

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

По состоянию на 1 ноября 2018 года пенсионные активы (далее – ПА) ЕНПФ, находящиеся в доверительном управлении Национального Банка Республики Казахстан (далее – НБРК), составили 9 051,91 млрд. тенге<sup>1</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 доверительном управлении НБРК, в разрезе финансовых инструментов**

Наименование	Текущая стоимость на 01.01.2018 г.	Доля на 01.01.2018 г.	Текущая стоимость на 01.11.2018 г.	Доля на 01.11.2018 г.	Прирост/снижение с начала года
ГЦБ РК	3 587,63	46,14%	4 541,00	50,17%	26,57%
ГЦБ иностранных государств	948,84	12,20%	1 246,17	13,77%	31,34%
МФО	172,55	2,22%	165,58	1,83%	-4,04%
Корпоративные облигации эмитентов РК	58,30	0,75%	52,66	0,58%	-9,67%
Облигации квазигосударственных организаций РК	791,68	10,18%	727,63	8,04%	-8,09%
Облигации БВУ РК	1 246,49	16,03%	1 251,99	13,83%	0,44%
Корпоративные облигации иностранных эмитентов	9,35	0,12%	9,00	0,10%	-3,69%
Облигации иностранных эмитентов квазигосударственного сектора	53,39	0,69%	223,86	2,47%	319,26%
PPN (структурные ноты)	35,00	0,45%	30,75	0,34%	-12,15%
Акции и депозитарные расписки эмитентов РК	184,14	2,37%	161,22	1,78%	-12,45%
Акции и депозитарные расписки иностранных эмитентов	23,68	0,30%	19,77	0,22%	-16,54%
Депозиты	325,82	4,19%	281,24	3,11%	-13,68%
Депозиты НБРК	-	-	185,00	2,04%	
Депозиты в иностранных банках	277,41	3,57%	225,46	2,49%	-18,73%
РЕПО	11,02	0,14%	-	0,00%	
Денежные средства на инвестиционных счетах	20,88	0,27%	46,65	0,52%	
Прочие активы (дебиторская задолженность <sup>2</sup> , просроченная задолженность, провизии)	28,62	0,37%	2,58	0,03%	
Активы, находящиеся во внешнем управлении у Aviva Investors Global Services Limited*	-	-	81,00	0,89%	
<b>Итого ПА, находящиеся в управлении НБРК**</b>	<b>7 774,82</b>	<b>100,00%</b>	<b>9 051,91</b>	<b>100,00%</b>	<b>16,43%</b>
Обязательства к оплате по совершенным сделкам			199,66		
Деньги на счетах пенсионных взносов и выплат	9,51		2,78		
<b>Итого пенсионные активы</b>	<b>7 784,33</b>		<b>9 254,36</b>		<b>18,88%</b>

\* - в рамках мандата «Глобальные облигации развивающихся рынков»

\*\* - с учетом обязательств к оплате по совершенным сделкам на сумму 199,66 млрд. тенге

По состоянию на 01.11.2018г. 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 – 4,2% годовых.

<sup>1</sup> без учета денег на счетах пенсионных взносов и выплат.

<sup>2</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.

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

Основную долю в портфеле ПА ЕНПФ занимают ГЦБ РК, текущая стоимость которых за отчетный месяц увеличилась на 375,27 млрд. тенге и составила 4 541,00 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 50,17%.

В отчетном периоде были приобретены краткосрочные дисконтные ноты НБРК в объеме 2 924,93 млрд. тенге со средневзвешенной доходностью 8,57% годовых.

В рассматриваемом периоде произошло погашение ГЦБ Министерства финансов РК и дисконтных нот НБРК на сумму 30,24 млрд. тенге и 2 529,6 млрд. тенге соответственно.

На отчетную дату средневзвешенная доходность к погашению по ГЦБ РК, номинированным в тенге, составила 7,2% годовых, в долларах США – 4,4% годовых.

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

Текущая стоимость государственных ценных бумаг иностранных государств за отчетный месяц увеличилась на 67,50 млрд. тенге и составила 1 246,17 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 13,77%.

В отчетном периоде были приобретены краткосрочные ГЦБ США в объеме 74,74 млрд. тенге по номинальной стоимости с доходностью 2,34% годовых.

