

Информация по инвестиционному управлению пенсионными активами АО «ЕНПФ»

По состоянию на 1 января 2019 года пенсионные активы (далее – ПА) ЕНПФ, находящиеся в доверительном управлении Национального Банка Республики Казахстан (далее – НБРК), составили 9 378,03 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 01.01.2019 г.	Доля на 01.01.2019 г.	Прирост/снижение с начала года
ГЦБ РК	3 587,63	46,14%	4 057,98	43,27%	13,11%
ГЦБ иностранных государств	948,84	12,20%	1 191,92	12,71%	25,62%
МФО	172,55	2,22%	170,96	1,82%	-0,92%
Корпоративные облигации эмитентов РК	58,30	0,75%	42,06	0,45%	-27,86%
Облигации квазигосударственных организаций РК	791,68	10,18%	1 299,90	13,86%	64,20%
Облигации БВУ РК	1 246, 49	16,03%	1 264,78	13,49%	1,47%
Корпоративные облигации иностранных эмитентов	9,35	0,12%	8,85	0,09%	-5,35%
Облигации иностранных эмитентов квазигосударственного сектора	53,39	0,69%	232,92	2,48%	336,23%
PPN (структурные ноты)	35,00	0,45%	33,95	0,36%	-3,01%
Акции и депозитарные расписки эмитентов РК	184,14	2,37%	224,40	2,39%	21,87%
Акции и депозитарные расписки иностранных эмитентов	23,68	0,30%	20,42	0,22%	-13,76%
Депозиты	325,82	4,19%	277,65	2,96%	-14,78%
Депозиты НБРК	-	-	154,07	1,64%	
Депозиты в иностранных банках	277,41	3,57%	343,16	3,66%	23,70%
РЕПО	11,02	0,14%	-	0,00%	
Денежные средства на инвестиционных счетах	20,88	0,27%	126,69	1,35%	
Прочие активы (дебиторская задолженность ² , просроченная задолженность, провизии)	28,62	0,37%	15,23	0,16%	
Активы, находящиеся во внешнем управлении у Aviva Investors Global Services Limited*	-	-	82,80	0,88%	
Итого ПА, находящиеся в управлении НБРК**	7 774,82	100,00%	9 378,03	100,00%	20,62%
Обязательства к оплате по совершенным сделкам			169,71		
Деньги на счетах пенсионных взносов и выплат	9,51		7,12		
Итого пенсионные активы	7 784,33		9 554,86		22,74%

* - в рамках мандата «Глобальные облигации развивающихся рынков»

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

По состоянию на 01.01.2019г. 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 – 8,2% годовых, в иностранной валюте – 4,0% 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 уменьшилась на 115,33 млрд. тенге и составила 4 057,98 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 43,27%.

В отчетном периоде были приобретены следующие финансовые инструменты:

- краткосрочные дисконтные ноты НБРК в объеме 1 238,44 млрд. тенге со средневзвешенной доходностью 8,79% годовых;
- ГЦБ Министерства финансов РК, номинированные в тенге, в объеме 40,20 млрд. тенге со доходностью 8,60% годовых;

В рассматриваемом периоде произошло погашение дисконтных нот НБРК на сумму 1 435,09 млрд. тенге.

На отчетную дату средневзвешенная доходность к погашению по ГЦБ РК, номинированным в тенге, составила 6,9% годовых, в долларах США – 4,4% годовых.

Государственные ценные бумаги иностранных государств

Текущая стоимость государственных ценных бумаг иностранных государств за отчетный месяц увеличилась на 5,59 млрд. тенге и составила 1 191,92 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 12,71%.

В отчетном периоде были приобретены краткосрочные ГЦБ США в объеме 91,14 млрд. тенге по номинальной стоимости с доходностью 2,38% годовых.

В рассматриваемом периоде произошло погашение ГЦБ США на сумму 55,57 млрд. тенге, также были реализованы ГЦБ США в объеме 74,80 млрд. тенге.

