

Информация по инвестиционному управлению пенсионными активами АО «ЕНПФ»

По состоянию на 1 октября 2018 года пенсионные активы (далее – ПА) ЕНПФ, находящиеся в доверительном управлении Национального Банка Республики Казахстан (далее – НБРК), составили 8 895,12 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	Текущая стоимость на 01.01.2018 г.	Доля на 01.01.2018 г.	Текущая стоимость на 01.10.2018 г.	Доля на 01.10.2018 г.	Прирост/снижение с начала года
ГЦБ РК	3 587,63	46,14%	4 165,72	46,83%	16,11%
ГЦБ иностранных государств	948,84	12,20%	1 178,68	13,25%	24,22%
МФО	172,55	2,22%	159,59	1,79%	-7,51%
Корпоративные облигации эмитентов РК	58,30	0,75%	52,27	0,59%	-10,34%
Облигации квазигосударственных организаций РК	791,68	10,18%	710,82	7,99%	-10,21%
Облигации БВУ РК	1 246, 49	16,03%	1 226,36	13,79%	-1,61%
Корпоративные облигации иностранных эмитентов	9,35	0,12%	8,56	0,10%	-8,45%
Облигации иностранных эмитентов квазигосударственного сектора	53,39	0,69%	178,98	2,01%	235,21%
PPN (структурные ноты)	35,00	0,45%	30,24	0,34%	-13,60%
Акции и депозитарные расписки эмитентов РК	184,14	2,37%	150,53	1,69%	-18,25%
Акции и депозитарные расписки иностранных эмитентов	23,68	0,30%	21,09	0,24%	-10,95%
Депозиты	325,82	4,19%	283,38	3,19%	-13,02%
Депозиты НБРК	-	-	190,08	2,14%	-
Депозиты в иностранных банках	277,41	3,57%	337,54	3,79%	21,68%
РЕПО	11,02	0,14%	106,15	1,19%	-
Денежные средства на инвестиционных счетах	20,88	0,27%	12,66	0,14%	-39,35%
Прочие активы (дебиторская задолженность ² , просроченная задолженность, провизии)	28,62	0,37%	3,02	0,03%	-89,44%
Активы, находящиеся во внешнем управлении у Aviva Investors Global Services Limited*	-	-	79,42	0,89%	-
Итого ПА, находящиеся в управлении НБРК	7 774,82	100,00%	8 895,12	100,00%	14,41%
Денежные средства на инвестиционных счетах для расчетов по совершенным сделкам					
Деньги на счетах пенсионных взносов и выплат	9,51		3,06		
Итого пенсионные активы	7 784,33		8 898,18		14,31%

* - в рамках мандата «Глобальные облигации развивающихся рынков»

По состоянию на 01.10.2018 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 – 8,2% годовых, в иностранной валюте – 3,9% годовых.

Государственные ценные бумаги Республики Казахстан

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.

Основную долю в портфеле ПА ЕНПФ занимают ГЦБ РК, текущая стоимость которых за отчетный месяц увеличилась на 1,69 млрд. тенге и составила 4 165,72 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 46,83%.

В отчетном периоде были приобретены следующие финансовые инструменты:

- краткосрочные дисконтные ноты НБРК в объеме 1 205,52 млрд. тенге со средневзвешенной доходностью 8,27% годовых;

- ГЦБ Министерства финансов РК, номинированные в тенге, в объеме 26,00 млрд. тенге со средневзвешенной доходностью 8,45% годовых;

В отчетном периоде произошло погашение дисконтных нот НБРК на сумму 1 236,28 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 уменьшилась на 9,64 млрд. тенге и составила 1 178,68 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 13,25%.

В отчетном периоде были приобретены краткосрочные ГЦБ США в объеме 78,68 млрд. тенге по номинальной стоимости со средневзвешенной доходностью 2,28% годовых.

В рамках нового стратегического распределения валютной части портфеля ПА, предусмотренного Инвестиционной декларацией ЕНПФ, приобретены ГЦБ Мексики, номинированные в долларах США, в объеме 7,16 млрд. тенге по номинальной стоимости со средневзвешенной доходностью 4,32% годовых.

В рассматриваемом периоде осуществлена продажа и погашение ГЦБ США на сумму 24,29 млрд. тенге и 69,06 млрд. тенге соответственно.

Средневзвешенная доходность к погашению ГЦБ иностранных государств в портфеле ПА ЕНПФ на отчетную дату составила 3,6% годовых.

Облигации Международных финансовых организаций

Текущая стоимость облигаций Международных финансовых организаций за отчетный месяц уменьшилась на 0,55 млрд. тенге и составила 159,59 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 1,79%.

