

Информация по инвестиционному управлению пенсионными активами АО «ЕНПФ»

По состоянию на 1 декабря 2017 года пенсионные активы (далее – ПА) ЕНПФ, находящиеся в доверительном управлении Национального Банка Республики Казахстан (далее – НБРК), составили 7 671,74 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 01.01.2017 г.	Доля на 01.01.2017 г.	Текущая стоимость на 01.12.2017 г.	Доля на 01.12.2017 г.	Прирост/снижение с начала года
ГЦБ РК	2 910,82	43,57%	3 420,50	44,59%	17,51%
ГЦБ иностранных государств	365,01	5,46%	900,92	11,74%	146,82%
МФО	86,63	1,30%	156,60	2,04%	80,76%
Корпоративные облигации эмитентов РК	84,03	1,26%	59,64	0,78%	-29,03%
Облигации квазигосударственных организаций РК	900,17	13,48%	797,81	10,40%	-11,37%
Облигации БВУ РК	1 450,20	21,71%	1 259,13	16,41%	-13,18%
Корпоративные облигации иностранных эмитентов	137,92	2,07%	62,25	0,81%	-54,86%
PPN (структурные ноты)	31,64	0,47%	34,66	0,45%	9,54%
Акции и депозитарные расписки эмитентов РК	127,46	1,91%	179,17	2,34%	40,57%
Акции и депозитарные расписки иностранных эмитентов	18,33	0,27%	23,64	0,31%	29,02%
Депозиты	399,91	5,99%	328,49	4,28%	-17,86%
Депозиты в иностранных банках	-	-	395,04	5,15%	-
РЕПО	-	-	42,11	0,55%	-
Денежные средства на инвестиционных счетах (за вычетом обязательств по сделкам с финансовыми инструментами)	151,84	2,27%	0,50	0,01%	-99,67%
Прочие активы (дебиторская задолженность ² , просроченная задолженность, провизии)	16,18	0,24%	11,27	0,15%	-30,33%
Итого ПА, находящиеся в управлении НБРК	6 680,14	100,00%	7 671,74	100,00%	14,84%
Деньги на счетах пенсионных взносов и выплата, а также средства для расчетов с финансовыми инструментами	9,52		4,70		
Итого пенсионные активы	6 689,66		7 676,44		14,75

По состоянию на 01.12.2017 года средневзвешенная доходность к погашению (УТМ) долговых финансовых инструментов, находящихся в инвестиционном портфеле ПА ЕНПФ, составила 7,5% годовых, в том числе по номинированным в тенге – 9,0% годовых, в иностранной валюте – 3,2% годовых.

Государственные ценные бумаги Республики Казахстан

Основную долю в портфеле ПА ЕНПФ занимают ГЦБ РК, текущая стоимость которых за отчетный месяц увеличилась на 123,86 млрд. тенге и составила 3 420,50 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 44,59%.

¹ без учета денег на счетах пенсионных взносов и выплат, а также средств для расчетов по сделкам с ФИ.

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.

В отчетном периоде были приобретены следующие финансовые инструменты по номинальной стоимости:

- краткосрочные дисконтные ноты НБРК в объеме 1 297,77 млрд. тенге со средневзвешенной доходностью 9,3% годовых;
- ГЦБ Министерства финансов РК, номинированные в тенге, в объеме 63,88 млрд. тенге со средневзвешенной доходностью 8,96% годовых;
- ГЦБ Министерства финансов РК, номинированные в долларах США, в объеме 23,49 млрд. тенге со средневзвешенной доходностью 4,38% годовых.

В отчетном периоде произошло погашение дисконтных нот НБРК на сумму 1 267,48 млрд. тенге.

На отчетную дату средневзвешенная доходность к погашению по ГЦБ РК, номинированным в тенге, составила 8,1% годовых, в долларах США – 4,3% годовых.

Государственные ценные бумаги иностранных государств

Текущая стоимость государственных ценных бумаг иностранных государств за отчетный месяц увеличилась на 109,29 млрд. тенге и составила 900,92 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 11,74%.

В рамках нового стратегического распределения валютной части портфеля ПА, предусмотренного Инвестиционной декларацией ЕНПФ, начато инвестирование в ГЦБ развивающихся стран с рейтингом не ниже «ВВ».