Средневзвешенная доходность к погашению ГЦБ иностранных государств в портфеле ПА ЕНПФ на отчетную дату составила 3,9% годовых.

Облигации Международных финансовых организаций

Текущая стоимость облигаций международных финансовых организаций за отчетный месяц уменьшилась на 0,05 млрд. тенге и составила 170,96 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 1,82%.

Продаж, покупок и погашений ценных бумаг международных финансовых организаций не было.

Средневзвешенная доходность к погашению по облигациям международных финансовых организаций, номинированным в тенге, составила 6,4% 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 1,29 млрд. тенге и составила 277,65 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 2,96%.

В отчетном периоде произошло частичное досрочное погашение вкладов БВУ РК на сумму 2,04 млрд. тенге.

Средневзвешенная доходность к погашению вкладов БВУ РК на отчетную дату составила 9,6% годовых.

Депозиты в иностранных банках

Текущая стоимость вкладов в иностранных банках, имеющих средневзвешенный срок погашения 1,74 месяца, за отчетный месяц увеличилась на 74,72 млрд. тенге и составила 343,16 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 3,66%.

В отчетном месяце в иностранных банках были размещены вклады, номинированные в долларах США, на сумму 100,27 млрд. тенге со средневзвешенной доходностью 2,93% годовых.

В отчетном периоде произошло погашение вклада на сумму 37,06 млрд. тенге.

Средневзвешенная доходность к погашению вкладов в иностранных банках на отчетную дату составила 2,8% годовых.

Депозиты в Национальном Банке РК

Текущая стоимость депозитов в Национальном Банке РК составила 154,07 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 1,64%.

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 3 467,00 млрд. тенге со средневзвешенной доходностью 8,25% годовых. В отчетном периоде произошло погашение депозитов на общую сумму 3 445,00 млрд. тенге.

Средневзвешенная доходность к погашению вкладов в Национальном Банке РК на отчетную дату составила 8,25% годовых.

Корпоративные облигации эмитентов Республики Казахстан

Текущая стоимость корпоративных облигаций эмитентов РК за отчетный месяц уменьшилась на 11,00 млрд. тенге и составила 42,06 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 0,45%.

В отчетном периоде произошло погашение облигаций АО «ЦАТЭК» на сумму 12,68 млрд. тенге.

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 9,6% годовых.

Облигации квазигосударственных организаций Республики Казахстан

Текущая стоимость облигаций квазигосударственных организаций РК за отчетный месяц увеличилась на 123,70 млрд. тенге и составила 1 299,90 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 13,86%.

В отчетном периоде были приобретены облигации квазигосударственных организаций РК в объеме 136,85 млрд. тенге по номинальной стоимости со средневзвешенной доходностью 9,85% годовых.

В рассматриваемом периоде произошло погашение облигаций АО «Продкорпорация» на сумму 13,99 млрд. тенге и АО «ИО «КИК» на сумму 4,00 млрд. тенге (выплата ожидается в период с 23.12.2018г. по 09.01.2019г.), а также была реализована часть облигаций АО «АстанаГаз КМГ» в объеме 1,00 млрд. тенге.

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 увеличилась на 18,09 млрд. тенге и составила 1 264,78 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 13,49%.

В отчетном периоде в рамках облигационной программы для БВУ РК на сумму 200 млрд. тенге и обеспечения долгосрочной тенговой ликвидности на сумму 600 млрд. тенге были приобретены облигации БВУ РК на общую сумму 43,55 млрд. тенге со средневзвешенной доходностью 12,09% годовых.

В рассматриваемом периоде произошло погашение облигаций БВУ РК на сумму 7,16 млрд. тенге, а также были реализованы облигации БВУ РК на сумму 18,35 млрд. тенге.

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

Корпоративные облигации иностранных эмитентов

Текущая стоимость корпоративных облигаций иностранных эмитентов за отчетный месяц увеличилась на 0,21 млрд. тенге и составила 8,85 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 7,7% годовых.