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 5,4 лет, за отчетный месяц уменьшилась на 13,48 млрд. тенге и составила 283,38 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 3,19%.

В отчетном периоде произошло частичное досрочное погашение вкладов БВУ РК на сумму 9,93 млрд. тенге.

Средневзвешенная доходность к погашению вкладов БВУ РК на отчетную дату составила 9,8% годовых.

Депозиты в иностранных банках

Текущая стоимость вкладов в иностранных банках, имеющих средневзвешенный срок погашения 0,83 месяца, за отчетный месяц уменьшилась на 105,13 млрд. тенге и составила 337,54 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 3,79%.

В отчетном месяце были размещены вклады в иностранных банках на сумму 73,51 млрд. тенге со средневзвешенной доходностью 2,44% годовых. В отчетном периоде произошло погашение вкладов на сумму 178,20 млрд. тенге.

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 190,08 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 2,14%.

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 3 356,5 млрд. тенге со средневзвешенной доходностью 8,0% годовых. В отчетном периоде произошло погашение депозитов на сумму 3 286,50 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 увеличилась на 0,40 млрд. тенге и составила 52,27 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 0,59%.

В рассматриваемом периоде осуществлена выплата основного долга по облигациям АО «AMF GROUP» на сумму 0,73 млрд. тенге (снижение текущей стоимости произошло в августе текущего года).

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 увеличилась на 3,36 млрд. тенге и составила 710,82 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 7,99%.

В отчетном периоде покупок, погашений 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 33,68 млрд. тенге и составила 1 226,36 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 13,79%.

В отчетном периоде в рамках облигационной программы для БВУ РК на сумму 200 млрд. тенге были приобретены облигации БВУ РК на общую сумму 29,37 млрд. тенге со средневзвешенной доходностью 12,00% 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 0,91 млрд. тенге и составила 8,56 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 0,10%.

В отчетном месяце были реализованы Еврооблигации АКБANK TAS в объеме 1,00 млрд. тенге.

В отчетном периоде 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 7,7% годовых.

Облигации иностранных эмитентов квазигосударственного сектора

Текущая стоимость облигаций иностранных эмитентов квазигосударственного сектора за отчетный месяц увеличилась на 8,73 млрд. тенге и составила 178,98 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 2,01%.

В рамках нового стратегического распределения валютной части портфеля ПА, предусмотренного Инвестиционной декларацией ЕНПФ, приобретены облигации иностранных эмитентов квазигосударственного сектора Китая, номинированные в долларах США, в общем объеме 8,71 млрд. тенге по номинальной стоимости со средневзвешенной доходностью 4,21% 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 0,22 млрд. тенге и составила 30,24 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 5,15 млрд. тенге и составила 150,53 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 1,69%.

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 увеличилась на 1,81 млрд. тенге и составила 21,09 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 0,24%.

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

млрд. тенге

Валюта	Текущая стоимость на 01.01.2018 г.	Доля на 01.01.2018 г.	Текущая стоимость на 01.10.2018 г.	Доля на 01.10.2018 г.	Прирост/снижение с начала года
Национальная валюта	5 619,71	72,28%	6 143,14	69,06%	9,31%
Доллары США	2 110,34	27,14%	2 714,62	30,52%	28,63%
Российские рубли	36,90	0,47%	30,18	0,34%	-18,22%
Другие валюты	7,88	0,10%	7,19	0,08%	-8,74%
Итого:	7 774,82	100,00%	8 895,12	100,00%	14,41%

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 663,09 млрд. тенге. Доходность пенсионных активов ЕНПФ, распределенная на счета вкладчиков (получателей) с начала 2018 года, составила 7,75%.

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

млрд. тенге

Наименование	Инвестиционный доход за 2018 год
Доходы в виде вознаграждения по ценным бумагам, в том числе по размещенным вкладам и операциям «обратное РЕПО»	408,06
Доходы (убытки) от рыночной переоценки ценных бумаг	3,02
Доходы (убытки) от переоценки иностранной валюты	242,89
Доходы (убытки) от внешнего управления	8,90
Прочие доходы (убытки)	0,22
Итого:	663,09

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 01.10.2018г. 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:	22,16%	да
1.1	Государственные, агентские и ценные бумаги международных финансовых организаций (МФО):	15,64%	да
1)	с рейтингом не ниже «ВВВ-» по международной шкале агентства «Standard & Poor's» или рейтингом аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств	11,54%	да
2)	с рейтингом от «ВВ+» до «ВВ-» по международной шкале агентства «Standard & Poor's» или рейтингом аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств	4,11%	да
1.2	Корпоративные долговые ценные бумаги:	2,15%	да

