

Информация по инвестиционному управлению пенсионными активами АО «ЕНПФ»

По состоянию на 1 февраля 2018 года пенсионные активы (далее – ПА) ЕНПФ, находящиеся в доверительном управлении Национального Банка Республики Казахстан (далее – НБРК), составили 7 811,89 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	<i>млрд. тенге</i>				
	Текущая стоимость на 01.01.2018 г.	Доля на 01.01.2018 г.	Текущая стоимость на 01.02.2018 г.	Доля на 01.02.2018 г.	Прирост/снижение с начала года
ГЦБ РК	3 587,63	46,14%	3 473,64	44,47%	-3,18%
ГЦБ иностранных государств	948,84	12,20%	984,89	12,61%	3,80%
МФО	172,55	2,22%	173,54	2,22%	0,57%
Корпоративные облигации эмитентов РК	58,30	0,75%	60,59	0,78%	3,93%
Облигации квазигосударственных организаций РК	791,68	10,18%	789,41	10,11%	-0,29%
Облигации БВУ РК	1 246,49	16,03%	1 235,92	15,82%	-0,85%
Корпоративные облигации иностранных эмитентов	62,74	0,81%	61,28	0,78%	-2,33%
PPN (структурные ноты)	35,00	0,45%	34,33	0,44%	-1,92%
Акции и депозитарные расписки эмитентов РК	184,14	2,37%	208,04	2,66%	12,98%
Акции и депозитарные расписки иностранных эмитентов	23,68	0,30%	25,79	0,33%	8,91%
Депозиты	325,82	4,19%	327,95	4,20%	0,65%
Депозиты в иностранных банках	277,41	3,57%	409,85	5,25%	47,74%
РЕПО	11,02	0,14%	11,00	0,14%	-0,21%
Денежные средства на инвестиционных счетах (за вычетом обязательств по сделкам с финансовыми инструментами)	20,88	0,27%	2,02	0,03%	-90,34%
Прочие активы (дебиторская задолженность ² , просроченная задолженность, провизии)	28,62	0,37%	13,63	0,17%	-52,36%
Итого ПА, находящиеся в управлении НБРК	7 774,82	100,00%	7 811,89	100,00%	0,48%
Деньги на счетах пенсионных взносов и выплат, а также средства для расчетов по сделкам с ФИ	9,51		19,94		
Итого пенсионные активы	7 784,33		7 831,83		0,61%

По состоянию на 01.02.2018 года средневзвешенная доходность к погашению (УТМ) долговых финансовых инструментов, находящихся в инвестиционном портфеле ПА ЕНПФ, составила 7,3% годовых, в том числе по номинированным в тенге – 8,9% годовых, в иностранной валюте – 3,4% годовых.

Государственные ценные бумаги Республики Казахстан

Основную долю в портфеле ПА ЕНПФ занимают ГЦБ РК, текущая стоимость которых за отчетный месяц уменьшилась на 114,00 млрд. тенге и составила 3 473,64 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 44,47%.

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 1 092,01 млрд. тенге со средневзвешенной доходностью 9,14% годовых;
- ГЦБ Министерства финансов РК, номинированные в тенге, в объеме 2,60 млрд. тенге со средневзвешенной доходностью 8,55% годовых;

В отчетном периоде произошло погашение дисконтных нот НБРК на сумму 1 192,04 млрд. тенге.

На отчетную дату средневзвешенная доходность к погашению по ГЦБ РК, номинированным в тенге, составила 7,9% годовых, в долларах США – 4,2% годовых.

Государственные ценные бумаги иностранных государств

Текущая стоимость государственных ценных бумаг иностранных государств за отчетный месяц увеличилась на 36,05 млрд. тенге и составила 984,89 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 12,61%.