Облигации иностранных эмитентов квазигосударственного сектора

Текущая стоимость облигаций иностранных эмитентов квазигосударственного сектора за отчетный месяц увеличилась на 8,13 млрд. тенге и составила 232,92 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 2,48%.

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 4,63 млрд. тенге по номинальной стоимости со средневзвешенной доходностью 4,11% годовых.

В рассматриваемом периоде были реализованы облигации иностранных эмитентов квазигосударственного сектора на общую сумму 4,58 млрд. тенге. Погашений в отчетном месяце 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 3,06 млрд. тенге и составила 33,95 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 0,36%.

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 8,07 млрд. тенге и составила 224,40 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 2,39%.

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 0,42 млрд. тенге и составила 20,42 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 01.01.2018г.	Доля на 01.01.2018г.	Текущая стоимость на 01.01.2019г.	Доля на 01.01.2019г.	Прирост/снижение с начала года
Национальная валюта	5 619,71	72,28%	6 304,73	67,23%	12,19%
Доллары США	2 110,34	27,14%	3 035,86	32,37%	43,86%
Российские рубли	36,90	0,47%	30,28	0,32%	-17,93%
Другие валюты	7,88	0,10%	7,16	0,08%	-9,09%
Итого:	7 774,82	100,00%	9 378,03	100,00%	20,62%

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 2018 года составил 977,18 млрд. тенге. Доходность пенсионных активов ЕНПФ, распределенная на счета вкладчиков (получателей) с начала 2018 года, составила 11,27%.

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»	554,87
Доходы (убытки) от рыночной переоценки ценных бумаг	17,10
Доходы (убытки) от переоценки иностранной валюты	394,04
Доходы (убытки) от внешнего управления	12,28
Прочие доходы (убытки)	-1,11
Итого:	977,18

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 01.01.2019г. 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:	22,17%	да
1.1	Государственные, агентские и ценные бумаги международных финансовых организаций (МФО):	15,30%	да
1)	с рейтингом не ниже «ВВВ-» по международной шкале агентства «Standard & Poor's» или рейтингом аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств	11,18%	да
2)	с рейтингом от «ВВ+» до «ВВ-» по международной шкале агентства «Standard & Poor's» или рейтингом аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств	4,12%	да
1.2	Корпоративные долговые ценные бумаги:	2,64%	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	2,25%	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	3,66%	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	0,36%	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:	77,68%	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	1,64%	да
2.2	Ценные бумаги субъектов квазигосударственного сектора	15,04%	да
2.3	Финансовые инструменты банков второго уровня Республики Казахстан	17,36%	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	0,09%	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	0,26%	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
04.12.2018	13.12.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD074659	100 000 000 000
05.12.2018	14.12.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD074667	85 693 069 200
06.12.2018	06.12.2019	Облигации	АО «ИЮ «Баспана»	KZ2C0M12G010	15 000 000 000
06.12.2018	19.12.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD094681	100 000 000 000
07.12.2018	20.12.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD094699	100 000 000 000
07.12.2018	29.01.2019	ГЦБ США	Правительство США	US912796UL13	91 140 540 000

