

## «БЖЗҚ» АҚ ЗЕЙНЕТАҚЫ АКТИВТЕРІН ИНВЕСТИЦИЯЛЫҚ БАСҚАРУ БОЙЫНША АҚПАРАТ

2017 жылғы 1 шілдедегі жағдай бойынша Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкінің басқаруындағы (бұдан әрі – ҚРҰБ) БЖЗҚ зейнетақы активтері (бұдан әрі – ЗА) 7 138,97 млрд. теңгені құрады<sup>1</sup>.

БЖЗҚ зейнетақы активтерінің есебінен құрылған қаржы құралдарының инвестициялық портфелінің құрылымы 1-кестеде көрсетілген.

**1-кесте. Қаржы құралдарының бөлігінде ҚРҰБ басқаруындағы БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфелінің құрылымы**

Атауы	01.01.2017 жылға ағымдағы құны	01.01.2017 жылға үлесі	01.07.2017 жылға ағымдағы құны	01.07.2017 жылға үлесі	млрд. теңге Жыл басынан өсуі/төмендеуі %
ҚР МБҚ	2 910,82	43,57%	3 028,74	42,43%	4,05%
Шетелдік мемлекеттердің МБҚ	365,01	5,46%	426,14	5,97%	16,75%
ХҚҰ	86,63	1,30%	80,39	1,13%	-7,21%
ҚР эмитенттерінің корпоративтік облигациялары	84,03	1,26%	73,33	1,03%	-12,74%
ҚР квазимемлекеттік ұйымдардың облигациялары	900,17	13,48%	808,13	11,32%	-10,22%
ҚР ЕДБ облигациялары	1 450,20	21,71%	1 365,84	19,13%	-5,82%
Шетелдік эмитенттердің корпоративтік облигациялары	137,92	2,07%	128,34	1,80%	-6,95%
PPN (құрылымдық ноталар)	31,64	0,47%	30,28	0,42%	-4,28%
ҚР эмитенттерінің акциялары және депозитарлық қолхаттары	127,46	1,91%	144,82	2,03%	13,63%
Шетелдік эмитенттердің акциялары және депозитарлық қолхаттары	18,33	0,27%	16,98	0,24%	-7,35%
Депозиттер	399,91	5,99%	334,27	4,68%	-16,41%
Шетелдік банктердегі депозиттер	-	-	274,56	3,85%	-
РЕПО	-	-	1,50	0,02%	-
Инвестициялық шоттардағы ақшалай қаражаттар	151,84	2,27%	410,04	5,74%	170,05%
Басқа активтер (дебиторлық берешек <sup>2</sup> , мерзімі өткен берешек, провизиялар)	16,18	0,24%	15,60	0,22%	-3,59%
<b>ҚРҰБ басқаруындағы ЗА жиынтығы</b>	<b>6 680,14</b>	<b>100,00%</b>	<b>7 138,97</b>	<b>100,00%</b>	<b>6,87%</b>
Зейнетақы жарналары және төлемдері шоттарындағы ақшалар	9,52		2,15		
<b>Зейнетақы активтерінің жиыны</b>	<b>6 689,66</b>		<b>7 141,12</b>		<b>6,75%</b>

БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфеліндегі борыштық қаржы құралдарын өтеуге орташа алынған кірістілік (YTM) 01.07.2017 жылғы жағдай бойынша жылына 8,1% құрады.

### Қазақстан Республикасының мемлекеттік бағалы қағаздары

БЖЗҚ ЗА портфелінде негізгі үлесті ҚР МБҚ құрайды, олардың есепті айдағы ағымдағы құны 126,55 млрд. теңгеге көбейді және 3 028,74 млрд. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 42,43% құрады.

<sup>1</sup> Зейнетақы жарналары мен төлемдері шоттарындағы ақшалар есебінсіз.

<sup>2</sup> Дебиторлық берешекке қаржы құралдары шығарылымы проспектісінің талаптарына сәйкес Эмитент тарапынан берешекті өтеу күні келіп жеткен сыйақы және/немесе негізгі борыш бойынша алынатын сома енеді.

Есепті кезеңде орташа алынған кірістілігі жылына 9,9% құрайтын номиналды құны бойынша 1 306,51 млрд. теңге көлемінде ҚРҰБ қысқа мерзімді дисконтты ноттары сатып алынды.

Есепті күнге 1 183,20 млрд.теңге сомасына ҚРҰБ дисконтты ноттары, сондай-ақ 12,00 млрд.теңге көлемінде ҚР Қаржы министрлігінің облигациялары өтелді.

Есепті кезеңде БЖЗҚ ЗА портфелінде ҚР МБҚ өтеуге орташа алынған кірістілік жылына 7,9 % құрады.

### **Шетелдік мемлекеттердің мемлекеттік бағалы қағаздары**

Есепті айға шетелдік мемлекеттердің мемлекеттік бағалы қағаздарының ағымдағы құны 213,70 млрд. теңгеге азайды және 426,14 млрд. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 5,97% құрады.

Есепті кезеңде орташа алынған кірістілік жылына 1,0% құрайтын номиналды құны 88,38 млрд.теңге көлемінде АҚШ Қазынашылығының қысқа мерзімді облигациялары, орташа алынған кірістілік жылына 8,0% құрайтын номиналды құны 3,50 млрд. теңге көлемінде РФ Үкіметінің бағалы қағаздары сатып алынды, сондай-ақ орташа алынған кірістілік жылына 0,8% құрайтын номиналды құны 177,25 млрд.теңге көлемінде АҚШ Қазынашылығының қысқа мерзімді облигациялары сатылды.

Есепті күнге 150,10 млрд.теңге көлемінде АҚШ долларына номиналданған шетелдік мемлекеттердің қысқа мерзімді облигациялары өтелді.

Есепті кезеңде БЖЗҚ ЗА портфеліндегі шетелдік мемлекеттердің МБҚ өтеуге орташа алынған кірістілік жылына 2,4% құрады.

### **Халықаралық қаржы ұйымдарының облигациялары**

Есепті айда Халықаралық қаржы ұйымдары облигацияларының ағымдағы құны 3,50 млрд. теңгеге кеміді және 80,39 млрд. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 1,13% құрады.

Есепті күнге 3,53 млрд. теңге көлемінде ресей рубліне номиналданған Халықаралық қаржы ұйымдарының бағалы қағаздары өтелді.

Есепті кезеңде Халықаралық қаржы ұйымдарының бағалы қағаздары сатып алынған және сатылған жоқ.

Есепті кезеңде БЖЗҚ ЗА портфелінде Халықаралық қаржы ұйымдарының облигацияларын өтеуге орташа алынған кірістілік жылына 7,2% құрады.

### **Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банктеріндегі депозиттер**

Есепті айда ҚР ЕДБ салымдардың ағымдағы құны 8,01 млрд. теңгеге азайды және 334,27 млрд. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 4,68% құрады.