В отчетном периоде были приобретены по номинальной стоимости краткосрочные государственные ценные бумаги США в объеме 131,71 млрд. тенге со средневзвешенной доходностью 1,59% годовых, а также среднесрочные государственные ценные бумаги США в объеме 16,12 млрд. тенге со средневзвешенной доходностью 2,50% годовых.

В рамках нового стратегического распределения валютной части портфеля ПА, предусмотренного Инвестиционной декларацией ЕНПФ, приобретены ГЦБ развивающихся стран с рейтингом не ниже «ВВ», номинированные в долларах США, на сумму 122,93 млрд. тенге по номинальной стоимости со средневзвешенной доходностью 4,02%, в том числе:

- ГЦБ Республики Чили в объеме 4,84 млрд. тенге со средневзвешенной доходностью 3,8% годовых;
- ГЦБ Мексики в объеме 42,65 млрд. тенге со средневзвешенной доходностью 4,5% годовых;
- ГЦБ Польши в объеме 15,74 млрд. тенге со средневзвешенной доходностью 3,0% годовых;
- ГЦБ Республики Индонезии в объеме 42,90 млрд. тенге со средневзвешенной доходностью 4,1% годовых;
- ГЦБ Республики Перу в объеме 1,61 млрд. тенге со средневзвешенной доходностью 3,2% годовых;
- ГЦБ Республики Филиппины в объеме 15,20 млрд. тенге со средневзвешенной доходностью 3,6% годовых.

В рассматриваемом периоде осуществлена продажа и погашение ГЦБ США на сумму 69,10 млрд. тенге и 148,89 млрд. тенге соответственно.

Средневзвешенная доходность к погашению ГЦБ иностранных государств в портфеле ПА ЕНПФ на отчетную дату составила 2,9% годовых.

Облигации Международных финансовых организаций

Текущая стоимость облигаций Международных финансовых организаций за отчетный месяц увеличилась на 0,99 млрд. тенге и составила 173,54 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 2,22%.

В отчетном периоде осуществлена выплата основного долга по облигациям Международной финансовой организации на сумму 9,5 млрд. тенге (снижение текущей стоимости произошло в предыдущем месяце).

Продаж и покупок ценных бумаг Международных финансовых организаций не было.

Средневзвешенная доходность к погашению облигаций Международных финансовых организаций в портфеле ПА ЕНПФ на отчетную дату составила 7,2% годовых.

Депозиты в банках второго уровня Республики Казахстан

Текущая стоимость вкладов в БВУ РК, имеющих средневзвешенный срок погашения 5,5 лет, за отчетный месяц увеличилась на 2,13 млрд. тенге и составила 327,95 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 4,20%.

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 10,6% годовых.

Депозиты в иностранных банках

Текущая стоимость вкладов в иностранных банках, имеющих средневзвешенный срок погашения 1,71 месяца, за отчетный месяц увеличилась на 132,44 млрд. тенге и составила 409,85 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 5,25%.

Средневзвешенная доходность к погашению вкладов в иностранных банках на отчетную дату составила 1,7% годовых.

Корпоративные облигации эмитентов Республики Казахстан

Текущая стоимость корпоративных облигаций эмитентов РК за отчетный месяц увеличилась на 2,29 млрд. тенге и составила 60,59 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 0,78%.

В отчетном периоде были приобретены корпоративные облигации эмитентов РК по номинальной стоимости в объеме 2,50 млрд. тенге со средневзвешенной доходностью 11,50% годовых.

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 9,0% годовых.

Облигации квазигосударственных организаций Республики Казахстан

Текущая стоимость облигаций квазигосударственных организаций РК за отчетный месяц уменьшилась на 2,27 млрд. тенге и составила 789,41 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 10,11%.

В рассматриваемом периоде в портфеле ПА ЕНПФ погашений, 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 10,57 млрд. тенге и составила 1 235,92 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 15,82%.

В рассматриваемом периоде в портфеле ПА ЕНПФ погашений, продаж 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 1,46 млрд. тенге и составила 61,28 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 0,78%.