10.12.2018	19.12.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD074709	94 025 272 500
11.12.2018	16.09.2025	Евроблигации	Avi Funding	XS1291170360	1 111 650 000
12.12.2018	21.12.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD074733	92 781 801 600
12.12.2018	16.09.2025	Евроблигации	Avi Funding	XS1291170360	1 850 550 000
13.12.2018	16.01.2019	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD284761	100 000 000 000
13.12.2018	26.12.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD074758	95 942 904 400
13.12.2018	04.05.2027	Евроблигации	Rongshi International	XS1601199778	555 060 000
13.12.2018	13.12.2033	Облигации	АО «АстанаГаз КМГ»	KZP01Y15G081	83 000 000 000
13.12.2018	10.06.2025	Евроблигации	Three Gorges Fin I Cauma	USG8850LAA82	1 110 120 000
13.12.2018	12.12.2022	Облигации	АО «Хоум Кредит Банк»	KZP04Y04E654	4 800 000 000
14.12.2018	27.01.2023	Облигации	АО «KASPI BANK»	KZP03Y08E830	7 458 010 000
19.12.2018	28.12.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD074782	100 000 000 000
20.12.2018	03.01.2019	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD104795	100 000 000 000
21.12.2018	04.01.2019	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD104803	100 000 000 000
26.12.2018	13.08.2029	ГЦБ РК	Правительство РК	KZKDKY150118	40 200 000 000
26.12.2018	26.06.2020	Облигации	АО «Нурбанк»	KZP05M18E753	5 000 000 000
26.12.2018	26.12.2021	Облигации	АО «Нурбанк»	KZP04Y03E755	5 000 000 000
27.12.2018	27.12.2025	Облигации	АО «Банк ЦентрКредит»	KZP04Y07E996	7 500 000 000
27.12.2018	27.12.2033	Облигации	АО «НУХ «Байтерек»	KZ2C0Y15G093	38 850 000 000
28.12.2018	20.12.2021	Облигации	АО «Хоум Кредит Банк»	KZP01Y03G053	7 847 900 000
28.12.2018	10.01.2019	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD074873	70 000 000 000
29.12.2018	11.01.2019	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD074881	100 000 000 000
29.12.2018	27.11.2021	Облигации	ДБ АО «Сбербанк»	KZP01Y03E488	5 944 600 000
Итого					1 554 811 477 700

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
06.12.2018	04.05.2027	Евроблигации	State Grid Overseas Inv	USG8450LAJ38	4 581 647 330
20.12.2018	28.02.2023	ГЦБ США	Правительство США	US9128284A52	56 033 809 531
20.12.2018	28.02.2025	ГЦБ США	Правительство США	US9128283Z13	18 773 209 677
26.12.2018	26.12.2021	Облигации	АО «Цеснабанк»	KZP01Y07E760	4 631 200 000
26.12.2018	26.12.2022	Облигации	АО «Цеснабанк»	KZP02Y08E766	13 719 225 000
29.12.2018	13.12.2033	Облигации	АО «АстанаГаз КМГ»	KZP01Y15G081	1 004 444 000
Итого					98 743 535 538

Таблица 8. Сведения по размещениям во вклады в отчетном месяце

Дата сделки	Дата погашения	Наименование банка	Сумма сделки в тенге
04.12.2018	05.12.2018	Национальный Банк РК	305 000 000 000
05.12.2018	06.12.2018	Национальный Банк РК	354 000 000 000
06.12.2018	07.12.2018	Национальный Банк РК	240 000 000 000
07.12.2018	10.12.2018	Национальный Банк РК	158 000 000 000
10.12.2018	11.12.2018	Национальный Банк РК	85 000 000 000
11.12.2018	11.03.2019	DBS BANK LTD	25 938 500 000
11.12.2018	12.12.2018	Национальный Банк РК	68 000 000 000
12.12.2018	13.12.2018	Национальный Банк РК	172 000 000 000
13.12.2018	14.12.2018	Национальный Банк РК	188 000 000 000
14.12.2018	19.12.2018	Национальный Банк РК	173 000 000 000
19.12.2018	20.12.2018	Национальный Банк РК	177 000 000 000
20.12.2018	21.12.2018	Национальный Банк РК	281 000 000 000
21.12.2018	24.12.2018	Национальный Банк РК	287 000 000 000
24.12.2018	25.12.2018	Национальный Банк РК	195 000 000 000
24.12.2018	26.03.2019	DBS BANK LTD	74 336 000 000
25.12.2018	26.12.2018	Национальный Банк РК	105 000 000 000
26.12.2018	27.12.2018	Национальный Банк РК	187 000 000 000
27.12.2018	28.12.2018	Национальный Банк РК	151 000 000 000
28.12.2018	29.12.2018	Национальный Банк РК	187 000 000 000
29.12.2018	03.01.2019	Национальный Банк РК	154 000 000 000
Итого			3 567 274 500 000