Есепті кезеңде БЖЗҚ ЗА портфелінде жылына 8,00% орташа алынған сыйақы мөлшерлемесімен жалпы көлемі 3,18 млрд. көлемімен ЕДБ салымдары орналастырылды. Бұл ретте БЖЗҚ ЗА портфелінде шамамен 64,59 млрд.теңге сомасына ҚР ЕДБ салымдарының негізгі борышы өтелді.

Есепті кезеңде ҚР ЕДБ салымдарын өтеуге орташа алынған кірістілік жылына 10,7% құрады.

### **Шетелдік банктердегі депозиттер**

Ағымдағы айда шетелдік банктердегі салымдардың ағымдағы құны 41,33 млрд. теңгеге кеміді және 274,56 млрд. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 3,85% құрады.

Есепті кезеңде шетелдік банктердегі салымдарды өтеуге орташа алынған кірістілік жылына 1,2% құрады

### **Қазақстан Республикасы эмитенттерінің корпоративтік облигациялары**

Есепті айда ҚР эмитенттерінің корпоративтік облигацияларының ағымдағы құны 10,68 млрд. теңгеге кеміді және 73,33 млрд. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 1,03% құрады.

Есепті кезеңде БЖЗҚ ЗА портфелінде ҚР эмитенттерінің корпоративтік облигацияларын сатып алу және сату болған жоқ.

Есепті кезеңде БЖЗҚ ЗА портфелінде ҚР эмитенттерінің корпоративтік облигацияларын өтеуге орташа алынған кірістілік жылына 13,3 % құрады.

#### **Қазақстан Республикасы квазимемлекеттік ұйымдардың облигациялары**

Есепті айда ҚР квазимемлекеттік ұйымдардың облигацияларының ағымдағы құны 77,76 млрд. теңгеге кеміді және 808,13 млрд. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 11,32% құрады.

Есепті күнге орташа алынған кірістілік жылына 10,5 % құрайтын номиналды құны бойынша 14,85 млрд. теңге көлемінде ҚР квазимемлекеттік ұйымдардың облигациялары сатып алынды.

Есепті күнге номиналды құны бойынша 85,00 млрд. теңге көлемінде ҚР квазимемлекеттік ұйымдарының бағалы қағаздары өтелді.

Есепті кезеңде БЖЗҚ ЗА портфелінде ҚР квазимемлекеттік ұйымдарының облигацияларын сату болған жоқ.

Есепті кезеңде БЖЗҚ ЗА портфелінде ҚР квазимемлекеттік ұйымдардың облигацияларын өтеуге орташа алынған кірістілік жылына 9,5 % құрады.

#### **Қазақстан Республикасы екінші деңгейдегі банктерінің облигациялары**

Есепті айда ҚР ЕДБ облигацияларының ағымдағы құны 1,69 млрд. теңгеге артты және 1 365,84 млрд. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 19,13 % құрады.

Есепті кезеңде БЖЗҚ ЗА портфелінде 20,92 млрд. теңге көлемінде АҚШ долларына номиналданған ҚР ЕДБ облигацияларының негізгі борышы өтелді.

Есепті күнге орташа алынған кірістілік жылына 12,5% құрайтын номиналды құны бойынша 12,99 млрд. теңге көлемінде ҚР ЕДБ облигациялары сатып алынды. ҚР ЕДБ облигациялары сатылған жоқ.

Есепті кезеңде БЖЗҚ ЗА портфелінде ҚР ЕДБ облигацияларын өтеуге орташа алынған кірістілік жылына 9,8% құрады.

#### **Шетелдік эмитенттердің корпоративтік облигациялары**

Есепті айда шетелдік эмитенттердің корпоративтік облигацияларының ағымдағы құны 4,85 млрд. теңгеге артты және 128,34 млрд. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 1,80% құрады.

Есепті кезеңде БЖЗҚ ЗА портфелінде шетелдік эмитенттердің облигацияларын сатып алу, сату және өтеу болған жоқ.

Есепті кезеңде БЖЗҚ ЗА портфелінде шетелдік эмитенттердің корпоративтік облигацияларын өтеуге орташа алынған кірістілік жылына 9,1 % құрады.

#### **Шетелдік эмитенттердің PPN (құрылымдық ноттар)**

Есепті айда шетелдік эмитенттердің PPN (құрылымдық ноттар) ағымдағы құны 0,73 млрд. теңгеге кеміді және 30,28 млрд. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 0,42% құрады.

Есепті кезеңде БЖЗҚ ЗА портфелінде шетелдік эмитенттердің PPN (құрылымдық ноттар) сатып алу, сату және өтеу болған жоқ.

#### **Қазақстан Республикасы эмитенттерінің акциялары және депозитарлық қолхаттары**

Есепті айда ҚР эмитенттері акцияларының және депозитарлық қолхаттарының ағымдағы құны 2,69 млрд. теңгеге көбейді және 144,82 млрд. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 2,03 % құрады.

Есепті кезеңде БЖЗҚ ЗА портфелінде ҚР эмитенттерінің акциялары мен депозитарлық қолхаттарын сатып алу және сату болған жоқ.

## Шетелдік эмитенттердің акциялары және депозитарлық қолхаттары

Есепті айда шетелдік эмитенттердің акциялары мен депозитарлық қолхаттарының ағымдағы құны 0,73 млрд. теңгеге кеміді және 16,98 млрд. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 0,24% құрады.

Есепті кезеңде шетелдік эмитенттердің акциялары мен депозитарлық қолхаттарын сатып алу және сату болған жоқ.

БЖЗҚ зейнетақы активтерінің есебінен сатып алынған қаржы құралдары номиналданған валюталар бөлігінде қаржы құралдарының инвестициялық портфелі 2-кестеде келтірілген.

### 2-кесте. Валюталар бөлігінде ҚРҰБ басқаруындағы БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфелінің құрылымы

Валюта	млрд. теңге				
	01.01.2017 жылға ағымдағы құны	01.01.2017 жылға үлесі	01.07.2017 жылға ағымдағы құны	01.07.2017 жылға үлесі	Жыл басынан өсуі/төмендеуі, %
Ұлттық валюта	5 142,38	76,98%	5 195,62	72,78%	1,04%
АҚШ доллары	1 492,44	22,34%	1 898,73	26,60%	27,22%
Ресей рублі	35,12	0,53%	33,96	0,48%	-3,28%
Басқа валюталар	10,20	0,15%	10,65	0,15%	4,41%
<b>Жиыны:</b>	<b>6 680,14</b>	<b>100,00%</b>	<b>7 138,97</b>	<b>100,00%</b>	<b>6,87%</b>

## Инвестициялық қызметтің нәтижелері

Инвестициялық қызметтің нәтижесінде, сондай-ақ шетелдік валюталар бағамының құбылмалығы салдарынан, сонымен қатар қаржы құралдарының нарықтық құнының өзгеруі нәтижесінде 2017 жылғы 6 айда есептелген инвестициялық табыс көлемі 221,97 млрд. теңгені құрады. Осылайша, салымшылардың (алушылардың) шоттарына бөлінген БЖЗҚ зейнетақы активтерінің табыстылығы 2017 жылғы 1 қаңтардан 31 маусымға дейінгі кезең үшін 3,01 % құрады.