В отчетном периоде были приобретены следующие финансовые инструменты по номинальной стоимости:

- краткосрочные государственные ценные бумаги США в объеме 103,78 млрд. тенге со средневзвешенной доходностью 1,3% годовых;
- государственные ценные бумаги Российской Федерации, номинированные в долларах США, в объеме 45,99 млрд. тенге со средневзвешенной доходностью 4,9% годовых;
- государственные ценные бумаги Правительства Республики Бразилии, номинированные в долларах США, в объеме 26,58 млрд. тенге со средневзвешенной доходностью 5,1% годовых.

В рассматриваемом периоде осуществлена продажа краткосрочных облигаций Казначейства США на сумму 46,20 млрд. тенге.

В рассматриваемом периоде произошло погашение государственных ценных бумаг иностранных государств, номинированных в долларах США, на сумму 17,28 млрд. тенге.

Средневзвешенная доходность к погашению ГЦБ иностранных государств в портфеле ПА ЕНПФ на отчетную дату составила 2,6% годовых.

Облигации Международных финансовых организаций

Текущая стоимость облигаций Международных финансовых организаций за отчетный месяц увеличилась на 0,74 млрд. тенге и составила 156,60 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 2,04%.

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

Средневзвешенная доходность к погашению облигаций Международных финансовых организаций в портфеле ПА ЕНПФ на отчетную дату составила 7,4% годовых.

Депозиты в банках второго уровня Республики Казахстан

Текущая стоимость вкладов в БВУ РК, имеющих средневзвешенный срок погашения 5,6 лет, за отчетный месяц увеличилась на 0,83 млрд. тенге и составила 328,49 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 4,28%.

В отчетном периоде в портфеле ПА ЕНПФ размещений и погашений вкладов БВУ не было.

Средневзвешенная доходность к погашению вкладов БВУ РК на отчетную дату составила 10,7% годовых.

Депозиты в иностранных банках

Текущая стоимость вкладов в иностранных банках, имеющих средневзвешенный срок погашения 1,02 месяца, за отчетный месяц уменьшилась на 46,23 млрд. тенге и составила 395,04 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 5,15%.

Средневзвешенная доходность к погашению вкладов в иностранных банках на отчетную дату составила 1,4% годовых.

Корпоративные облигации эмитентов Республики Казахстан

Текущая стоимость корпоративных облигаций эмитентов РК за отчетный месяц уменьшилась на 0,21 млрд. тенге и составила 59,64 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 0,78%.

В рассматриваемом периоде произошло погашение основного долга по корпоративным облигациям эмитентов РК на сумму 0,62 млрд. тенге.

В портфеле ПА ЕНПФ 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 12,9% годовых.

Облигации квазигосударственных организаций Республики Казахстан

Текущая стоимость облигаций квазигосударственных организаций РК за отчетный месяц уменьшилась на 54,50 млрд. тенге и составила 797,81 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 10,40%.

В отчетном периоде в портфеле ПА ЕНПФ произошло погашение основного долга по облигациям квазигосударственных организаций РК на сумму 50,49 млрд. тенге.

В рассматриваемом периоде в портфеле ПА ЕНПФ продаж и покупок облигаций квазигосударственных организаций РК не было.

На отчетную дату средневзвешенная доходность к погашению по облигациям квазигосударственных организаций РК, номинированным в тенге, составила 11,7% годовых, в долларах США – 5,3% годовых.

Облигации банков второго уровня Республики Казахстан

Текущая стоимость облигаций БВУ РК за отчетный месяц уменьшилась на 2,36 млрд. тенге и составила 1 259,13 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 16,41%.

В рассматриваемом периоде в портфеле ПА ЕНПФ продаж, погашений и покупок облигаций БВУ РК не было.

На отчетную дату средневзвешенная доходность к погашению по облигациям БВУ РК, номинированным в тенге, составила 10,0% годовых, в долларах США – 7,0% годовых.

Корпоративные облигации иностранных эмитентов

Текущая стоимость корпоративных облигаций иностранных эмитентов за отчетный месяц уменьшилась на 0,65 млрд. тенге и составила 62,25 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 0,81%.

В отчетном периоде в портфеле ПА ЕНПФ 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 5,8% годовых.

PPN (структурные ноты) иностранных эмитентов

Текущая стоимость PPN (структурных нот) иностранных эмитентов за отчетный месяц увеличилась на 3,48 млрд. тенге и составила 34,66 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 0,45%.

В отчетном периоде в портфеле ПА ЕНПФ покупок, продаж и погашений PPN (структурных нот) иностранных эмитентов не было.