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 уменьшилась на 0,67 млрд. тенге и составила 34,33 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 0,44%.

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 23,90 млрд. тенге и составила 208,04 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 2,66%.

В отчетном месяце были реализованы акции эмитентов РК в объеме 0,54 млрд. тенге.

В отчетном периоде в портфеле ПА ЕНПФ покупок 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 2,11 млрд. тенге и составила 25,79 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 0,33%.

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

Валюта	<i>млрд. тенге</i>				
	Текущая стоимость на 01.01.2018 г.	Доля на 01.01.2018 г.	Текущая стоимость на 01.02.2018 г.	Доля на 01.02.2018 г.	Прирост/снижение с начала года
Национальная валюта	5 619,71	72,28%	5 531,49	70,81%	-1,57%
Доллары США	2 110,34	27,14%	2 235,05	28,61%	5,91%
Российские рубли	36,90	0,47%	36,98	0,47%	0,23%
Другие валюты	7,88	0,10%	8,37	0,11%	6,31%
Итого:	7 774,82	100,00%	7 811,89	100,00%	0,48%

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 январь 2018 года составил 13,22 млрд. тенге. Доходность пенсионных активов ЕНПФ, распределенная на счета вкладчиков (получателей) за январь 2018 года, составила 0,13%.

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

Наименование	<i>млрд. тенге</i>
	Инвестиционный доход за 2018 год
Доходы в виде вознаграждения по ценным бумагам, в том числе по размещенным вкладам и операциям «обратное РЕПО»	44,87
Доходы (убытки) от рыночной переоценки ценных бумаг	28,42
Доходы (убытки) от переоценки иностранной валюты	-57,59

Прочие доходы (убытки)	-2,48
Итого:	13,22

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 01.02.2018г. представлены в Таблице 4.

Таблица 4. Лимиты инвестирования по ПА ЕНПФ

№	Вид финансового инструмента	Фактическое значение (в процентах от ПА)	Выполнение (да/нет)
1	Зарубежные эмитенты:	21,63%	да
1.1	Государственные, агентские и ценные бумаги международных финансовых организаций (МФО):	14,83%	да
1)	с рейтингом не ниже «BBB-» по международной шкале агентства «Standard & Poor's» или рейтингом аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств	10,80%	да
2)	с рейтингом от «BB+» до «BB-» по международной шкале агентства «Standard & Poor's» или рейтингом аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств	4,03%	да
1.2	Корпоративные долговые ценные бумаги:	0,78%	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	0,70%	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	0,33%	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	5,25%	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	0,44%	да
1.7	Инструменты исламского финансирования:	0,00%	да
1)	с рейтинговой оценкой ценной бумаги и/или эмитента не ниже «BBB-» по международной шкале агентства «Standard & Poor's» или рейтинговой оценкой аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств	0,00%	да
2)	с рейтинговой оценкой ценной бумаги и/или эмитента от «BB+» до «BB-» по международной шкале агентства «Standard & Poor's» или рейтинговой оценкой аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств	0,00%	да
2	Казахстанские эмитенты:	77,32%	да
2.1	Государственные ценные бумаги Республики Казахстан, выпущенные Министерством финансов Республики Казахстан, Национальным Банком Республики Казахстан	44,47%	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	11,26%	да
2.3	Финансовые инструменты банков второго уровня Республики Казахстан	21,25%	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 «B-» по международной шкале агентства «Standard & Poor's» или рейтинговой оценкой аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств	0,11%	да
2.4-1	Негосударственные долговые ценные бумаги, выпущенные под гарантию и/или поручительство Правительства Республики Казахстан	0,00%	да