Көрсетілген кезеңге есептелген инвестициялық табыс құрылымы 3-кестеде көрсетілген.

### 3-кесте. ҚРҰБ басқаруындағы БЖЗҚ ЗА бойынша алынған инвестициялық табыс құрылымы

Атауы	млрд. теңге
	2017 жылдың басынан инвестициялық табыс
Бағалы қағаздар, орналастырылған салымдар және «кері РЕПО» операциялары бойынша сыйақы түріндегі табыстар	256,3
Бағалы қағаздарды нарықтық қайта бағалаудан табыстар (шығындар)	0,05
Шетелдік валютаны қайта бағалаудан табыстар (шығындар)	-35,97
Басқа табыстар (шығындар)	1,59
<b>Жиыны:</b>	<b>221,97</b>

## Инвестициялық декларация параметрлерін сақтау туралы ақпарат

Сенімгерлік басқарудағы БЖЗҚ ЗА құрылымдық үйлестіруі БЖЗҚ Инвестициялық декларациясының талаптарына сәйкес келеді<sup>3</sup>. Валюталық позициялар үлесі рұқсат етілген деңгей шегінде қалады және БЖЗҚ Инвестициялық декларациясының талаптарын бұзбайды, 01.07.2017 жылғы жағдай бойынша деректер 4-кестеде көрсетілген.

<sup>3</sup> БЖЗҚ Инвестициялық декларациясы Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкінің 2016 жылғы 17 наурыздағы №86 қаулысымен бекітілген

**4-кесте. БЖЗҚ ЗА инвестициялау лимиттері**

№ р/р	Қаржы құралдарының түрі	Нақты мәні (зейнетақы активтерінен пайызбен)	Орындалуы (иә/жоқ)
<b>1</b>	<b>Шетелдік эмитенттер:</b>	<b>12,45%</b>	<b>иә</b>
1.1	мемлекеттік, агенттік және халықаралық қаржы ұйымдарының (ХҚҰ) бағалы қағаздары:	7,10%	иә
1)	«Standard&Poor's» агенттігінің халықаралық шәкілі бойынша «BBB-» төмен емес рейтинг бағасы бар немесе басқа рейтинг агенттіктерінің бірінің осыған ұқсас деңгейінің рейтинг бағасы бар;	4,93%	иә
2)	«Standard&Poor's» агенттігінің халықаралық шәкілі бойынша «BB+»-дан «BB-» дейін рейтинг бағасы бар немесе басқа рейтинг агенттіктерінің бірінің осыған ұқсас деңгейінің рейтинг бағасы бар;	2,17%	иә
1.2	Корпоративтік борыштық бағалы қағаздар:	<b>0,85%</b>	<b>иә</b>
1)	«Standard&Poor's» агенттігінің халықаралық шәкілі бойынша «BBB-» төмен емес бағалы қағаздар және/немесе эмитент рейтинг бағасы бар немесе басқа рейтинг агенттіктерінің бірінің осыған ұқсас деңгейінің рейтингтік бағасы бар	0,09%	иә
2)	Standard&Poor's» агенттігінің халықаралық шәкілі бойынша «BB+»-дан «BB-» дейін бағалы қағаздар және/немесе эмитент рейтинг бағасы бар немесе басқа рейтинг агенттіктерінің бірінің осыған ұқсас деңгейінің рейтингтік бағасы бар;	0,76%	иә
1.3	«Standard&Poor's» агенттігінің халықаралық шәкілі бойынша «BBB-» төмен емес бағалы қағаздар және/немесе эмитент рейтинг бағасы бар немесе басқа рейтинг агенттіктерінің бірінің осыған ұқсас деңгейінің рейтингтік бағасы бар жылжымайтын мүлік (MBS) пен активтерге (ABS) салынған бағалы қағаздар	<b>0,00%</b>	<b>иә</b>
1.4	Акциялар, акцияларға депозитарлық қолхаттар	<b>0,24%</b>	<b>иә</b>
1.5	«Standard&Poor's» агенттігінің халықаралық шәкілі бойынша «A-» төмен емес рейтингтік бағасы бар немесе басқа рейтинг агенттіктерінің бірінің осыған ұқсас деңгейінің рейтингтік бағасы бар шетелдік банктердегі депозиттер (салымдар)	3,85%	иә
1.6	«Standard&Poor's» агенттігінің халықаралық шәкілі бойынша «BBB-» төмен емес рейтинг бағасы бар немесе басқа рейтинг агенттіктерінің бірінің осыған ұқсас деңгейінің рейтингтік бағасы бар ұйымдар шығарған құрылымдық өнімдер	<b>0,42%</b>	<b>иә</b>
1.7	Ислам қаржыландыру құралдары:	<b>0,00%</b>	<b>иә</b>
1)	«Standard&Poor's» агенттігінің халықаралық шәкілі бойынша «BBB-» төмен емес бағалы қағаздар және/немесе эмитент рейтинг бағасы бар немесе басқа рейтинг агенттіктерінің бірінің осыған ұқсас деңгейінің рейтингтік бағасы бар;	0,00%	иә
2)	Standard&Poor's» агенттігінің халықаралық шәкілі бойынша «BB+»-дан «BB-» дейін бағалы қағаздар және/немесе эмитент рейтинг бағасы бар немесе басқа рейтинг агенттіктерінің бірінің осыған ұқсас деңгейінің рейтингтік бағасы бар;	0,00%	иә
<b>2</b>	<b>Қазақстандық эмитенттер:</b>	<b>79,63%</b>	<b>иә</b>
2.1	Қазақстан Республикасының мемлекеттік бағалы қағаздары	42,43%	иә
2.2	Квазимемлекеттік сектор субъектілерінің бағалы қағаздары	12,25%	иә
2.3	Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банктерінің қаржы құралдары	24,68%	иә
2.4	«Standard&Poor's» агенттігінің халықаралық шәкілі бойынша «B-» төмен емес бағалы қағаздар және/немесе эмитент рейтинг бағасы бар немесе басқа рейтинг агенттіктерінің бірінің осыған ұқсас деңгейінің рейтингтік бағасы бар Қазақстан Республикасының квазимемлекеттік секторы мен екінші деңгейдегі банктері субъектілерінің борыштық бағалы қағаздарын қоспағанда мемлекеттік емес борыштық бағалы қағаздары	0,09%	иә
2.5	Қазақстан қор биржасының ресми тізімінің бірінші санатына кіретін Қазақстан Республикасының квазимемлекеттік секторы мен екінші деңгейдегі банктері субъектілерінің үлесті бағалы қағаздарын қоспағанда мемлекеттік емес үлесті бағалы қағаздары	0,18%	иә
2.6	Қазақстан қор биржасының ресми тізіміне енгізілген ислам қаржыландыру құралдары	0,06%	иә