В рамках нового стратегического распределения валютной части портфеля ПА, предусмотренного Инвестиционной декларацией ЕНПФ, приобретены ГЦБ развивающихся стран, номинированные в долларах США, на сумму 14,13 млрд. тенге по номинальной стоимости со средневзвешенной доходностью 4,17%, в том числе:

- ГЦБ Филиппин в объеме 1,46 млрд. тенге с доходностью 3,88% годовых;

- ГЦБ Перу в объеме 12,67 млрд. тенге со средневзвешенной доходностью 4,20% годовых.

В рассматриваемом периоде были реализованы ГЦБ Турции в объеме 15,16 млрд. тенге, а также произошло погашение ГЦБ США на сумму 22,11 млрд. тенге.

Средневзвешенная доходность к погашению ГЦБ иностранных государств в портфеле ПА ЕНПФ на отчетную дату составила 4,1% годовых.

### **Облигации Международных финансовых организаций**

Текущая стоимость облигаций международных финансовых организаций за отчетный месяц увеличилась на 5,98 млрд. тенге и составила 165,58 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 1,83%.

В отчетном периоде были приобретены облигации Евразийского Банка Развития в объеме 5,00 млрд. тенге по номинальной стоимости с доходностью 9,50% годовых.

Продаж и погашений ценных бумаг международных финансовых организаций не было.

Средневзвешенная доходность к погашению по облигациям международных финансовых организаций, номинированным в тенге, составила 6,9% 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 2,14 млрд. тенге и составила 281,24 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 3,11%.

В отчетном периоде произошло частичное досрочное погашение вкладов БВУ РК на сумму 2,23 млрд. тенге.

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

### **Депозиты в иностранных банках**

Текущая стоимость вкладов в иностранных банках, имеющих средневзвешенный срок погашения 2,46 месяца, за отчетный месяц уменьшилась на 112,08 млрд. тенге и составила 225,46 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 2,49%.

В отчетном месяце были размещены вклады в иностранных банках на сумму 187,30 млрд. тенге со средневзвешенной доходностью 2,44% годовых. В отчетном периоде произошло погашение вкладов на сумму 303,03 млрд. тенге.

Средневзвешенная доходность к погашению вкладов в иностранных банках на отчетную дату составила 2,5% годовых.

#### **Депозиты в Национальном Банке РК**

Текущая стоимость депозитов в Национальном Банке РК составила 185,00 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 2,04%.

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 2 991,00 млрд. тенге со средневзвешенной доходностью 8,19% годовых. В отчетном периоде произошло погашение депозитов на общую сумму 2 996,00 млрд. тенге.

Средневзвешенная доходность к погашению вкладов в Национальном Банке РК на отчетную дату составила 8,3% годовых.

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

Текущая стоимость корпоративных облигаций эмитентов РК за отчетный месяц увеличилась на 0,39 млрд. тенге и составила 52,66 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 увеличилась на 16,82 млрд. тенге и составила 727,63 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 8,04%.

В рассматриваемом периоде были приобретены облигации АО «Ипотечная организация «Баспана» в объеме 10,00 млрд. тенге по номинальной стоимости с доходностью 9,29% 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 10,7% годовых, в долларах США – 5,0% годовых.

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

Текущая стоимость облигаций БВУ РК за отчетный месяц увеличилась на 25,62 млрд. тенге и составила 1 251,99 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 13,83%.

В отчетном периоде в рамках облигационной программы для БВУ РК на сумму 200 млрд. тенге были приобретены облигации БВУ РК на общую сумму 27,22 млрд. тенге со средневзвешенной доходностью 11,87% годовых.

Продаж и погашений 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 увеличилась на 0,44 млрд. тенге и составила 9,00 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 0,10%.

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

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

#### **Облигации иностранных эмитентов квазигосударственного сектора**

Текущая стоимость облигаций иностранных эмитентов квазигосударственного сектора за отчетный месяц увеличилась на 44,88 млрд. тенге и составила 223,86 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 2,47%.

В рамках нового стратегического распределения валютной части портфеля ПА, предусмотренного Инвестиционной декларацией ЕНПФ, приобретены облигации иностранных эмитентов квазигосударственного сектора Китая и Чили, номинированные в долларах США, в общем объеме 42,36 млрд. тенге по номинальной стоимости со средневзвешенной доходностью 4,25% годовых.