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

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 Казахской фондовой биржи	0,24%	да
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
03.01.2018	31.01.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD281528	90 000 000 000
03.01.2018	05.07.2018	ГЦБ США	Правительство США	US912796PN34	56 659 300 000
03.01.2018	10.01.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD071515	30 002 698 500
04.01.2018	11.01.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD071531	47 843 665 000
05.01.2018	12.01.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD071549	12 161 659 900
08.01.2018	15.01.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD071564	39 000 000 000
10.01.2018	07.02.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD281593	134 079 663 400
11.01.2018	18.01.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD071606	53 497 397 800
11.01.2018	12.07.2018	ГЦБ США	Правительство США	US912796PQ64	75 048 470 000
12.01.2018	19.01.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD071614	29 700 000 000
15.01.2018	22.01.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD071622	18 500 000 000
15.01.2018	17.03.2023	ГЦБ Польши	Правительство Польши	US731011AT95	4 941 150 000
16.01.2018	23.01.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD071630	23 000 000 000
16.01.2018	08.01.2047	ГЦБ Индонезии	Правительство Республики Индонезия	USY20721BR90	1 639 450 000
16.01.2018	01.03.2041	ГЦБ Филиппин	Правительство Республики Филиппин	US718286CA32	1 639 450 000
16.01.2018	02.02.2042	ГЦБ Филиппин	Правительство Республики Филиппин	US718286CB15	1 639 450 000
16.01.2018	16.01.2021	Облигации	АО «KCELL»	KZP01Y03F725	2 500 000 000
17.01.2018	14.02.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD281650	56 031 000 200
17.01.2018	18.07.2027	ГЦБ Индонезии	Правительство Республики Индонезия	USY20721BT56	1 635 500 000
17.01.2018	24.01.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD071648	10 860 532 400
17.01.2018	08.01.2047	ГЦБ Индонезии	Правительство Республики Индонезия	USY20721BR90	1 635 500 000
18.01.2018	25.01.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD071663	91 234 253 500
18.01.2018	06.04.2026	ГЦБ Польши	Правительство Польши	US731011AU68	1 626 000 000
18.01.2018	23.01.2046	ГЦБ Мексики	Правительство Мексики	US91086QBF46	1 626 000 000
18.01.2018	15.01.2024	ГЦБ Индонезии	Правительство Республики Индонезия	USY20721BJ74	3 252 000 000
18.01.2018	28.03.2027	ГЦБ Мексики	Правительство Мексики	US91087BAC46	1 626 000 000
18.01.2018	11.01.2028	ГЦБ Индонезии	Правительство Республики Индонезия	US455780CD62	1 626 000 000
19.01.2018	26.01.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD071671	5 367 159 700
19.01.2018	20.01.2040	ГЦБ Филиппин	Правительство Республики Филиппин	US718286BZ91	1 621 350 000
19.01.2018	23.01.2046	ГЦБ Мексики	Правительство Мексики	US91086QBF46	6 485 400 000
19.01.2018	11.01.2048	ГЦБ Индонезии	Правительство Республики Индонезия	US455780CE46	1 621 350 000
22.01.2018	29.01.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD071697	107 700 000 000
22.01.2018	15.01.2047	ГЦБ Мексики	Правительство Мексики	US91087BAB62	3 246 500 000
22.01.2018	30.01.2025	ГЦБ Мексики	Правительство Мексики	US91087BAA89	4 869 750 000
22.01.2018	28.03.2027	ГЦБ Мексики	Правительство Мексики	US91087BAC46	1 623 250 000
22.01.2018	06.04.2026	ГЦБ Польши	Правительство Польши	US731011AU68	3 246 500 000
23.01.2018	30.01.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD071705	38 900 000 000
23.01.2018	27.09.2034	ГЦБ Мексики	Правительство Мексики	US91086QAS75	1 616 000 000
23.01.2018	11.01.2023	ГЦБ Индонезии	Правительство Республики Индонезия	US455780CC89	3 232 000 000
23.01.2018	30.03.2026	ГЦБ Филиппин	Правительство Республики Филиппин	US718286BN61	3 232 000 000
24.01.2018	21.02.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD281726	115 135 716 700
24.01.2018	02.02.2042	ГЦБ Филиппин	Правительство Республики Филиппин	US718286CB15	1 605 350 000
24.01.2018	15.01.2045	ГЦБ Индонезии	Правительство Республики Индонезия	USY20721BM04	3 531 770 000