**5-кесте. Қаржы құралдарының жекелеген түрлеріне БЖЗҚ зейнетақы активтерін инвестициялау лимиттері**

№ р/р	Қаржы құралдарының түрі	Нақты мәні (зейнетақы активтерінен пайызбен)	Орындалуы (иә/жоқ)
1	Стандартты туынды қаржы құралдары	0,00%	иә
1)	егер туынды қаржы құралдары инвестициялық тәуекелді хеджирлеуге пайдаланылған жағдайда	0,00%	иә
2	Құймадағы және металл шоттардағы алтын	0,00%	иә

**БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфеліндегі қаржы құралдарды сатып алу, сату және өтеу бойынша ақпарат**

**6-кесте. Есепті айда сатып алынған қаржы құралдары жөніндегі мәліметтер**

Мәміле жасалған күн	Өтеу күні	Құрал түрі	Бағалы қағаз эмитенті	ҮСН (ISIN)	Валюта	Теңгемен номиналды құны	Валютадағы номиналды құны
01.06.2017	08.06.2017	НОТТАР	ҚРҰБ	KZW1KD079484	KZT	8 738 247 000	
01.06.2017	08.06.2017	НОТТАР	ҚРҰБ	KZW1KD079484	KZT	40 355 393 300	
02.06.2017	09.06.2017	НОТТАР	ҚРҰБ	KZW1KD079492	KZT	16 924 341 400	
02.06.2017	09.06.2017	НОТТАР	ҚРҰБ	KZW1KD079492	KZT	111 100 000 000	
05.06.2017	02.06.2022	ОБЛ. КОРП.КУПОН	"ЭКСИМБАНК КАЗАХСТАН" АҚ	KZP02Y05E986	KZT	12 986 874 500,00	
06.06.2017	06.06.2024	ОБЛ. КОРП.КУПОН	"Қазақстан Даму Банкі" АҚ	KZP01Y07F510	KZT	14 850 000 000,00	
07.06.2017	14.06.2017	НОТТАР	ҚРҰБ	KZW1KD079526	KZT	2 304 277 600	
07.06.2017	14.06.2017	НОТТАР	ҚРҰБ	KZW1KD079526	KZT	29 500 000 000	
08.06.2017	15.06.2017	НОТТАР	ҚРҰБ	KZW1KD079542	KZT	12 700 000 000	
08.06.2017	15.06.2017	НОТТАР	ҚРҰБ	KZW1KD079542	KZT	50 300 000 000	
09.06.2017	16.06.2017	НОТТАР	ҚРҰБ	KZW1KD079559	KZT	28 100 000 000	
09.06.2017	16.06.2017	НОТТАР	ҚРҰБ	KZW1KD079559	KZT	111 900 000 000	
14.06.2017	21.06.2017	НОТТАР	ҚРҰБ	KZW1KD079591	KZT	3 747 820 400	
14.06.2017	21.06.2017	НОТТАР	ҚРҰБ	KZW1KD079591	KZT	39 900 000 000	
15.06.2017	22.06.2017	НОТТАР	ҚРҰБ	KZW1KD079617	KZT	13 370 923 300	
15.06.2017	22.06.2017	НОТТАР	ҚРҰБ	KZW1KD079617	KZT	55 900 000 000	
16.06.2017	23.06.2017	НОТТАР	ҚРҰБ	KZW1KD079625	KZT	7 618 444 500	
16.06.2017	23.06.2017	НОТТАР	ҚРҰБ	KZW1KD079625	KZT	127 900 000 000	
19.06.2017	15.05.2019	ШЕТЕЛ МЕМ. МБҚ	РФ ҮКІМЕТІ	RU000A0JU9V1	RUB	3 498 850 000	635 000 000
19.06.2017	26.06.2017	НОТТАР	ҚРҰБ	KZW1KD079641	KZT	31 900 000 000	
19.06.2017	26.06.2017	НОТТАР	ҚРҰБ	KZW1KD079641	KZT	8 100 000 000	
19.06.2017	12.10.2017	МБҚ (ШЕТ. МЕМ) ДИСКОНТ	АҚШ Үкіметі	US912796KR92	USD	23 008 320 000	70 000 000
21.06.2017	28.06.2017	НОТТАР	ҚРҰБ	KZW1KD079666	KZT	40 700 000 000	
21.06.2017	28.06.2017	НОТТАР	ҚРҰБ	KZW1KD079666	KZT	3 216 107 300	
22.06.2017	29.06.2017	НОТТАР	ҚРҰБ	KZW1KD079682	KZT	64 300 000 000	
22.06.2017	29.06.2017	НОТТАР	ҚРҰБ	KZW1KD079682	KZT	16 200 000 000	
23.06.2017	30.06.2017	НОТТАР	ҚРҰБ	KZW1KD079690	KZT	112 300 000 000	
23.06.2017	30.06.2017	НОТТАР	ҚРҰБ	KZW1KD079690	KZT	28 200 000 000	
26.06.2017	03.07.2017	НОТТАР	ҚРҰБ	KZW1KD079708	KZT	9 000 000 000	
26.06.2017	03.07.2017	НОТТАР	ҚРҰБ	KZW1KD079708	KZT	35 500 000 000	

27.06.2017	19.10.2017	МБҚ (ШЕТ МЕМ) ДИСКОНТ	АҚШ Үкіметі	US912796LY35	USD	65 368 030 000	203 000 000
28.06.2017	05.07.2017	НОТТАР	ҚРҰБ	KZW1KD079724	KZT	9 237 687 300	
28.06.2017	05.07.2017	НОТТАР	ҚРҰБ	KZW1KD079724	KZT	54 200 000 000	
29.06.2017	10.07.2017	НОТТАР	ҚРҰБ	KZW1KD119744	KZT	71 400 000 000	
29.06.2017	10.07.2017	НОТТАР	ҚРҰБ	KZW1KD119744	KZT	18 000 000 000	
30.06.2017	10.07.2017	НОТТАР	ҚРҰБ	KZW1KD109752	KZT	28 900 000 000	
30.06.2017	10.07.2017	НОТТАР	ҚРҰБ	KZW1KD109752	KZT	115 000 000 000	
<b>Барлығы</b>						<b>1 426 225 316 600</b>	

**7-кесте. Есепті айға қаржы құралдарын сату бойынша мәліметтер**

Мәміле жасалған күн	Өтеу күні	Құрал түрі	Бағалы қағаз эмитенті	ҰСН (ISIN)	Номинал валютасы	Теңгемен номинал құны	Шетелдік валютада номинал құны
30.06.2017	06.07.2017	МБҚ (ШЕТЕЛ МЕМ) ДИСКОНТ	АҚШ Үкіметі	US912796LG29	USD	32 227 000 000	100 000 000
30.06.2017	13.07.2017	МБҚ (ШЕТЕЛ МЕМ) ДИСКОНТ	АҚШ Үкіметі	US912796LK31	USD	42 539 640 000	132 000 000
30.06.2017	03.08.2017	МБҚ (ШЕТЕЛ МЕМ) ДИСКОНТ	АҚШ Үкіметі	US912796LM96	USD	51 563 200 000	160 000 000
30.06.2017	10.08.2017	МБҚ (ШЕТЕЛ МЕМ) ДИСКОНТ	АҚШ Үкіметі	US912796LP28	USD	50 918 660 000	158 000 000
<b>Барлығы</b>						<b>177 248 500 000</b>	