Продаж и погашений 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 0,51 млрд. тенге и составила 30,75 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 10,68 млрд. тенге и составила 161,22 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 1,78%.

В отчетном периоде 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 1,32 млрд. тенге и составила 19,77 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 0,22%.

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

#### **Валютная структура**

Инвестиционный портфель финансовых инструментов в разрезе валют, в которых номинированы финансовые инструменты, приобретенные за счет пенсионных активов ЕНПФ, представлен в Таблице 2.

**Таблица 2. Структура инвестиционного портфеля ПА ЕНПФ, находящихся в доверительном управлении НБРК, в разрезе валют**

Валюта	<i>млрд. тенге</i>				
	Текущая стоимость на 01.01.2018г.	Доля на 01.01.2018г.	Текущая стоимость на 01.11.2018г.	Доля на 01.11.2018г.	Прирост/снижение с начала года
Национальная валюта	5 619,71	72,28%	6 248,7	69,03%	11,19%
Доллары США	2 110,34	27,14%	2 765,3	30,55%	31,04%
Российские рубли	36,90	0,47%	30,9	0,34%	- 16,32%

Другие валюты	7,88	0,10%	7,0	0,08%	- 11,17%
<b>Итого:</b>	<b>7 774,82</b>	<b>100,00%</b>	<b>9 051,91</b>	<b>100,00%</b>	<b>16,43%</b>

### **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 765,27 млрд. тенге. Доходность пенсионных активов ЕНПФ, распределенная на счета вкладчиков (получателей) с начала 2018 года, составила 8,86%.

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>	
<b>Наименование</b>	<b>Инвестиционный доход за 2018 год</b>
Доходы в виде вознаграждения по ценным бумагам, в том числе по размещенным вкладам и операциям «обратное РЕПО»	459,11
Доходы (убытки) от рыночной переоценки ценных бумаг	11,73
Доходы (убытки) от переоценки иностранной валюты	285,79
Доходы (убытки) от внешнего управления	10,48
Прочие доходы (убытки)	-1,84
<b>Итого:</b>	<b>765,27</b>

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

Структурное распределение ПА ЕНПФ, находящихся в доверительном управлении, соответствует требованиям Инвестиционной декларации ЕНПФ<sup>3</sup>. 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 01.11.2018г. представлены в Таблице 4.

**Таблица 4. Лимиты инвестирования по ПА ЕНПФ**

<b>№</b>	<b>Вид финансового инструмента</b>	<b>Фактическое значение (в процентах от ПА)</b>	<b>Выполнение (да/нет)</b>
<b>1</b>	<b>Зарубежные эмитенты:</b>	<b>22,08%</b>	<b>да</b>
1.1	Государственные, агентские и ценные бумаги международных финансовых организаций (МФО):	16,41%	да
1)	с рейтингом не ниже «BBB-» по международной шкале агентства «Standard & Poor's» или рейтингом аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств	12,32%	да
2)	с рейтингом от «BB+» до «BB-» по международной шкале агентства «Standard & Poor's» или рейтингом аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств	4,09%	да
1.2	Корпоративные долговые ценные бумаги:	2,62%	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	0,22%	да