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
KZW1KD084567	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	04.12.2018	150 000 000 000
KZW1KD074576	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	04.12.2018	100 000 000 000
KZW1KD284381	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	05.12.2018	141 871 830 700
US912796PE35	ГЦБ США	Правительство США	07.12.2018	55 573 500 000
KZ2C0Y10D307	Облигации	АО «ЦАТЭК»	07.12.2018	12 679 280 000
KZW1KD074626	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	11.12.2018	80 000 000 000
KZW1KD284456	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	12.12.2018	100 000 000 000
KZW1KD074634	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	12.12.2018	94 776 488 700
KZW1KD074659	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	13.12.2018	100 000 000 000
KZW1KD074667	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	14.12.2018	85 693 069 200
KZW1KD074709	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	19.12.2018	94 025 272 500
KZW1KD094681	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	19.12.2018	100 000 000 000
KZW1KD094699	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	20.12.2018	100 000 000 000
XS1153772725	Облигации	АО «ForteBank»	20.12.2018	53 310 490
KZW1KD074733	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	21.12.2018	92 781 801 600
KZW1KD074758	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	26.12.2018	95 942 904 400
KZP01Y07E018	Облигации	ДБ АО «Сбербанк»	26.12.2018	7 103 000 000
KZ2C0Y07E152	Облигации	АО «Продкорпорация»	28.12.2018	13 999 999 000
KZW1KD074782	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	28.12.2018	100 000 000 000
Итого				1 524 500 456 590

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

Дата операции	Наименование банка	Сумма сделки в тенге
04.12.2018	Национальный Банк РК	132 000 000 000
05.12.2018	ДО АО Банк ВТБ (Казахстан)	30 000 000
05.12.2018	Национальный Банк РК	305 000 000 000
06.12.2018	Национальный Банк РК	354 000 000 000
07.12.2018	АО «КАЗКОММЕРЦБАНК»	200 000 000
07.12.2018	АО «КАЗКОММЕРЦБАНК»	630 000 000
07.12.2018	Национальный Банк РК	240 000 000 000
07.12.2018	АО «AsiaCredit Bank (АзияКредит Банк)»	201 000 000
07.12.2018	АО «AsiaCredit Bank (АзияКредит Банк)»	81 000 000
10.12.2018	Национальный Банк РК	158 000 000 000
11.12.2018	Национальный Банк РК	85 000 000 000
11.12.2018	ING BANK N.V.	37 055 000 000
12.12.2018	Национальный Банк РК	68 000 000 000
13.12.2018	Национальный Банк РК	172 000 000 000
14.12.2018	Национальный Банк РК	188 000 000 000
19.12.2018	Национальный Банк РК	173 000 000 000
20.12.2018	Национальный Банк РК	177 000 000 000
21.12.2018	Национальный Банк РК	281 000 000 000
24.12.2018	Национальный Банк РК	287 000 000 000
25.12.2018	Национальный Банк РК	195 000 000 000
25.12.2018	ДО АО Банк ВТБ (Казахстан)	70 000 000
26.12.2018	Национальный Банк РК	105 000 000 000
26.12.2018	АО «AsiaCredit Bank»	892 089
26.12.2018	АО «AsiaCredit Bank»	76 176 222
27.12.2018	Национальный Банк РК	187 000 000 000
28.12.2018	Национальный Банк РК	151 000 000 000
28.12.2018	АО «Нурбанк»	150 000 000
28.12.2018	АО «Нурбанк»	600 000 000
28.12.2018	Национальный Банк РК	187 000 000 000
Итого		3 484 094 068 311