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

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	1,76%	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	0,24%	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	3,79%	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:	75,68%	да
2.1	Государственные ценные бумаги Республики Казахстан, выпущенные Министерством финансов Республики Казахстан, Национальным Банком Республики Казахстан	46,83%	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	2,14%	да
2.2	Ценные бумаги субъектов квазигосударственного сектора	8,43%	да
2.3	Финансовые инструменты банков второго уровня Республики Казахстан	17,92%	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
03.09.2018	10.09.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD073727	200 000 000 000
03.09.2018	23.04.2033	ГЦБ РК	Правительство РК	KZKDKY150149	6 000 000 000
04.09.2018	11.09.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD073735	150 000 000 000
05.09.2018	12.09.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD073743	39 912 427 200
05.09.2018	03.10.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD283755	150 000 000 000
06.09.2018	26.12.2022	Облигации	АО «Цеснабанк»	KZP02Y08E766	15 000 000 000
06.09.2018	26.12.2021	Облигации	АО «Цеснабанк»	KZP01Y07E760	5 000 000 000

07.09.2018	07.02.2019	ГЦБ США	Правительство США	US912796QW24	41 318 200 000
10.09.2018	04.02.2030	ГЦБ РК	Правительство РК	KZKDKY150123	18 000 000 000
11.09.2018	15.08.2031	ГЦБ Мексики	Правительство Мексики	US91086QAG38	3 809 300 000
12.09.2018	15.08.2031	ГЦБ Мексики	Правительство Мексики	US91086QAG38	2 644 180 000
13.09.2018	18.01.2019	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KY011682	2 500 000 000
13.09.2018	04.04.2033	ГЦБ РК	Правительство РК	KZKDKY150131	500 000 000
13.09.2018	12.05.2034	ГЦБ РК	Правительство РК	KZKDKY200027	1 500 000 000
14.09.2018	18.01.2019	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KY011682	5 000 000 000
14.09.2018	21.02.2019	ГЦБ США	Правительство США	US912796QY89	37 365 000 000
17.09.2018	28.04.2025	Еврооблигации	Sinopec GRP Overseas DEV	USG8201JAC56	1 487 440 000
18.09.2018	04.05.2027	Еврооблигации	State Grid Overseas Inv	USG8450LAJ38	1 846 800 000
18.09.2018	15.01.2047	ГЦБ ИН.ГОС.	Правительство Мексики	US91087BAB62	701 784 000
18.09.2018	16.03.2022	Облигации	АО "Банк ЦентрКредит"	KZP06Y07D217	9 365 300 000
20.09.2018	27.09.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD073909	90 051 547 600
20.09.2018	02.05.2028	Еврооблигации	State Grid Overseas Inv	USG8450LAP97	3 590 000 000
21.09.2018	28.09.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD073917	93 847 285 000
24.09.2018	01.10.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD073925	100 000 000 000
25.09.2018	02.05.2028	Еврооблигации	State Grid Overseas Inv	USG8450LAP97	1 782 700 000
25.09.2018	02.10.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD073933	100 000 000 000
26.09.2018	03.10.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD073941	87 912 860 600
27.09.2018	04.10.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD073966	100 000 000 000
28.09.2018	05.10.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD073974	86 300 458 900
					1 355 435 283 300

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
14.09.2018	24.10.2022	Еврооблигации	AKBANK TAS	USM0375YAK49	1 003 250 250
28.09.2018	25.10.2018	ГЦБ США	Правительство США	US912796QE26	24 288 198 030
					25 291 448 280