<sup>3</sup> 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	2,49%	да
1.6	Структурные продукты, выпущенные организациями, имеющими рейтинговую оценку не ниже «ВВВ-» 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 «ВВВ-» 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 «ВВ+» до «ВВ-» 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>79,02%</b>	<b>да</b>
2.1	Государственные ценные бумаги Республики Казахстан, выпущенные Министерством финансов Республики Казахстан, Национальным Банком Республики Казахстан	50,17%	да
2.1-1	Государственные ценные бумаги Республики Казахстан, выпущенные местными исполнительными органами Республики Казахстан	0,00%	да
2.1-2	Депозиты Национального Банка Республики Казахстан	2,04%	да
2.2	Ценные бумаги субъектов квазигосударственного сектора	8,48%	да
2.3	Финансовые инструменты банков второго уровня Республики Казахстан	17,97%	да
2.4	Негосударственные долговые ценные бумаги, за исключением долговых ценных бумаг субъектов квазигосударственного сектора и банков второго уровня Республики Казахстан, имеющими рейтинговую оценку ценной бумаги и/или эмитента не ниже «В-» по международной шкале агентства «Standard & Poor's» или рейтинговой оценкой аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств	0,09%	да
2.4-1	Негосударственные долговые ценные бумаги, выпущенные под гарантию и/или поручительство Правительства Республики Казахстан	0,00%	да
2.5	Негосударственные долевые ценные бумаги, за исключением долевых ценных бумаг субъектов квазигосударственного сектора и банков второго уровня Республики Казахстан, входящие в первую категорию официального списка Казахстанской фондовой биржи	0,27%	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
01.10.2018	08.10.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD073990	183 794 586 700
02.10.2018	09.10.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD074006	100 000 000 000
03.10.2018	10.10.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD074014	50 000 000 000
03.10.2018	31.10.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD284027	100 000 000 000
03.10.2018	13.10.2019	Облигации	АО «ИО «Баспана»	KZ2C0M12F921	10 000 000 000
04.10.2018	11.10.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD074030	100 000 000 000
05.10.2018	12.10.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD074048	100 000 000 000
05.10.2018	27.01.2023	Облигации	АО «Kaspi Bank»	KZP03Y08E830	5 070 700 000
05.10.2018	07.03.2019	ГЦБ США	Правительство США	US912796QZ54	74 742 000 000
08.10.2018	15.10.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD074055	100 000 000 000
08.10.2018	07.05.2024	Еврооблигации	State Grid Overseas Inv	USG8449WAC85	2 978 160 000
08.10.2018	04.05.2027	Еврооблигации	State Grid Overseas Inv	USG8450LAJ38	3 722 700 000
09.10.2018	16.10.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD074063	150 000 000 000
10.10.2018	17.10.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD074071	89 016 186 100
10.10.2018	28.04.2025	Еврооблигации	Sinopec GRP Overseas DEV	USG8201JAC56	1 843 500 000

10.10.2018	02.05.2023	Еврооблигации	State Grid Overseas Inv	USG8450LAN40	1 843 500 000
10.10.2018	04.05.2027	Еврооблигации	State Grid Overseas Inv	USG8450LAJ38	2 949 600 000
10.10.2018	07.11.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD284084	100 000 000 000
11.10.2018	11.10.2023	Облигации	Евразийский банк развития	KZP06Y05E904	5 000 000 000
11.10.2018	18.10.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD074097	100 000 000 000
11.10.2018	17.10.2023	Еврооблигации	Sinopec GRP Overseas DEV	USG8200QAB26	1 860 000 000
11.10.2018	28.04.2025	Еврооблигации	Sinopec GRP Overseas DEV	USG8201JAC56	1 860 000 000
11.10.2018	02.05.2023	Еврооблигации	State Grid Overseas Inv	USG8450LAN40	1 860 000 000
12.10.2018	19.10.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD074105	128 922 070 000
12.10.2018	02.05.2023	Еврооблигации	State Grid Overseas Inv	USG8450LAN40	1 850 150 000
12.10.2018	13.09.2027	Еврооблигации	Sinopec GRP Overseas DEV	USG8201NAH55	1 850 150 000
15.10.2018	17.10.2023	Еврооблигации	Sinopec GRP Overseas DEV	USG8200QAB26	1 849 900 000
15.10.2018	14.11.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD284142	80 000 000 000
15.10.2018	24.10.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD074139	45 820 552 600
15.10.2018	22.10.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD074121	150 000 000 000
15.10.2018	01.08.2027	Еврооблигации	Codelco INC	USP3143NAY06	4 809 740 000
16.10.2018	17.10.2023	Еврооблигации	Sinopec GRP Overseas DEV	USG8200QAB26	1 797 614 000
16.10.2018	10.04.2024	Еврооблигации	Sinopec GRP Overseas DEV	USG82003AE76	2 201 160 000
17.10.2018	17.10.2020	Облигации	АО «Евразийский Банк»	KZP02Y02E934	20 000 000 000
17.10.2018	26.10.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD074170	104 058 962 200
18.10.2018	18.11.2050	ГЦБ Перу	Правительство Перу	US715638BM30	4 736 550 000
18.10.2018	21.07.2025	ГЦБ Перу	Правительство Перу	US715638AS19	2 186 100 000
18.10.2018	29.10.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD074204	150 000 000 000
18.10.2018	24.10.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KY010866	20 000 000 000
18.10.2018	25.08.2027	ГЦБ Перу	Правительство Перу	US715638BU55	1 821 750 000
19.10.2018	25.08.2027	ГЦБ Перу	Правительство Перу	US715638BU55	1 832 150 000
19.10.2018	24.10.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KY010866	7 879 892 000
19.10.2018	30.10.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD074212	100 000 000 000
22.10.2018	31.10.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD074220	125 912 938 700
23.10.2018	01.11.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD074246	100 000 000 000
23.10.2018	30.10.2024	Еврооблигации	Empresa Nacional DEL PET	USP37110AJ50	2 528 050 000
23.10.2018	05.08.2026	Еврооблигации	Empresa Nacional DEL PET	USP37110AK24	2 528 050 000
23.10.2018	21.07.2025	ГЦБ Перу	Правительство Перу	US715638AS19	2 094 670 000
24.10.2018	21.01.2024	ГЦБ Филиппин	Правительство Филиппин	US718286BY27	1 463 280 000
24.10.2018	02.11.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD074253	89 525 723 300
24.10.2018	05.08.2026	Еврооблигации	Empresa Nacional DEL PET	USP37110AK24	1 097 460 000
24.10.2018	30.10.2024	Еврооблигации	Empresa Nacional DEL PET	USP37110AJ50	2 926 560 000
25.10.2018	27.01.2023	Облигации	АО «Kaspi Bank»	KZP03Y08E830	2 150 000 000
25.10.2018	05.11.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD074287	150 000 000 000
26.10.2018	06.11.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD074295	150 000 000 000
29.10.2018	28.11.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD284316	150 000 000 000
30.10.2018	08.11.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD074329	100 000 000 000
31.10.2018	09.11.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD074337	100 000 000 000
<b>Итого</b>					<b>3 098 384 405 600</b>