Акции и депозитарные расписки эмитентов Республики Казахстан

Текущая стоимость акций и депозитарных расписок эмитентов РК за отчетный месяц увеличилась на 9,96 млрд. тенге и составила 179,17 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 2,34%.

В отчетном периоде в портфеле ПА ЕНПФ покупок, а также 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 1,46 млрд. тенге и составила 23,64 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 0,31%.

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

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 01.01.2017 г.	Доля на 01.01.2017 г.	Текущая стоимость на 01.12.2017 г.	Доля на 01.12.2017 г.	Прирост/снижение с начала года
Национальная валюта	5 142,38	76,98%	5 534,55	72,14%	7,63%
Доллары США	1 492,44	22,34%	2 093,31	27,29%	40,26%
Российские рубли	35,12	0,53%	35,98	0,47%	2,47%
Другие валюты	10,20	0,15%	7,89	0,10%	-22,66%
Итого:	6 680,14	100,00%	7 671,74	100,00%	14,84%

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 11 месяцев 2017 года составил 540,43 млрд. тенге. Доходность пенсионных активов ЕНПФ, распределенная на счета вкладчиков (получателей) за период с 1 января по 30 ноября 2017 года, составила 7,15%, что в годовом выражении составляет 7,80% годовых.

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 с начала 2017 года
Доходы в виде вознаграждения по ценным бумагам, в том числе по размещенным вкладам и операциям «обратное РЕПО»	475,00
Доходы (убытки) от рыночной переоценки ценных бумаг	43,50
Доходы (убытки) от переоценки иностранной валюты	17,31
Прочие доходы (убытки)	4,62
Итого:	540,43

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 01.12.2017г. 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:	20,51%	да
1.1	Государственные, агентские и ценные бумаги международных финансовых организаций (МФО):	13,78%	да
1)	с рейтингом не ниже «BBB-» по международной шкале агентства «Standard & Poor's» или рейтингом аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств	9,71%	да
2)	с рейтингом от «BB+» до «BB-» по международной шкале агентства «Standard & Poor's» или рейтингом аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств	4,08%	да
1.2	Корпоративные долговые ценные бумаги:	0,81%	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	0,08%	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	0,73%	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	0,31%	да
1.5	Депозиты (вклады) в иностранных банках, имеющих рейтинговую оценку не ниже «A-» по международной шкале агентства «Standard & Poor's» или рейтинговую оценку аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств	5,15%	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	0,45%	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:	78,06%	да
2.1	Государственные ценные бумаги Республики Казахстан, выпущенные Министерством финансов Республики Казахстан, Национальным Банком Республики Казахстан	44,59%	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	0,00%	да
2.2	Ценные бумаги субъектов квазигосударственного сектора	11,46%	да
2.3	Финансовые инструменты банков второго уровня Республики Казахстан	21,69%	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	0,08%	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	0,24%	да

