	Еврооблигации	Perusahaan Listrik Negara	US71568QAE70	1 089 660 000
13.08.2018	23.06.2047	ГЦБ РФ	Правительство РФ	RU000A0JXU14	2 251 964 000
13.08.2018	10.05.2031	ГЦБ РК	Правительство РК	KZKDKY130067	15 000 000 000
14.08.2018	22.08.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD083551	75 354 077 800
14.08.2018	16.03.2022	Облигации	АО «Банк ЦентрКредит»	KZP06Y07D217	3 349 000 000
15.08.2018	12.09.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD283573	100 000 000 000
15.08.2018	14.10.2025	Еврооблигации	Banco Nacional Com EXT	USP14517AA73	2 531 620 000
15.08.2018	24.01.2019	ГЦБ США	Правительство США	US912796QU67	54 249 000 000
16.08.2018	23.08.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD073586	100 000 000 000
16.08.2018	08.03.2044	ГЦБ Мексики	Правительство Мексики	US91086QBB32	1 804 350 000
16.08.2018	02.05.2023	Еврооблигации	Pelabuhan Indonesia III	USY7140DAB65	1 804 350 000
16.08.2018	21.05.2028	Еврооблигации	Perusahaan Listrik Negara	US71568QAE70	7 217 400 000
16.08.2018	15.05.2027	Еврооблигации	Perusahaan Listrik Negara	US71568QAC15	4 691 310 000
17.08.2018	24.08.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD073594	86 871 852 200
20.08.2018	27.08.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD073610	80 000 000 000
20.08.2018	16.04.2032	ГЦБ РК	Правительство РК	KZKDKY140033	12 000 000 000
22.08.2018	19.09.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD283631	122 093 695 400
23.08.2018	03.09.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD113648	130 000 000 000
23.08.2018	14.10.2025	Еврооблигации	Banco Nacional Com EXT	USP14517AA73	2 531 410 000
23.08.2018	02.05.2023	Еврооблигации	Pelabuhan Indonesia III	USY7140DAB65	1 699 661 000
23.08.2018	08.03.2044	ГЦБ Мексики	Правительство Мексики	US91086QBB32	1 808 150 000
24.08.2018	04.09.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD113655	85 370 328 300
24.08.2018	08.03.2044	ГЦБ Мексики	Правительство Мексики	US91086QBB32	3 605 500 000
27.08.2018	03.09.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD073685	80 000 000 000
27.08.2018	12.05.2034	ГЦБ РК	Правительство РК	KZKDKY200027	3 000 000 000
28.08.2018	04.09.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD073693	55 000 000 000
28.08.2018	23.01.2046	ГЦБ Мексики	Правительство Мексики	US91086QBF46	1 806 550 000
29.08.2018	23.01.2046	ГЦБ Мексики	Правительство Мексики	US91086QBF46	4 361 160 000
Итого					1 990 586 941 300

Таблица 7. Сведения по продаже финансовых инструментов в отчетном месяце

Дата сделки	Дата погашения	Вид инструмента	Эмитент ценной бумаги	НИН (ISIN)	Сумма сделки в тенге
29.08.2018	15.03.2019	ГЦБ США	Правительство США	US912796PY98	3 632 773 594,00
Итого					3 632 773 594,00

Таблица 8. Сведения по размещениям во вклады в отчетном месяце

Дата сделки	Дата погашения	Наименование банка	Сумма сделки в тенге
01.08.2018	02.08.2018	Национальный Банк РК	22 500 000 000
02.08.2018	03.08.2018	Национальный Банк РК	19 300 000 000
03.08.2018	06.08.2018	Национальный Банк РК	16 800 000 000
06.08.2018	07.08.2018	Национальный Банк РК	19 300 000 000
07.08.2018	08.08.2018	Национальный Банк РК	23 800 000 000
08.08.2018	09.08.2018	Национальный Банк РК	21 705 866 284

09.08.2018	10.08.2018	Национальный Банк РК	15 000 000 000
22.08.2018	23.08.2018	Национальный Банк РК	30 000 000 000
25.08.2018	25.08.2023	АО «Банк «Bank RBK»	3 100 000 000
29.08.2018	03.09.2018	Национальный Банк РК	120 000 000 000
Итого			291 505 866 284