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
15.10.2018	22.03.2024	ГЦБ Турции	Правительство Турции	US900123CF53	15 160 587 007
<b>Итого</b>					<b>15 160 587 007</b>

Таблица 8. Сведения по размещениям во вклады в отчетном месяце

Дата сделки	Дата погашения	Наименование банка	Сумма сделки в тенге
01.10.2018	02.10.2018	Национальный Банк РК	107 000 000 000
02.10.2018	03.10.2018	Национальный Банк РК	94 000 000 000
02.10.2018	29.01.2019	Credit Agricole	54 097 500 000
03.10.2018	04.10.2018	Национальный Банк РК	100 000 000 000
04.10.2018	05.10.2018	Национальный Банк РК	125 000 000 000
05.10.2018	08.10.2018	Национальный Банк РК	60 000 000 000
08.10.2018	09.10.2018	Национальный Банк РК	180 000 000 000
09.10.2018	10.10.2018	Национальный Банк РК	110 000 000 000
11.10.2018	25.10.2018	Bank of Tokyo-Mitsubishi	37 200 000 000

11.10.2018	28.11.2018	Bank of Tokyo-Mitsubishi	37 200 000 000
16.10.2018	17.10.2018	Национальный Банк РК	186 000 000 000
17.10.2018	18.10.2018	Национальный Банк РК	200 000 000 000
18.10.2018	19.10.2018	Национальный Банк РК	276 000 000 000
19.10.2018	22.10.2018	Национальный Банк РК	215 000 000 000
22.10.2018	23.10.2018	Национальный Банк РК	307 000 000 000
23.10.2018	24.10.2018	Национальный Банк РК	212 000 000 000
24.10.2018	25.10.2018	Национальный Банк РК	168 000 000 000
25.10.2018	26.10.2018	Национальный Банк РК	88 000 000 000
25.10.2018	14.02.2019	Natixis	58 798 400 000
26.10.2018	29.10.2018	Национальный Банк РК	123 000 000 000
29.10.2018	30.10.2018	Национальный Банк РК	145 000 000 000
30.10.2018	31.10.2018	Национальный Банк РК	110 000 000 000
31.10.2018	01.11.2018	Национальный Банк РК	185 000 000 000
<b>Итого</b>			<b>3 178 295 900 000</b>