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

2.6	Инструменты исламского финансирования, включенные в официальный список Казахской 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
01.11.2017	08.11.2017	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD070921	21 574 261 100
01.11.2017	29.11.2017	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD280934	41 950 747 100
02.11.2017	10.11.2017	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD070947	45 800 000 000
03.11.2017	10.11.2017	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD070954	14 100 000 000
03.11.2017	22.03.2018	ГЦБ США	Правительство США	US912796NX34	50 449 100 000
06.11.2017	13.11.2017	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD070970	55 846 473 200
06.11.2017	14.10.2024	ГЦБ РК	Правительство РК	XS1120709669	669 040 000
07.11.2017	14.11.2017	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD070988	50 867 118 700
08.11.2017	15.11.2017	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD070996	26 141 495 700
08.11.2017	06.12.2017	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD281007	52 494 729 400
08.11.2017	23.06.2027	ГЦБ РФ	Правительство РФ	RU000A0JXTS9	2 336 320 000
09.11.2017	16.11.2017	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD071010	53 742 626 900
09.11.2017	04.04.2042	ГЦБ РФ	Правительство РФ	XS0767473852	3 662 890 000
09.11.2017	29.08.2023	ГЦБ РК	Правительство РК	KZKDKY090113	3 883 495 000
09.11.2017	04.04.2042	ГЦБ РФ	Правительство РФ	XS0767473852	1 664 950 000
09.11.2017	13.01.2028	ГЦБ Бразилии	Правительство Республики Бразилии	US105756BZ27	3 329 900 000
09.11.2017	23.06.2047	ГЦБ РФ	Правительство РФ	RU000A0JXU14	3 662 890 000
10.11.2017	17.11.2017	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD071028	13 744 718 200
10.11.2017	09.07.2021	ГЦБ РК	Правительство РК	KZKDKY070842	4 000 000 000
10.11.2017	04.04.2042	ГЦБ РФ	Правительство РФ	XS0767473852	7 649 110 000
10.11.2017	07.01.2041	ГЦБ Бразилии	Правительство Республики Бразилии	US105756BR01	3 325 700 000
13.11.2017	20.11.2017	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD071044	60 338 835 200
13.11.2017	23.01.2022	ГЦБ РК	Правительство РК	KZK2KY050500	10 000 000 000
13.11.2017	04.04.2042	ГЦБ РФ	Правительство РФ	XS0767473852	8 651 240 000
13.11.2017	21.02.2047	ГЦБ Бразилии	Правительство Республики Бразилии	US105756BY51	1 663 700 000
13.11.2017	27.01.2045	ГЦБ Бразилии	Правительство Республики Бразилии	US105756BW95	1 663 700 000
14.11.2017	21.11.2017	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD071051	86 420 042 400
14.11.2017	21.07.2025	ГЦБ РК	Правительство РК	XS1263054519	3 550 617 620
14.11.2017	04.04.2042	ГЦБ РФ	Правительство РФ	XS0767473852	8 188 356 000
14.11.2017	23.06.2047	ГЦБ РФ	Правительство РФ	RU000A0JXU14	1 864 016 000
14.11.2017	07.04.2026	ГЦБ Бразилии	Правительство Республики Бразилии	US105756BX78	3 328 600 000
15.11.2017	13.12.2017	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD281072	116 239 668 000
15.11.2017	23.06.2047	ГЦБ РФ	Правительство РФ	RU000A0JXU14	6 654 400 000
15.11.2017	29.08.2023	ГЦБ РК	Правительство РК	KZKDKY090113	6 000 000 000
15.11.2017	20.01.2037	ГЦБ Бразилии	Правительство Республики Бразилии	US105756BK57	1 663 600 000
16.11.2017	23.11.2017	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD071085	62 257 534 600
16.11.2017	14.10.2044	ГЦБ РК	Правительство РК	XS1120709826	4 320 940 000
16.11.2017	21.07.2045	ГЦБ РК	Правительство РК	XS1263139856	13 627 580 000
16.11.2017	07.01.2041	ГЦБ Бразилии	Правительство Республики Бразилии	US105756BR01	3 323 800 000
17.11.2017	24.11.2017	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD071093	9 014 817 100
17.11.2017	09.07.2021	ГЦБ РК	Правительство РК	KZKDKY070842	4 000 000 000
20.11.2017	27.11.2017	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD071119	57 500 000 000
20.11.2017	23.01.2022	ГЦБ РК	Правительство РК	KZK2KY050500	10 000 000 000
20.11.2017	07.04.2026	ГЦБ Бразилии	Правительство Республики Бразилии	US105756BX78	3 310 000 000
21.11.2017	28.11.2017	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD071127	90 300 000 000
21.11.2017	27.01.2045	ГЦБ Бразилии	Правительство Республики Бразилии	US105756BW95	1 651 450 000

22.11.2017	29.11.2017	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD071135	18 498 788 000
22.11.2017	20.12.2017	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD281148	76 297 080 400
22.11.2017	29.08.2023	ГЦБ РК	Правительство РК	KZKDKY090113	6 000 000 000
23.11.2017	30.11.2017	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD071168	75 256 808 100
24.11.2017	04.12.2017	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD101171	22 700 000 000
24.11.2017	09.07.2021	ГЦБ РК	Правительство РК	KZKDKY070842	4 000 000 000
27.11.2017	04.12.2017	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD071184	56 300 000 000
27.11.2017	23.01.2022	ГЦБ РК	Правительство РК	KZK2KY050500	7 000 000 000
28.11.2017	05.12.2017	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD071192	99 800 000 000
28.11.2017	23.06.2047	ГЦБ РФ	Правительство РФ	RU000A0JXU14	1 657 500 000
28.11.2017	27.01.2045	ГЦБ Бразилии	Правительство Республики Бразилии	US105756BW95	1 657 500 000
29.11.2017	27.12.2017	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD281213	56 400 000 000
29.11.2017	29.08.2023	ГЦБ РК	Правительство РК	KZKDKY090113	7 000 000 000
29.11.2017	07.01.2025	ГЦБ Бразилии	Правительство Республики Бразилии	US105756BV13	1 658 050 000
30.11.2017	07.12.2017	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD071226	34 182 605 100
30.11.2017	06.03.2027	ГЦБ РК	Правительство РК	KZKDKY100177	2 000 000 000
30.11.2017	14.10.2024	ГЦБ РК	Правительство РК	XS1120709669	1 324 880 000
30.11.2017	31.05.2018	ГЦБ США	Правительство США	US912796PH65	53 326 420 000
Итого					1 561 488 093 820