**8-кесте. Есепті айдағы банк салымдарына орналастыру жөніндегі мәліметтер**

Мәміле жасалған күн	Өтеу күні	Бағалы қағаз эмитенті	Номинал валютасы	Мәміле сомасы теңгемен	Мәміле сомасы шетел валютасында
02.06.2017	02.06.2020	«АЛЬФА-БАНК» ЕНШІЛІЕС БАНКІ» АҚ	KZT	3 176 556 855	

**9-кесте. Есепте айдағы бағалы қағаздардың негізгі борышын өтеу жөніндегі мәліметтер**

ҰСН (ISIN)	Құрал түрі	Бағалы қағаз эмитенті	Нақты өтелген күн	Теңгемен өтелетін сома	Номинал валютада өтелетін сома	Номинал валютасы
KZW1KD079419	ҚР ҰБ НОТТАРЫ	ҚР Ұлттық Банкі	01.06.2017	119 000 000 000	-	KZT
KZW1KD079427	ҚР ҰБ НОТТАРЫ	ҚР Ұлттық Банкі	02.06.2017	31 000 000 000	-	KZT
KZW1KD079468	ҚР ҰБ НОТТАРЫ	ҚР Ұлттық Банкі	07.06.2017	67 923 409 600	-	KZT
KZW1KD079484	ҚР ҰБ НОТТАРЫ	ҚР Ұлттық Банкі	08.06.2017	49 093 640 300	-	KZT
KZW1KD079492	ҚР ҰБ НОТТАРЫ	ҚР Ұлттық Банкі	09.06.2017	128 024 341 400	-	KZT
XS0303133564	Еурооблигациялар	Еуропалық инвестициялық банк	13.06.2017	3 531 675 900	636 338 000	RUB
XS0305204595	Еурооблигациялар	"ҚАЗКОММЕРЦБАНК" АҚ	14.06.2017	20 873 503 730	65 999 000	USD
KZW1KD079526	ҚР ҰБ НОТТАРЫ	ҚР Ұлттық Банкі	14.06.2017	31 804 277 600	-	KZT
KZW1KD079542	ҚР ҰБ НОТТАРЫ	ҚР Ұлттық Банкі	15.06.2017	63 000 000 000	-	KZT
KZW1KD079559	ҚР ҰБ НОТТАРЫ	ҚР Ұлттық Банкі	16.06.2017	140 000 000 000	-	KZT
XS1153772725	Еурооблигациялар	"ForteBank" АҚ	19.06.2017	45 948 593	143 787	USD
KZW1KD079591	ҚР ҰБ НОТТАРЫ	ҚР Ұлттық Банкі	21.06.2017	43 647 820 400	-	KZT
KZW1KD079617	ҚР ҰБ НОТТАРЫ	ҚР Ұлттық Банкі	22.06.2017	69 270 923 300	-	KZT

KZW1KD079625	ҚР ҰБ НОТТАРЫ	ҚР Ұлттық Банкі	23.06.2017	135 518 444 500	-	KZT
US912796JX89	ШЕТ МЕМ МБҚ	US Treasury Bill	23.06.2017	65 376 000 000	200 000 000	USD
KZW1KD079641	ҚР ҰБ НОТТАРЫ	ҚР Ұлттық Банкі	26.06.2017	40 000 000 000	-	KZT
KZKAKY090025	МЕУЖКАМ 108	Қр Қаржы министрлігі	27.06.2017	12 000 000 000	-	KZT
KZW1KD079666	ҚР ҰБ НОТТАРЫ	ҚР Ұлттық Банкі	28.06.2017	43 916 107 300	-	KZT
KZW1KD079682	ҚР ҰБ НОТТАРЫ	ҚР Ұлттық Банкі	29.06.2017	80 500 000 000	-	KZT
US912828TB69	ШЕТ МЕМ МБҚ	US Treasury Bill	30.06.2017	934 583 000	2 900 000	USD
KZ2C0M11F378	Облигациялар	«Қазақстан Даму Банкі» АҚ	30.06.2017	85 000 000 000		KZT
KZW1KD079690	ҚР ҰБ НОТТАРЫ	ҚР Ұлттық Банкі	30.06.2017	140 500 000 000	-	KZT
US912796LF46	ШЕТ МЕМ МБҚ	US Treasury Bill	30.06.2017	83 790 200 000	260 000 000	USD
<b>Барлығы</b>				<b>1 454 750 875 623</b>		

#### 10-кесте. Есепті айдағы негізгі депозит борышын өтеу жөніндегі мәліметтер

Төлеу күні	Жабу күні	Бағалы қағаз эмитенті	Теңгемен өтелетін сома	Шетелдік валютада өтеуге сома	Номинал валютасы
02.06.2017	21.10.2019	"Казинвестбанк" АҚ	2 899 225 000		KZT
05.06.2017	12.02.2020	"Эксімбанк Қазақстан" АҚ	9 987 100 673		KZT
28.06.2017	28.06.2017	MIZUHO CORPORATE BANK, LTD. LONDON BRANCH	51 700 800 000	160 000 000	USD

### Информация по инвестиционному управлению пенсионными активами АО «ЕНПФ»

По состоянию на 1 июля 2017 года пенсионные активы (далее – ПА) ЕНПФ, находящиеся в управлении Национального Банка Республики Казахстан (далее – НБРК), составили 7 138,97 млрд. тенге<sup>4</sup>.

Структура инвестиционного портфеля финансовых инструментов, сформированного за счет пенсионных активов ЕНПФ, представлена в Таблице 1.

**Таблица 1. Структура инвестиционного портфеля ПА ЕНПФ, находящихся в управлении НБРК, в разрезе финансовых инструментов**

Наименование	млрд. тенге				
	Текущая стоимость на 01.01.2017 г.	Доля на 01.01.2017 г.	Текущая стоимость на 01.07.2017 г.	Доля на 01.07.2017 г.	Прирост/снижение с начала года
ГЦБ РК	2 910,82	43,57%	3 028,74	42,43%	4,05%
ГЦБ иностранных государств	365,01	5,46%	426,14	5,97%	16,75%
МФО	86,63	1,30%	80,39	1,13%	-7,21%

<sup>4</sup> без учета денег на счетах пенсионных взносов и выплат.