24.01.2018	11.01.2040	ГЦБ Мексики	Правительство Мексики	US91086QAV05	1 605 350 000
24.01.2018	15.01.2044	ГЦБ Индонезии	Правительство Республики Индонезия	USY20721BK48	1 605 350 000
24.01.2018	08.01.2047	ГЦБ Индонезии	Правительство Республики Индонезия	USY20721BR90	4 816 050 000
24.01.2018	08.03.2044	ГЦБ Мексики	Правительство Мексики	US91086QBB32	3 210 700 000
24.01.2018	08.01.2047	ГЦБ Индонезии	Правительство Республики Индонезия	USY20721BR90	1 605 350 000
25.01.2018	01.02.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD071739	90 000 000 000
25.01.2018	22.01.2024	ГЦБ Польши	Правительство Польши	US857524AC63	3 198 300 000
25.01.2018	23.01.2046	ГЦБ Мексики	Правительство Мексики	US91086QBF46	2 238 810 000
25.01.2018	30.03.2026	ГЦБ Филиппин	Правительство Республики Филиппин	US718286BN61	959 490 000
25.01.2018	08.01.2026	ГЦБ Индонезии	Правительство Республики Индонезия	USY20721BN86	1 599 150 000
25.01.2018	02.02.2042	ГЦБ Филиппин	Правительство Республики Филиппин	US718286CB15	1 599 150 000
26.01.2018	22.01.2024	ГЦБ Польши	Правительство Польши	US857524AC63	1 122 310 000
26.01.2018	06.04.2026	ГЦБ Польши	Правительство Польши	US731011AU68	1 603 300 000
26.01.2018	11.01.2040	ГЦБ Мексики	Правительство Мексики	US91086QAV05	1 923 960 000
26.01.2018	08.01.2047	ГЦБ Индонезии	Правительство Республики Индонезия	USY20721BR90	1 603 300 000
26.01.2018	11.01.2028	ГЦБ Индонезии	Правительство Республики Индонезия	US455780CD62	1 603 300 000
29.01.2018	19.03.2022	ГЦБ РК	Правительство РК	KZKDKY100110	2 600 000 000
29.01.2018	02.02.2042	ГЦБ Филиппин	Правительство Республики Филиппин	US718286CB15	2 900 250 000
29.01.2018	23.01.2046	ГЦБ Мексики	Правительство Мексики	US91086QBF46	1 611 250 000
29.01.2018	08.01.2026	ГЦБ Индонезии	Правительство Республики Индонезия	USY20721BN86	3 222 500 000
29.01.2018	15.01.2044	ГЦБ Индонезии	Правительство Республики Индонезия	USY20721BK48	6 122 750 000
29.01.2018	08.01.2047	ГЦБ Индонезии	Правительство Республики Индонезия	USY20721BR90	2 545 775 000
30.01.2018	06.02.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD071770	77 000 000 000
30.01.2018	31.01.2023	ГЦБ США	Правительство США	US9128283U26	16 121 500 000
30.01.2018	23.01.2046	ГЦБ Мексики	Правительство Мексики	US91086QBF46	8 383 180 000
30.01.2018	21.01.2045	ГЦБ Мексики	Правительство Мексики	US91086QBE70	1 612 150 000
30.01.2018	21.01.2026	ГЦБ Мексики	Правительство Мексики	US91086QBG29	967 290 000
30.01.2018	25.08.2027	ГЦБ Перу	Правительство Республики Перу	US715638BU55	1 612 150 000
30.01.2018	30.10.2042	ГЦБ Чили	Правительство Республики Чили	US168863BP27	1 612 150 000
30.01.2018	21.06.2047	ГЦБ Чили	Правительство Республики Чили	US168863CE60	3 224 300 000
31.01.2018	28.02.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD281791	22 000 000 000
Итого					1 367 868 352 100