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
07.11.2017	16.11.2017	ГЦБ США	Правительство США	US912796MC06	332 826 762,
09.11.2017	16.11.2017	ГЦБ США	Правительство США	US912796MC06	9 988 068 382
10.11.2017	16.11.2017	ГЦБ США	Правительство США	US912796MC06	13 966 799 285
13.11.2017	16.11.2017	ГЦБ США	Правительство США	US912796MC06	3 327 216 993
14.11.2017	14.12.2017	ГЦБ США	Правительство США	US912796MG10	11 640 668 272
15.11.2017	14.12.2017	ГЦБ США	Правительство США	US912796MG10	1 662 255 625
21.11.2017	14.12.2017	ГЦБ США	Правительство США	US912796MG10	3 630 872 025
22.11.2017	14.12.2017	ГЦБ США	Правительство США	US912796MG10	1 650 146 031
Итого					46 198 853 375

Таблица 8. Сведения по размещениям во вклады иностранных банков в отчетном месяце

Дата сделки	Дата погашения	Эмитент ценной бумаги	Сумма сделки в тенге
03.11.2017	31.01.2018	ING Bank N.V.	25 057 500 000
03.11.2017	31.01.2018	Societe Generale Paris	25 057 500 000
17.11.2017	15.02.2018	Credit Agricole CIB	32 888 790 000
Итого			83 003 790 000

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
KZW1KD280645	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	01.11.2017	81 676 276 900
KZW1KD070871	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	02.11.2017	17 000 000 000
KZW1KD070889	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	03.11.2017	12 391 458 800
KZW1KD070905	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	06.11.2017	56 600 000 000
KZW1KD070913	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	07.11.2017	51 000 000 000
KZW1KD280702	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	08.11.2017	68 853 556 200
KZW1KD070921	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	08.11.2017	21 574 261 100
KZW1KD070947	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	09.11.2017	45 800 000 000
KZW1KD070954	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	10.11.2017	14 100 000 000
KZW1KD070970	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	13.11.2017	55 846 473 200
KZW1KD070988	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	14.11.2017	50 867 118 700
KZW1KD070996	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	15.11.2017	26 141 495 700
KZW1KD280777	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	15.11.2017	82 391 033 100
US912796MC06	ГЦБ США	Правительство США	16.11.2017	17 283 760 000
KZW1KD071010	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	16.11.2017	53 742 626 900
KZW1KD071028	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	17.11.2017	13 744 718 200
KZW1KD071044	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	20.11.2017	60 338 835 200
KZW1KD071051	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	21.11.2017	86 420 042 400
KZW1KD280850	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	22.11.2017	114 217 146 900
KZW1KD071085	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	23.11.2017	62 257 534 600

KZW1KD071093	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	24.11.2017	9 014 817 100
KZW1KD071119	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	27.11.2017	57 500 000 000
KZW1KD071127	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	28.11.2017	90 300 000 000
KZW1KD280934	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	29.11.2017	41 950 747 100
KZW1KD071135	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	29.11.2017	18 498 788 000
KZW1KD071168	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	30.11.2017	75 256 808 100
KZP01Y05E319	Облигации	АО «Central Asia Cement»	15.11.2017	624 999 000
KZ2C0Y07D899	Облигации	АО «Национальная компания «КазМунайГаз»	13.11.2017	50 485 656 000
Итого				1 335 878 153 200

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

Дата выплаты	Дата закрытия	Эмитент ценной бумаги	Сумма к погашению в тенге
17.11.2017	17.11.2017	Credit Agricole CIB	66 442 000 000
30.11.2017	30.11.2017	Bank of Tokyo-Mitsubishi, LTD.	57 963 500 000
Итого			124 405 500 000