Таблица 8. Сведения по размещениям во вклады в отчетном месяце

Дата сделки	Дата погашения	Наименование банка	Сумма сделки в тенге
03.09.2018	04.09.2018	Национальный Банк РК	20 000 000 000
03.09.2018	04.09.2018	Национальный Банк РК	21 000 000 000
04.09.2018	05.09.2018	Национальный Банк РК	53 500 000 000
11.09.2018	12.09.2018	Национальный Банк РК	96 000 000 000
11.09.2018	11.12.2018	ING Bank N.V.	38 093 000 000
12.09.2018	13.09.2018	Национальный Банк РК	230 000 000 000
13.09.2018	14.09.2018	Национальный Банк РК	296 000 000 000
14.09.2018	17.09.2018	Национальный Банк РК	340 000 000 000
17.09.2018	18.09.2018	Национальный Банк РК	330 000 000 000
18.09.2018	19.09.2018	Национальный Банк РК	325 000 000 000
19.09.2018	20.09.2018	Национальный Банк РК	350 000 000 000
20.09.2018	21.09.2018	Национальный Банк РК	300 000 000 000
21.09.2018	24.09.2018	Национальный Банк РК	295 000 000 000
24.09.2018	25.09.2018	Национальный Банк РК	220 000 000 000
24.09.2018	22.01.2019	Credit Agricole	35 412 000 000
25.09.2018	26.09.2018	Национальный Банк РК	100 000 000 000
26.09.2018	27.09.2018	Национальный Банк РК	110 000 000 000
27.09.2018	28.09.2018	Национальный Банк РК	80 000 000 000
28.09.2018	01.10.2018	Национальный Банк РК	190 000 000 000
Итого			3 430 005 000 000

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
KZW1KD113648	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	03.09.2018	130 000 000 000
KZW1KD073685	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	03.09.2018	80 000 000 000
KZP01Y07D994	Облигации	AMF GROUP	04.09.2018	730 000 000
KZW1KD113655	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	04.09.2018	85 370 328 300
KZW1KD073693	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	04.09.2018	55 000 000 000

KZW1KD283508	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	05.09.2018	90 000 000 000
US912796PY98	ГЦБ США	Правительство США	07.09.2018	33 805 800 000
KZW1KD073727	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	10.09.2018	200 000 000 000
KZW1KD073735	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	11.09.2018	150 000 000 000
KZW1KD283573	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	12.09.2018	100 000 000 000
KZW1KD073743	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	12.09.2018	39 912 427 200
KZW1KD283631	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	19.09.2018	122 093 695 400
US912796PZ63	ГЦБ США	Правительство США	21.09.2018	35 254 000 000
KZW1KD073909	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	27.09.2018	90 051 547 600
KZW1KD073917	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	28.09.2018	93 847 285 000
Итого				1 306 065 083 500

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

Дата сделки	Дата погашения	Наименование банка	Сумма сделки в тенге
03.09.2018	03.09.2018	Национальный Банк РК	120 000 000 000
04.09.2018	04.09.2018	Национальный Банк РК	21 000 000 000
04.09.2018	04.09.2018	Национальный Банк РК	20 000 000 000
05.09.2018	05.09.2018	Национальный Банк РК	53 500 000 000
05.09.2018	05.09.2018	DBS Bank LTD	55 483 500 000
11.09.2018	21.10.2019	АО «Банк «Астаны»	2 991 304 997
12.09.2018	12.09.2018	Национальный Банк РК	96 000 000 000
13.09.2018	13.09.2018	Национальный Банк РК	230 000 000 000
13.09.2018	10.12.2019	АО «Банк ЦентрКредит»	1 000 000 000
14.09.2018	20.10.2019	АО «AsiaCredit Bank»	592 000 000
14.09.2018	15.12.2019	АО «AsiaCredit Bank»	543 000 000
14.09.2018	29.12.2019	АО «ДБ «АЛЬФА-БАНК»	171 942 378
14.09.2018	14.09.2018	Национальный Банк РК	296 000 000 000
14.09.2018	14.09.2018	Rabobank Nederland	56 047 500 000
17.09.2018	17.09.2018	Национальный Банк РК	340 000 000 000
18.09.2018	18.09.2018	Национальный Банк РК	330 000 000 000
19.09.2018	19.09.2018	Национальный Банк РК	325 000 000 000
20.09.2018	20.09.2018	Национальный Банк РК	350 000 000 000
21.09.2018	21.09.2018	Национальный Банк РК	300 000 000 000
24.09.2018	24.09.2018	Национальный Банк РК	295 000 000 000
25.09.2018	25.09.2018	Национальный Банк РК	220 000 000 000
25.09.2018	28.10.2019	ДО АО Банк ВТБ (Казахстан)	72 200 000
25.09.2018	25.09.2018	Natixis	66 672 980 000
26.09.2018	29.12.2019	АО «ДБ «АЛЬФА-БАНК»	89 000 000
26.09.2018	26.09.2018	Национальный Банк РК	100 000 000 000
27.09.2018	27.09.2018	Национальный Банк РК	110 000 000 000
28.09.2018	28.09.2018	Национальный Банк РК	80 000 000 000
28.09.2018	20.10.2019	АО «Нурбанк»	1 400 000 000
28.09.2018	08.12.2019	АО «Нурбанк»	400 000 000
28.09.2018	08.12.2019	АО «Tengri Bank»	2 670 000 000
			3 474 633 427 375