**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
KZW1KD073925	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	01.10.2018	100 000 000 000
KZW1KD073933	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	02.10.2018	100 000 000 000
KZW1KD073941	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	03.10.2018	87 912 860 600
KZW1KD283755	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	03.10.2018	150 000 000 000
KZW1KD073966	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	04.10.2018	100 000 000 000
KZW1KD073974	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	05.10.2018	86 300 458 900
KZW1KD073990	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	08.10.2018	183 794 586 700
KZW1KD074006	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	09.10.2018	100 000 000 000
KZW1KD074014	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	10.10.2018	50 000 000 000
KZW1KD074030	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	11.10.2018	100 000 000 000
KZW1KD074048	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	12.10.2018	100 000 000 000
KZW1KD074055	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	15.10.2018	100 000 000 000
KZW1KD074063	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	16.10.2018	150 000 000 000
KZW1KD074071	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	17.10.2018	89 016 186 100
KZW1KD074097	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	18.10.2018	100 000 000 000
KZW1KD074105	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	19.10.2018	128 922 070 000
KZW1KD074121	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	22.10.2018	150 000 000 000
KZW1KD074139	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	24.10.2018	45 820 552 600
KZW1KY010866	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	24.10.2018	27 879 892 000
US912796QE26	ГЦБ США	Правительство США	26.10.2018	22 112 400 000
KZW1KD074170	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	26.10.2018	104 058 962 200
KZW1KD074204	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	29.10.2018	150 000 000 000
KZKAKY070019	ГЦБ РК	Правительство РК	29.10.2018	15 289 564 000
KZW1KD074212	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	30.10.2018	100 000 000 000
KZKAKY100055	ГЦБ РК	Правительство РК	30.10.2018	14 946 000 000
KZW1KD074220	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	31.10.2018	125 912 938 700
KZW1KD284027	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	31.10.2018	100 000 000 000
<b>Итого</b>				<b>2 581 966 471 800</b>

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

Дата операции	Дата погашения	Наименование банка	Сумма сделки в тенге
01.10.2018	01.10.2018	Национальный Банк РК	190 000 000 000
01.10.2018	01.10.2018	Natixis	71 048 250 000
02.10.2018	02.10.2018	Национальный Банк РК	107 000 000 000
03.10.2018	03.10.2018	Национальный Банк РК	94 000 000 000
04.10.2018	04.10.2018	Национальный Банк РК	100 000 000 000
04.10.2018	04.10.2018	Mizuho	73 440 000 000
05.10.2018	05.10.2018	Национальный Банк РК	125 000 000 000
08.10.2018	08.10.2018	Национальный Банк РК	60 000 000 000
09.10.2018	09.10.2018	Национальный Банк РК	180 000 000 000
10.10.2018	26.10.2019	АО «Банк Kassa Nova»	480 000 000
10.10.2018	10.10.2018	Национальный Банк РК	110 000 000 000
10.10.2018	10.10.2018	Rabobank Nederland	84 801 000 000

15.10.2018	15.10.2018	DBS Bank	36 998 000 000
16.10.2018	03.11.2019	АО «Казкоммерцбанк»	500 000 000
16.10.2018	29.12.2019	АО «Казкоммерцбанк»	500 000 000
17.10.2018	17.10.2018	Национальный Банк РК	186 000 000 000
18.10.2018	18.10.2018	Национальный Банк РК	200 000 000 000
18.10.2018	29.12.2019	АО «ДБ «Альфа-Банк»	388 889
19.10.2018	19.10.2018	Национальный Банк РК	276 000 000 000
22.10.2018	22.10.2018	Национальный Банк РК	215 000 000 000
23.10.2018	23.10.2018	Национальный Банк РК	307 000 000 000
24.10.2018	24.10.2018	Национальный Банк РК	212 000 000 000
25.10.2018	25.10.2018	Национальный Банк РК	168 000 000 000
25.10.2018	25.10.2018	Bank of Tokyo-Mitsubishi	36 749 000 000
26.10.2018	26.10.2018	Национальный Банк РК	88 000 000 000
26.10.2018	03.11.2019	АО «Казкоммерцбанк»	600 000 000
26.10.2018	29.12.2019	АО «Казкоммерцбанк»	150 000 000
29.10.2018	29.10.2018	Национальный Банк РК	123 000 000 000
30.10.2018	30.10.2018	Национальный Банк РК	145 000 000 000
31.10.2018	31.10.2018	Национальный Банк РК	110 000 000 000
<b>Итого</b>			<b>3 301 266 638 889</b>