Корпоративные облигации эмитентов РК	84,03	1,26%	73,33	1,03%	-12,74%
Облигации квазигосударственных организаций РК	900,17	13,48%	808,13	11,32%	-10,22%
Облигации БВУ РК	1 450,20	21,71%	1 365,84	19,13%	-5,82%
Корпоративные облигации иностранных эмитентов	137,92	2,07%	128,34	1,80%	-6,95%
PPN (структурные ноты)	31,64	0,47%	30,28	0,42%	-4,28%
Акции и депозитарные расписки эмитентов РК	127,46	1,91%	144,82	2,03%	13,63%
Акции и депозитарные расписки иностранных эмитентов	18,33	0,27%	16,98	0,24%	-7,35%
Депозиты	399,91	5,99%	334,27	4,68%	-16,41%
Депозиты в иностранных банках	-	-	274,56	3,85%	-
РЕПО	-	-	1,50	0,02%	-
Денежные средства на инвестиционных счетах	151,84	2,27%	410,04	5,74%	170,05%
Прочие активы (дебиторская задолженность <sup>5</sup> , просроченная задолженность, провизии)	16,18	0,24%	15,60	0,22%	-3,59%
<b>Итого ПА, находящиеся в управлении НБРК</b>	<b>6 680,14</b>	<b>100,00%</b>	<b>7 138,97</b>	<b>100,00%</b>	<b>6,87%</b>
Деньги на счетах пенсионных взносов и выплат	9,52		2,15		
<b>Итого пенсионные активы</b>	<b>6 689,66</b>		<b>7 141,12</b>		<b>6,75%</b>

Средневзвешенная доходность к погашению (YTM) долговых финансовых инструментов, находящихся в инвестиционном портфеле ПА ЕНПФ, по состоянию на 01.07.2017 года составила 8,1% годовых.

### **Государственные ценные бумаги Республики Казахстан**

Основную долю в портфеле ПА ЕНПФ составляют ГЦБ РК, текущая стоимость которых за отчетный месяц увеличилась на 126,55 млрд. тенге и составила 3 028,74 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 42,43%.

В отчетном периоде были приобретены краткосрочные дисконтные ноты НБРК в объеме 1 306,51 млрд. тенге по номинальной стоимости со средневзвешенной доходностью 9,9% годовых.

За отчетную дату произошло погашение дисконтных нот НБРК на сумму 1 183,20 млрд. тенге, а также облигаций Министерства финансов РК в объеме 12,00 млрд. тенге

Средневзвешенная доходность к погашению ГЦБ РК в портфеле ПА ЕНПФ за отчетный период составила 7,9% годовых.

### **Государственные ценные бумаги иностранных государств**

Текущая стоимость государственных ценных бумаг иностранных государств за отчетный месяц уменьшилась на 213,70 млрд. тенге и составила 426,14 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 5,97%.

В отчетном периоде были приобретены краткосрочные облигации Казначейства США в объеме 88,38 млрд. тенге по номинальной стоимости со средневзвешенной доходностью 1,0% годовых, ценные бумаги Правительства РФ в объеме 3,50 млрд. тенге по номинальной стоимости со средневзвешенной доходностью 8,0% годовых, также были проданы краткосрочные облигации Казначейства США в объеме 177,25 млрд. тенге по номинальной стоимости со средневзвешенной доходностью 0,8% годовых.

<sup>5</sup> 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.

За отчетную дату произошло погашение государственных ценных бумаг иностранных государств, номинированных в долларах США, в объеме 150,10 млрд. тенге.

Средневзвешенная доходность к погашению ГЦБ иностранных государств в портфеле ПА ЕНПФ за отчетный период составила 2,4% годовых.

#### **Облигации Международных финансовых организаций**

Текущая стоимость облигаций Международных финансовых организаций за отчетный месяц уменьшилась на 3,50 млрд. тенге и составила 80,39 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 1,13%.

За отчетную дату произошло погашение ценных бумаг Международных финансовых организаций, номинированных в российских рублях, в объеме 3,53 млрд. тенге.

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

Средневзвешенная доходность к погашению облигаций Международных финансовых организаций в портфеле ПА ЕНПФ за отчетный период составила 7,2% годовых.

#### **Депозиты в банках второго уровня Республики Казахстан**

Текущая стоимость вкладов в БВУ РК за отчетный месяц уменьшилась на 8,01 млрд. тенге и составила 334,27 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 4,68%.

В отчетном периоде в портфеле ПА ЕНПФ были размещены вклады БВУ общим объемом 3,18 млрд. тенге со средневзвешенной ставкой вознаграждения 8,00% годовых. При этом в портфеле ПА ЕНПФ произошло погашение основного долга вкладов БВУ РК на сумму порядка 64,59 млрд. тенге.

Средневзвешенная доходность к погашению вкладов БВУ РК за отчетный период составила 10,7% годовых.

#### **Депозиты в иностранных банках**

Текущая стоимость вкладов в иностранных банках за отчетный месяц уменьшилась на 41,33 млрд. тенге и составила 274,56 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 3,85%.

Средневзвешенная доходность к погашению вкладов в иностранных банках за отчетный период составила 1,2% годовых.

#### **Корпоративные облигации эмитентов Республики Казахстан**

Текущая стоимость корпоративных облигаций эмитентов РК за отчетный месяц уменьшилась на 10,68 млрд. тенге и составила 73,33 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 1,03%.

В отчетном периоде 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 за отчетный период составила 13,3% годовых.

#### **Облигации квазигосударственных организаций Республики Казахстан**

Текущая стоимость облигаций квазигосударственных организаций РК за отчетный месяц уменьшилась на 77,76 млрд. тенге и составила 808,13 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 11,32%.

За отчетную дату были приобретены облигации квазигосударственных организаций РК в объеме 14,85 млрд. тенге по номинальной стоимости со средневзвешенной доходностью 10,5% годовых.

За отчетную дату произошло погашение ценных бумаг квазигосударственных организаций РК, в объеме 85,00 млрд. тенге по номинальной стоимости.

В отчетном периоде в портфеле ПА ЕНПФ продаж облигаций квазигосударственных организаций РК не было.

Средневзвешенная доходность к погашению облигаций квазигосударственных организаций РК в портфеле ПА ЕНПФ за отчетный период составила 9,5% годовых.

### **Облигации банков второго уровня Республики Казахстан**

Текущая стоимость облигаций БВУ РК за отчетный месяц увеличилась на 1,69 млрд. тенге и составила 1 365,84 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 19,13%.

В отчетном периоде в портфеле ПА ЕНПФ произошло погашение основного долга облигаций БВУ РК, номинированных в долларах США, в объеме 20,92 млрд. тенге.

За отчетную дату были приобретены облигации БВУ РК в объеме 12,99 млрд. тенге по номинальной стоимости со средневзвешенной доходностью 12,5% годовых. Продаж облигаций БВУ РК не было.

Средневзвешенная доходность к погашению облигаций БВУ РК в портфеле ПА ЕНПФ за отчетный период составила 9,8% годовых.

### **Корпоративные облигации иностранных эмитентов**

Текущая стоимость корпоративных облигаций иностранных эмитентов за отчетный месяц увеличилась на 4,85 млрд. тенге и составила 128,34 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 1,80%.

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 за отчетный период составила 9,1% годовых.

### **PPN (структурные ноты) иностранных эмитентов**

Текущая стоимость PPN (структурных нот) иностранных эмитентов за отчетный месяц уменьшилась на 0,73 млрд. тенге и составила 30,28 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 0,42%.

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 2,69 млрд. тенге и составила 144,82 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 2,03%.

В отчетном периоде в портфеле ПА ЕНПФ покупок и продаж акций и депозитарных расписок эмитентов РК не было.

