

Информация по инвестиционному управлению пенсионными активами АО «ЕНПФ»

По состоянию на 1 декабря 2018 года пенсионные активы (далее – ПА) ЕНПФ, находящиеся в доверительном управлении Национального Банка Республики Казахстан (далее – НБРК), составили 9 135,16 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 01.12.2018 г.	Доля на 01.12.2018 г.	Прирост/снижение с начала года
ГЦБ РК	3 587,63	46,14%	4 173,32	45,68%	16,33%
ГЦБ иностранных государств	948,84	12,20%	1 186,32	12,99%	25,03%
МФО	172,55	2,22%	171,01	1,87%	-0,90%
Корпоративные облигации эмитентов РК	58,30	0,75%	53,06	0,58%	-8,99%
Облигации квазигосударственных организаций РК	791,68	10,18%	1 176,21	12,88%	48,57%
Облигации БВУ РК	1 246, 49	16,03%	1 246,69	13,65%	0,02%
Корпоративные облигации иностранных эмитентов	9,35	0,12%	8,64	0,09%	-7,64%
Облигации иностранных эмитентов квазигосударственного сектора	53,39	0,69%	224,79	2,46%	321,00%
PPN (структурные ноты)	35,00	0,45%	30,89	0,34%	-11,74%
Акции и депозитарные расписки эмитентов РК	184,14	2,37%	216,33	2,37%	17,48%
Акции и депозитарные расписки иностранных эмитентов	23,68	0,30%	20,85	0,23%	-11,96%
Депозиты	325,82	4,19%	278,94	3,05%	-14,39%
Депозиты НБРК	-	-	132,00	1,44%	
Депозиты в иностранных банках	277,41	3,57%	268,44	2,94%	-3,24%
РЕПО	11,02	0,14%	-	0,00%	
Денежные средства на инвестиционных счетах	20,88	0,27%	39,25	0,43%	
Прочие активы (дебиторская задолженность ² , просроченная задолженность, провизии)	28,62	0,37%	3,85	0,04%	
Активы, находящиеся во внешнем управлении у Aviva Investors Global Services Limited*	-	-	79,88	0,87%	
Итого ПА, находящиеся в управлении НБРК**	7 774,82	100,00%	9 135,16	100,00%	17,50%
Обязательства к оплате по совершенным сделкам			175,30		
Деньги на счетах пенсионных взносов и выплат	9,51		2,16		
Итого пенсионные активы	7 784,33		9 312,63		19,63

* - в рамках мандата «Глобальные облигации развивающихся рынков»

** - с учетом обязательств к оплате по совершенным сделкам на сумму 175,30 млрд. тенге

По состоянию на 01.12.2018г. 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 367,68 млрд. тенге и составила 4 173,32 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 45,68%.

В отчетном периоде были приобретены краткосрочные дисконтные ноты НБРК в объеме 1 958,57 млрд. тенге со средневзвешенной доходностью 8,78% годовых.

В рассматриваемом периоде произошло погашение дисконтных нот НБРК на сумму 2 311,44 млрд. тенге.

На отчетную дату средневзвешенная доходность к погашению по ГЦБ РК, номинированным в тенге, составила 7,0% годовых, в долларах США – 4,4% годовых.

Государственные ценные бумаги иностранных государств

Текущая стоимость государственных ценных бумаг иностранных государств за отчетный месяц уменьшилась на 59,85 млрд. тенге и составила 1 186,32 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 12,99%.

В отчетном периоде были приобретены краткосрочные ГЦБ США в объеме 174,11 млрд. тенге по номинальной стоимости с доходностью 2,41% годовых.

В рамках нового стратегического распределения валютной части портфеля ПА, предусмотренного Инвестиционной декларацией ЕНПФ, приобретены ГЦБ развивающихся стран, номинированные в долларах США, на сумму 3,65 млрд. тенге по номинальной стоимости со средневзвешенной доходностью 4,20%, в том числе:

- ГЦБ Чили в объеме 1,04 млрд. тенге с доходностью 3,80% годовых;

- ГЦБ Филиппин в объеме 2,61 млрд. тенге со средневзвешенной доходностью 4,37% годовых.

В рассматриваемом периоде произошло погашение ГЦБ США на сумму 243,79 млрд. тенге. Продаж государственных ценных бумаг иностранных государств не было.

Средневзвешенная доходность к погашению ГЦБ иностранных государств в портфеле ПА ЕНПФ на отчетную дату составила 3,8% годовых.

Облигации Международных финансовых организаций

Текущая стоимость облигаций международных финансовых организаций за отчетный месяц увеличилась на 5,43 млрд. тенге и составила 171,01 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 1,87%.

В отчетном периоде были приобретены облигации Евразийского Банка Развития в объеме 5,00 млрд. тенге по номинальной стоимости с доходностью 9,70% годовых.