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

НИН (ISIN)	Вид инструмента	Эмитент ценной бумаги	Дата фактического погашения	Сумма к погашению в тенге
KZW1KD073362	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	01.08.2018	68 520 207 300
KZW1KD073388	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	02.08.2018	80 000 000 000
KZW1KD073396	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	03.08.2018	74 517 098 500
KZ2C0Y05E503	Облигации	АО «КИК»	06.08.2018	7 483 499 999
KZW1KD073412	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	06.08.2018	90 000 000 000
KZW1KD073420	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	07.08.2018	70 000 000 000
KZW1KD283235	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	08.08.2018	85 300 000 000
KZW1KD073453	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	09.08.2018	89 000 000 000
KZW1KD073461	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	10.08.2018	75 000 000 000
US912796PU76	ГЦБ США	Правительство США	10.08.2018	69 932 800 000
KZW1KD073479	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	13.08.2018	85 000 000 000
KZW1KD073487	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	14.08.2018	80 000 000 000
KZW1KD283300	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	15.08.2018	100 000 000 000
KZW1KD073511	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	16.08.2018	90 000 000 000
KZP01Y10D329	Облигации	АО «Атамекен-Агро»	17.08.2018	2 274 520 000
KZW1KD073529	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	17.08.2018	76 913 980 600
KZW1KD073545	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	20.08.2018	65 000 000 000
KZW1KD083551	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	22.08.2018	75 354 077 800
KZW1KD283375	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	22.08.2018	80 000 000 000
KZW1KD073586	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	23.08.2018	100 000 000 000
KZW1KD073594	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	24.08.2018	86 871 852 200
US912796PV59	ГЦБ США	Правительство США	24.08.2018	36 055 000 000
KZW1KD073610	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	27.08.2018	80 000 000 000
KZW1KD283441	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	29.08.2018	60 000 000 000
Итого				1 727 223 036 399

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

Дата сделки	Дата погашения	Наименование банка	Сумма сделки в тенге
01.08.2018	01.08.2018	Национальный Банк РК	13 900 000 000
02.08.2018	02.08.2018	Национальный Банк РК	22 500 000 000
03.08.2018	03.08.2018	CREDIT AGRICOLE	27 631 040 000
03.08.2018	21.10.2019	АО «Qazaq Banki»	1 942 016 136
03.08.2018	20.12.2019	АО «Qazaq Banki»	3 700 000 000
03.08.2018	03.08.2018	Национальный Банк РК	19 300 000 000
03.08.2018	03.08.2018	SOCIETE GENERALE	27 631 040 000
03.08.2018	03.08.2018	MIZUHO	43 720 000 000
03.08.2018	28.10.2019	ДО АО Банк ВТБ (Казахстан)	721 368 900
06.08.2018	06.08.2018	Национальный Банк РК	16 800 000 000
07.08.2018	07.08.2018	Национальный Банк РК	19 300 000 000
08.08.2018	08.08.2018	Национальный Банк РК	23 800 000 000
09.08.2018	09.08.2018	Национальный Банк РК	21 705 866 284
09.08.2018	21.10.2019	АО «Банк Астаны»	100 000 000
10.08.2018	10.08.2018	Национальный Банк РК	15 000 000 000
15.08.2018	15.08.2018	DBS BANK LTD	54 249 000 000
15.08.2018	28.10.2019	ДО АО «Банк ВТБ (Казахстан)»	50 000 000
23.08.2018	23.08.2018	Национальный Банк РК	30 000 000 000
24.08.2018	21.10.2019	АО «Банк Астаны»	210 000 000
25.08.2018	21.10.2019	АО «Qazaq Banki»	3 100 000 000
28.08.2018	29.12.2019	АО «КАЗКОММЕРЦБАНК»	150 000 000
28.08.2018	03.11.2019	АО «КАЗКОММЕРЦБАНК»	1 300 000 000
29.08.2018	28.10.2019	ДО АО «Банк ВТБ (Казахстан)»	95 800 000
Итого			346 906 131 320