### **Акции и депозитарные расписки иностранных эмитентов**

Текущая стоимость акций и депозитарных расписок иностранных эмитентов за отчетный месяц уменьшилась на 0,73 млрд. тенге и составила 16,98 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 0,24%.

В отчетном периоде продаж и 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 управлении НБРК, в разрезе валют**

Валюта	Текущая стоимость на 01.01.2017 г.	Доля на 01.01.2017 г.	Текущая стоимость на 01.07.2017 г.	Доля на 01.07.2017 г.	Прирост/снижение с начала года
Национальная валюта	5 142,38	76,98%	5 195,62	72,78%	1,04%
Доллары США	1 492,44	22,34%	1 898,73	26,60%	27,22%
Российские рубли	35,12	0,53%	33,96	0,48%	-3,28%
Другие валюты	10,20	0,15%	10,65	0,15%	4,41%

*млрд. тенге*

Итого:	6 680,14	100,00%	7 138,97	100,00%	6,87%
--------	----------	---------	----------	---------	-------

### **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 6 месяца 2017 года составил 211,97 млрд. тенге. Таким образом, доходность пенсионных активов ЕНПФ, распределенная на счета вкладчиков (получателей) за период с 1 января по 30 июня 2017 года, составила 3,01%.

Структура начисленного инвестиционного дохода за указанный период представлена в Таблице 3.

**Таблица 3. Структура инвестиционного дохода, полученного по ПА ЕНПФ, находящихся в 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»	256,3
Доходы (убытки) от рыночной переоценки ценных бумаг	0,05
Доходы (убытки) от переоценки иностранной валюты	-35,97
Прочие доходы (убытки)	1,59
<b>Итого:</b>	<b>221,97</b>

### **Информация о соблюдении параметров инвестиционной декларации**

Структурное распределение ПА ЕНПФ, находящихся в доверительном управлении, соответствует требованиям Инвестиционной декларации ЕНПФ<sup>6</sup>. Доли валютных позиций остаются в рамках допустимого уровня и не нарушают требований Инвестиционной декларации ЕНПФ, данные по состоянию на 01.07.2017г. представлены в Таблице 4.

**Таблица 4. Лимиты инвестирования ПА ЕНПФ**

№	Вид финансового инструмента	Фактическое значение (в процентах от ПА)	Выполнение (да/нет)
<b>1</b>	<b>Зарубежные эмитенты:</b>	<b>12,45%</b>	<b>да</b>
1.1	Государственные, агентские и ценные бумаги международных финансовых организаций (МФО):	7,10%	да
1)	с рейтингом не ниже «BBB-» по международной шкале агентства «Standard & Poor's» или рейтингом аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств	4,93%	да
2)	с рейтингом от «BB+» до «BB-» по международной шкале агентства «Standard & Poor's» или рейтингом аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств	2,17%	да
1.2	Корпоративные долговые ценные бумаги:	0,85%	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	0,09%	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	0,76%	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

<sup>6</sup> Инвестиционная декларация ЕНПФ утверждена постановлением Правления Национального Банка Республики Казахстан от 17 марта 2016 года №86

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	3,85%	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	0,42%	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
<b>2</b>	<b>Казахстанские эмитенты:</b>	<b>79,63%</b>	<b>да</b>
2.1	Государственные ценные бумаги Республики Казахстан	42,43%	да
2.2	Ценные бумаги субъектов квазигосударственного сектора		да
2.3	Финансовые инструменты банков второго уровня Республики Казахстан	12,25%	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	24,68%	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	0,09%	да
2.6	Инструменты исламского финансирования, включенные в официальный список Казахстанской фондовой биржи	0,18%	да

**Таблица 5. Лимиты инвестирования 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 за отчетный месяц**

Дата сделки	Дата погашения	Вид инструмента	Эмитент ценной бумаги	НИН (ISIN)	Валюта номинала	Номинальная стоимость в тенге	Номинальная стоимость в ин. валюте
01.06.2017	08.06.2017	НОТЫ	НБРК	KZW1KD079484	KZT	8 738 247 000	
01.06.2017	08.06.2017	НОТЫ	НБРК	KZW1KD079484	KZT	40 355 393 300	
02.06.2017	09.06.2017	НОТЫ	НБРК	KZW1KD079492	KZT	16 924 341 400	
02.06.2017	09.06.2017	НОТЫ	НБРК	KZW1KD079492	KZT	111 100 000 000	
05.06.2017	02.06.2022	ОБЛ. КОРП.КУПОН	АО "ЭКСИМБАНК КАЗАХСТАН"	KZP02Y05E986	KZT	12 986 874 500,00	
06.06.2017	06.06.2024	ОБЛ. КОРП.КУПОН	АО "Банк Развития Казахстана"	KZP01Y07F510	KZT	14 850 000 000,00	
07.06.2017	14.06.2017	НОТЫ	НБРК	KZW1KD079526	KZT	2 304 277 600	
07.06.2017	14.06.2017	НОТЫ	НБРК	KZW1KD079526	KZT	29 500 000 000	
08.06.2017	15.06.2017	НОТЫ	НБРК	KZW1KD079542	KZT	12 700 000 000	
08.06.2017	15.06.2017	НОТЫ	НБРК	KZW1KD079542	KZT	50 300 000 000	
09.06.2017	16.06.2017	НОТЫ	НБРК	KZW1KD079559	KZT	28 100 000 000	
09.06.2017	16.06.2017	НОТЫ	НБРК	KZW1KD079559	KZT	111 900 000 000	
14.06.2017	21.06.2017	НОТЫ	НБРК	KZW1KD079591	KZT	3 747 820 400	
14.06.2017	21.06.2017	НОТЫ	НБРК	KZW1KD079591	KZT	39 900 000 000	
15.06.2017	22.06.2017	НОТЫ	НБРК	KZW1KD079617	KZT	13 370 923 300	
15.06.2017	22.06.2017	НОТЫ	НБРК	KZW1KD079617	KZT	55 900 000 000	
16.06.2017	23.06.2017	НОТЫ	НБРК	KZW1KD079625	KZT	7 618 444 500	
16.06.2017	23.06.2017	НОТЫ	НБРК	KZW1KD079625	KZT	127 900 000 000	
19.06.2017	15.05.2019	ГЦБ ИН.ГОС.	Правительство РФ	RU000A0JU9V1	RUB	3 498 850 000	635 000 000
19.06.2017	26.06.2017	НОТЫ	НБРК	KZW1KD079641	KZT	31 900 000 000	
19.06.2017	26.06.2017	НОТЫ	НБРК	KZW1KD079641	KZT	8 100 000 000	
19.06.2017	12.10.2017	ГЦБ (ИН.ГОС) ДИСКОНТ	Правительство США	US912796KR92	USD	23 008 320 000	70 000 000
21.06.2017	28.06.2017	НОТЫ	НБРК	KZW1KD079666	KZT	40 700 000 000	
21.06.2017	28.06.2017	НОТЫ	НБРК	KZW1KD079666	KZT	3 216 107 300	
22.06.2017	29.06.2017	НОТЫ	НБРК	KZW1KD079682	KZT	64 300 000 000	
22.06.2017	29.06.2017	НОТЫ	НБРК	KZW1KD079682	KZT	16 200 000 000	
23.06.2017	30.06.2017	НОТЫ	НБРК	KZW1KD079690	KZT	112 300 000 000	
23.06.2017	30.06.2017	НОТЫ	НБРК	KZW1KD079690	KZT	28 200 000 000	
26.06.2017	03.07.2017	НОТЫ	НБРК	KZW1KD079708	KZT	9 000 000 000	
26.06.2017	03.07.2017	НОТЫ	НБРК	KZW1KD079708	KZT	35 500 000 000	
27.06.2017	19.10.2017	ГЦБ (ИН.ГОС) ДИСКОНТ	Правительство США	US912796LY35	USD	65 368 030 000	203 000 000
28.06.2017	05.07.2017	НОТЫ	НБРК	KZW1KD079724	KZT	9 237 687 300	
28.06.2017	05.07.2017	НОТЫ	НБРК	KZW1KD079724	KZT	54 200 000 000	
29.06.2017	10.07.2017	НОТЫ	НБРК	KZW1KD119744	KZT	71 400 000 000	
29.06.2017	10.07.2017	НОТЫ	НБРК	KZW1KD119744	KZT	18 000 000 000	
30.06.2017	10.07.2017	НОТЫ	НБРК	KZW1KD109752	KZT	28 900 000 000	
30.06.2017	10.07.2017	НОТЫ	НБРК	KZW1KD109752	KZT	115 000 000 000	
<b>Итого</b>						<b>1 426 225 316 600</b>	