Продаж и погашений ценных бумаг международных финансовых организаций не было.

Средневзвешенная доходность к погашению по облигациям международных финансовых организаций, номинированным в тенге, составила 6,5% 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 2,30 млрд. тенге и составила 278,94 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 3,05%.

В отчетном периоде произошло частичное досрочное погашение вкладов БВУ РК на сумму 2,91 млрд. тенге.

Средневзвешенная доходность к погашению вкладов БВУ РК на отчетную дату составила 9,7% годовых.

Депозиты в иностранных банках

Текущая стоимость вкладов в иностранных банках, имеющих средневзвешенный срок погашения 2,08 месяца, за отчетный месяц увеличилась на 42,98 млрд. тенге и составила 268,44 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 2,94%.

В отчетном месяце в иностранных банках были размещены вклады, номинированные в долларах США и российских рублях, на сумму 74,10 млрд. тенге со средневзвешенной доходностью 2,81% годовых и 3,89 млрд. тенге с доходностью 6,95% годовых соответственно.

В отчетном периоде произошло погашение вкладов на сумму 37,27 млрд. тенге.

Средневзвешенная доходность к погашению вкладов в иностранных банках на отчетную дату составила 2,6% годовых.

Депозиты в Национальном Банке РК

Текущая стоимость депозитов в Национальном Банке РК составила 132,00 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 1,44%.

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 3 981,00 млрд. тенге со средневзвешенной доходностью 8,25% годовых. В отчетном периоде произошло погашение депозитов на общую сумму 4 034,00 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 увеличилась на 0,40 млрд. тенге и составила 53,06 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 0,58%.

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

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

Облигации квазигосударственных организаций Республики Казахстан

Текущая стоимость облигаций квазигосударственных организаций РК за отчетный месяц увеличились на 448,57 млрд. тенге и составила 1 176,21 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 12,88%.

В рассматриваемом периоде были приобретены облигации АО «НУХ «КазАгро» в объеме 450,00 млрд. тенге по номинальной стоимости с доходностью 10,00% годовых.

В отчетном периоде 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 10,4% годовых, в долларах США – 5,0% годовых.

Облигации банков второго уровня Республики Казахстан

Текущая стоимость облигаций БВУ РК за отчетный месяц уменьшилась на 5,30 млрд. тенге и составила 1 246,69 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 13,65%.

В отчетном периоде в рамках облигационной программы для БВУ РК на сумму 200 млрд. тенге были приобретены облигации БВУ РК на общую сумму 7,08 млрд. тенге со средневзвешенной доходностью 11,35% годовых.

В рассматриваемом периоде произошло погашение облигаций БВУ РК в объеме 12,14 млрд. тенге.

Продаж 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 – 6,6% годовых.

Корпоративные облигации иностранных эмитентов

Текущая стоимость корпоративных облигаций иностранных эмитентов за отчетный месяц уменьшилась на 0,37 млрд. тенге и составила 8,64 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 0,93 млрд. тенге и составила 224,79 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 2,46%.

Продаж, погашений и покупок облигаций иностранных эмитентов квазигосударственного сектора 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 0,15 млрд. тенге и составила 30,89 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 увеличилась на 55,11 млрд. тенге и составила 216,33 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 2,37%.

В отчетном периоде были приобретены депозитарные расписки АО «Национальная атомная компания «Казатомпром» в объеме 56,13 млрд. тенге.

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 1,08 млрд. тенге и составила 20,85 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 0,23%.

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 01.01.2018г.	Доля на 01.01.2018г.	Текущая стоимость на 01.12.2018г.	Доля на 01.12.2018г.	Прирост/снижение с начала года
Национальная валюта	5 619,71	72,28%	6 287,73	68,83%	11,89%
Доллары США	2 110,34	27,14%	2 810,23	30,76%	33,17%
Российские рубли	36,90	0,47%	30,32	0,33%	-17,84%

Другие валюты	7,88	0,10%	6,88	0,08%	-12,60%
Итого:	7 774,82	100,00%	9 135,16	100,00%	17,50%

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 800,19 млрд. тенге. Доходность пенсионных активов ЕНПФ, распределенная на счета вкладчиков (получателей) с начала 2018 года, составила 9,24%.