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
09.01.2018	-	Акции	АО «МРЭК»	KZ1C24600013	544 362 000
16.01.2018	08.02.2018	ГЦБ США	Правительство США	US912796NR65	4 259 261 774
19.01.2018	08.02.2018	ГЦБ США	Правительство США	US912796NR65	16 203 891 251
23.01.2018	15.02.2018	ГЦБ США	Правительство США	US912796NS49	32 295 804 889
26.01.2018	15.02.2018	ГЦБ США	Правительство США	US912796NS49	16 344 392 926
Итого					69 647 712 840

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

Дата сделки	Дата погашения	Наименование банка	Сумма сделки в тенге
04.01.2018	05.02.2018	Credit Agricole	74 129 660 000
09.01.2018	09.04.2018	Natixis	50 860 040 000
31.01.2018	29.06.2018	Rabobank Nederland	35 841 900 000
31.01.2018	31.05.2018	Bank of Tokyo-Mitsubishi	48 435 000 000
31.01.2018	30.03.2018	Bank of Montreal	35 841 900 000
31.01.2018	30.04.2018	Mizuho Corporate Bank	48 435 000 000
Итого			293 543 500 000

Таблица 9. Сведения по погашениям основного долга по ценным бумагам в отчетном месяце

НИН (ISIN)	Вид инструмента	Эмитент ценной бумаги	Дата фактического погашения	Сумма к погашению в тенге
KZW1KD081449	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	03.01.2018	33 900 000 000
KZW1KD281288	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	03.01.2018	83 257 887 800
KZW1KD071473	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	04.01.2018	91 900 000 000
US912796LC15	ГЦБ США	Правительство США	04.01.2018	56 511 400 000
KZP01Y05E384	Облигации	Евразийский банк развития	10.01.2018	9 500 000 000
KZW1KD071515	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	10.01.2018	30 002 698 500
KZW1KD281353	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	10.01.2018	116 681 787 500

KZW1KD071531	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	11.01.2018	47 843 665 000
KZW1KD071549	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	12.01.2018	12 161 659 900
US912796ML05	ГЦБ США	Правительство США	12.01.2018	73 846 080 000
KZW1KD071564	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	15.01.2018	39 000 000 000
KZW1KD281403	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	17.01.2018	161 929 792 300
KZW1KD071606	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	18.01.2018	53 497 397 800
US912796NN51	ГЦБ США	Правительство США	18.01.2018	18 536 400 000
KZW1KD071614	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	19.01.2018	29 700 000 000
KZW1KD071622	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	22.01.2018	18 500 000 000
KZW1KD071630	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	23.01.2018	23 000 000 000
KZW1KD281460	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	24.01.2018	106 600 000 000
KZW1KD071648	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	24.01.2018	10 860 532 400
KZW1KD071663	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	25.01.2018	91 234 253 500
KZW1KD071671	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	26.01.2018	5 367 159 700
KZW1KD071697	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	29.01.2018	107 700 000 000
KZW1KD071705	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	30.01.2018	38 900 000 000
KZW1KD281528	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	31.01.2018	90 000 000 000
Итого				1 350 430 714 400

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

Дата выплаты	Дата закрытия	Наименование банка	Сумма к погашению в тенге
03.01.2018	03.01.2018	Mizuho Corporate Bank	54 326 270 000
09.01.2018	09.01.2018	Bank of Tokyo-Mitsubishi	49 869 260 000
31.01.2018	31.01.2018	ING Bank	24 217 500 000
31.01.2018	31.01.2018	Societe Generale Paris	24 217 500 000
Итого			152 630 530 000