**Таблица 7. Сведения по продаже финансовых инструментов за отчетный месяц**

Дата сделки	Дата погашения	Вид инструмента	Эмитент ценной бумаги	НИН (ISIN)	Валюта номинала	Номинальная стоимость в тенге	Номинальная стоимость в ин. валюте
-------------	----------------	-----------------	-----------------------	------------	-----------------	-------------------------------	------------------------------------

30.06.2017	06.07.2017	ГЦБ (ИН.ГОС) ДИСКОНТ	Правительство США	US912796LG29	USD	32 227 000 000	100 000 000
30.06.2017	13.07.2017	ГЦБ (ИН.ГОС) ДИСКОНТ	Правительство США	US912796LK31	USD	42 539 640 000	132 000 000
30.06.2017	03.08.2017	ГЦБ (ИН.ГОС) ДИСКОНТ	Правительство США	US912796LM96	USD	51 563 200 000	160 000 000
30.06.2017	10.08.2017	ГЦБ (ИН.ГОС) ДИСКОНТ	Правительство США	US912796LP28	USD	50 918 660 000	158 000 000
<b>Итого</b>						<b>177 248 500 000</b>	

**Таблица 8. Сведения по размещениям во вклады банков за отчетный месяц**

Дата сделки	Дата погашения	Эмитент ценной бумаги	Валюта номинала	Сумма сделки в тенге	Сумма сделки в ин.валюте
02.06.2017	02.06.2020	АО "ДОЧЕРНИЙ БАНК "АЛЬФА-БАНК"	KZT	3 176 556 855	

**Таблица 9. Сведения по погашениям основного долга ценных бумаг за отчетный месяц**

НИН (ISIN)	Вид инструмента	Эмитент ценной бумаги	Дата фактического погашения	Сумма к погашению в тенге	Сумма к погашению в ин.валюте	Валюта номинала
KZW1KD079419	НОТЫ НБРК	Национальный Банк РК	01.06.2017	119 000 000 000	-	KZT
KZW1KD079427	НОТЫ НБРК	Национальный Банк РК	02.06.2017	31 000 000 000	-	KZT
KZW1KD079468	НОТЫ НБРК	Национальный Банк РК	07.06.2017	67 923 409 600	-	KZT
KZW1KD079484	НОТЫ НБРК	Национальный Банк РК	08.06.2017	49 093 640 300	-	KZT
KZW1KD079492	НОТЫ НБРК	Национальный Банк РК	09.06.2017	128 024 341 400	-	KZT
XS0303133564	Еврооблигации	Европейский инвестиционный банк	13.06.2017	3 531 675 900	636 338 000	RUB
XS0305204595	Еврооблигации	АО "КАЗКОММЕРЦБАНК"	14.06.2017	20 873 503 730	65 999 000	USD
KZW1KD079526	НОТЫ НБРК	Национальный Банк РК	14.06.2017	31 804 277 600	-	KZT
KZW1KD079542	НОТЫ НБРК	Национальный Банк РК	15.06.2017	63 000 000 000	-	KZT
KZW1KD079559	НОТЫ НБРК	Национальный Банк РК	16.06.2017	140 000 000 000	-	KZT
XS1153772725	Еврооблигации	АО "ForteBank"	19.06.2017	45 948 593	143 787	USD
KZW1KD079591	НОТЫ НБРК	Национальный Банк РК	21.06.2017	43 647 820 400	-	KZT
KZW1KD079617	НОТЫ НБРК	Национальный Банк РК	22.06.2017	69 270 923 300	-	KZT
KZW1KD079625	НОТЫ НБРК	Национальный Банк РК	23.06.2017	135 518 444 500	-	KZT
US912796JX89	ГЦБ ИН.ГОС	US Treasury Bill	23.06.2017	65 376 000 000	200 000 000	USD
KZW1KD079641	НОТЫ НБРК	Национальный Банк РК	26.06.2017	40 000 000 000	-	KZT
KZKAKY090025	МЕУЖКАМ 108	Министерство финансов РК	27.06.2017	12 000 000 000	-	KZT
KZW1KD079666	НОТЫ НБРК	Национальный Банк РК	28.06.2017	43 916 107 300	-	KZT
KZW1KD079682	НОТЫ НБРК	Национальный Банк РК	29.06.2017	80 500 000 000	-	KZT
US912828TB69	ГЦБ ИН.ГОС	US Treasury Bill	30.06.2017	934 583 000	2 900 000	USD
KZ2C0M11F378	Облигации	АО "Банк Развития Казахстана"	30.06.2017	85 000 000 000		KZT
KZW1KD079690	НОТЫ НБРК	Национальный Банк РК	30.06.2017	140 500 000 000	-	KZT
US912796LF46	ГЦБ ИН.ГОС	US Treasury Bill	30.06.2017	83 790 200 000	260 000 000	USD
<b>Итого</b>				<b>1 454 750 875 623</b>		

**Таблица 10. Сведения по погашениям основного долга депозитов за отчетный месяц**

Дата выплаты	Дата закрытия	Эмитент ценной бумаги	Сумма к погашению в тенге	Сумма к погашению в ин.валюте	Валюта номинала
02.06.2017	21.10.2019	АО "Казинвестбанк"	2 899 225 000		KZT
05.06.2017	12.02.2020	АО "Эксимбанк Казахстан"	9 987 100 673		KZT
28.06.2017	28.06.2017	MIZUHO CORPORATE BANK, LTD. LONDON BRANCH	51 700 800 000	160 000 000	USD