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»	502,22
Доходы (убытки) от рыночной переоценки ценных бумаг	-13,13
Доходы (убытки) от переоценки иностранной валюты	303,39
Доходы (убытки) от внешнего управления	9,36
Прочие доходы (убытки)	-1,65
Итого:	800,19

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 01.12.2018г. 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:	21,73%	да
1.1	Государственные, агентские и ценные бумаги международных финансовых организаций (МФО):	15,61%	да
1)	с рейтингом не ниже «BBB-» по международной шкале агентства «Standard & Poor's» или рейтингом аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств	11,57%	да
2)	с рейтингом от «BB+» до «BB-» по международной шкале агентства «Standard & Poor's» или рейтингом аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств	4,04%	да
1.2	Корпоративные долговые ценные бумаги:	2,22%	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	2,23%	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	0,23%	да

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

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	2,94%	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:	79,13%	да
2.1	Государственные ценные бумаги Республики Казахстан, выпущенные Министерством финансов Республики Казахстан, Национальным Банком Республики Казахстан	45,68%	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	1,44%	да
2.2	Ценные бумаги субъектов квазигосударственного сектора	13,93%	да
2.3	Финансовые инструменты банков второго уровня Республики Казахстан	17,71%	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	НИН (ISIN)	Номинальная стоимость в тенге
01.11.2018	12.11.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD074345	150 000 000 000
02.11.2018	27.03.2025	ГЦБ Чили	Правительство Республики Чили	US168863BW77	1 039 668 000
02.11.2018	13.11.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD074352	150 000 000 000
02.11.2018	21.03.2019	ГЦБ США	Правительство США	US912796RC50	81 688 200 000
05.11.2018	05.12.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD284381	141 871 830 700
05.11.2018	14.11.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD074378	49 949 986 500
06.11.2018	06.11.2022	Облигации	Евразийский банк развития	KZP03Y04E904	5 000 000 000
12.11.2018	12.12.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD284456	100 000 000 000
12.11.2018	21.11.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD074444	130 613 096 700
13.11.2018	22.11.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD074469	150 000 000 000
13.11.2018		Депозитарные расписки	АО «НАК «Казатомпром»	US63253R2013	56 129 997 904
13.11.2018	02.02.2042	ГЦБ Филиппин	Правительство Республики Филиппин	US718286CB15	1 871 000 000
14.11.2018	23.11.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD074477	130 061 840 800
15.11.2018	26.11.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD074493	150 000 000 000

19.11.2018	28.11.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD074519	119 031 530 200
20.11.2018	29.11.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD074535	150 000 000 000
20.11.2018	04.04.2019	ГЦБ США	Правительство США	US912796RD34	36 495 000 000
21.11.2018	30.11.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD074543	112 260 973 000
22.11.2018	04.12.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD084567	150 000 000 000
23.11.2018	04.12.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD074576	100 000 000 000
27.11.2018	27.11.2021	Облигации	ДБ АО «Сбербанк»	KZP01Y03E488	2 080 000 000
27.11.2018	04.04.2019	ГЦБ США	Правительство США	US912796RD34	55 924 500 000
28.11.2018	27.01.2023	Облигации	АО «Kaspi Bank»	KZP03Y08E830	5 000 000 000
29.11.2018	11.12.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD074626	80 000 000 000
29.11.2018	13.01.2037	ГЦБ Филиппин	Правительство Республики Филиппин	US718286BW60	742 560 000
29.11.2018	29.11.2033	Облигации	АО «НУХ «КазАгро»	KZP01Y15G065	450 000 000 000
30.11.2018	12.12.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD074634	94 776 488 700
Итого					2 654 536 672 504

Таблица 7. Сведения по размещениям во вклады в отчетном месяце

Дата сделки	Дата погашения	Наименование банка	Сумма сделки в тенге
01.11.2018	02.11.2018	Национальный Банк РК	192 000 000 000
01.11.2018	01.02.2019	ING Bank N.V.	3 887 200 000
02.11.2018	05.11.2018	Национальный Банк РК	183 000 000 000
05.11.2018	06.11.2018	Национальный Банк РК	185 000 000 000
06.11.2018	07.11.2018	Национальный Банк РК	157 000 000 000
07.11.2018	08.11.2018	Национальный Банк РК	94 000 000 000
08.11.2018	09.11.2018	Национальный Банк РК	203 000 000 000
09.11.2018	12.11.2018	Национальный Банк РК	285 000 000 000
12.11.2018	13.11.2018	Национальный Банк РК	400 000 000 000
13.11.2018	14.11.2018	Национальный Банк РК	445 000 000 000
14.11.2018	15.11.2018	Национальный Банк РК	400 000 000 000
15.11.2018	16.11.2018	Национальный Банк РК	295 000 000 000
16.11.2018	19.11.2018	Национальный Банк РК	150 000 000 000
19.11.2018	20.11.2018	Национальный Банк РК	30 000 000 000
20.11.2018	21.11.2018	Национальный Банк РК	72 000 000 000
21.11.2018	22.11.2018	Национальный Банк РК	94 000 000 000
21.11.2018	21.02.2019	Mizuho	36 828 000 000
22.11.2018	23.11.2018	Национальный Банк РК	111 000 000 000
23.11.2018	26.11.2018	Национальный Банк РК	135 000 000 000
26.11.2018	27.11.2018	Национальный Банк РК	88 000 000 000
28.11.2018	29.11.2018	Национальный Банк РК	290 000 000 000
28.11.2018	28.02.2019	Mizuho	37 273 000 000
29.11.2018	30.11.2018	Национальный Банк РК	40 000 000 000
30.11.2018	04.12.2018	Национальный Банк РК	132 000 000 000
Итого			4 058 988 200 000

Таблица 8. 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
KZW1KD074246	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	01.11.2018	100 000 000 000
US912796QF90	ГЦБ США	Правительство США	02.11.2018	62 380 080 000
KZW1KD074253	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	02.11.2018	89 525 723 300
KZW1KD074287	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	05.11.2018	150 000 000 000
KZW1KD074295	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	06.11.2018	150 000 000 000
KZW1KD284084	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	07.11.2018	100 000 000 000
KZP02Y05C980	Облигации	АО «ДБ «Альфа-Банк»	08.11.2018	3 000 000 000
KZW1KD074329	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	08.11.2018	100 000 000 000
KZW1KD074337	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	09.11.2018	100 000 000 000
US912796PD51	ГЦБ США	Правительство США	09.11.2018	63 350 500 000
KZW1KD074345	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	12.11.2018	150 000 000 000
KZW1KD074352	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	13.11.2018	150 000 000 000
KZP02Y10C725	Облигации	АО «Народный Банк Казахстана»	14.11.2018	9 135 500 000
KZW1KD074378	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	14.11.2018	49 949 986 500
KZW1KD284142	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	14.11.2018	80 000 000 000
US912796QJ13	ГЦБ США	Правительство США	16.11.2018	62 400 200 000

KZW1KD074444	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	21.11.2018	130 613 096 700
KZW1KD074469	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	22.11.2018	150 000 000 000
KZW1KD074477	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	23.11.2018	130 061 840 800
US912796QK85	ГЦБ США	Правительство США	26.11.2018	55 654 500 000
KZW1KD074493	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	26.11.2018	150 000 000 000
KZW1KD074519	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	28.11.2018	119 031 530 200
KZW1KD284316	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	28.11.2018	150 000 000 000
KZW1KD074535	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	29.11.2018	150 000 000 000
KZW1KD074543	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	30.11.2018	112 260 973 000
Итого				2 567 363 930 500

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

Дата операции	Дата погашения	Наименование банка	Сумма сделки в тенге
01.11.2018	01.11.2018	Национальный Банк РК	185 000 000 000
02.11.2018	02.11.2018	Национальный Банк РК	192 000 000 000
05.11.2018	05.11.2018	Национальный Банк РК	183 000 000 000
06.11.2018	06.11.2018	Национальный Банк РК	185 000 000 000
06.11.2018	06.11.2018	ДО АО Банк ВТБ (Казахстан)	450 000 000
07.11.2018	07.11.2018	АО «AsiaCredit Bank»	5 722 000
07.11.2018	07.11.2018	АО «AsiaCredit Bank»	450 000 000
07.11.2018	07.11.2018	Национальный Банк РК	157 000 000 000
08.11.2018	08.11.2018	Национальный Банк РК	94 000 000 000
09.11.2018	09.11.2018	Национальный Банк РК	203 000 000 000
12.11.2018	12.11.2018	Национальный Банк РК	285 000 000 000
13.11.2018	13.11.2018	Национальный Банк РК	400 000 000 000
14.11.2018	14.11.2018	Национальный Банк РК	445 000 000 000
14.11.2018	29.12.2019	АО «ДБ «Альфа-Банк»	40 388 889
15.11.2018	15.11.2018	Национальный Банк РК	400 000 000 000
16.11.2018	16.11.2018	Национальный Банк РК	295 000 000 000
19.11.2018	19.11.2018	Национальный Банк РК	150 000 000 000
20.11.2018	20.11.2018	Национальный Банк РК	30 000 000 000
21.11.2018	21.11.2018	Национальный Банк РК	72 000 000 000
22.11.2018	22.11.2018	Национальный Банк РК	94 000 000 000
23.11.2018	23.11.2018	Национальный Банк РК	111 000 000 000
26.11.2018	26.11.2018	Национальный Банк РК	135 000 000 000
26.11.2018	26.11.2018	АО «Capital Bank Kazakhstan»	1 909 000 000
27.11.2018	27.11.2018	Национальный Банк РК	88 000 000 000
28.11.2018	28.11.2018	ДО АО Банк ВТБ (Казахстан)	50 000 000
28.11.2018	28.11.2018	Bank of Tokyo-Mitsubishi	37 273 000 000
29.11.2018	29.11.2018	Национальный Банк РК	290 000 000 000
30.11.2018	30.11.2018	Национальный Банк РК	40 000 000 000
Итого			4 074 178 110 889