

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

2018 жылғы 1 сәуірдегі жағдай бойынша Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкінің басқаруындағы (бұдан әрі – ҚРҰБ) БЖЗҚ зейнетақы активтері (бұдан әрі – ЗА) 7 975,51 млрд. теңге<sup>1</sup> құрады.

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

### 1-кесте. Қаржы құралдарының бөлігінде ҚРҰБ сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфельінің құрылымы

млрд. теңге

Атауы	01.01.2018 жылға ағымдағы құны	01.01.2018 жылға үлесі	01.04.2018 жылға ағымдағы құны	01.04.2018 жылға үлесі	Жыл басынан өсуі/төмендеуі %
ҚР МБҚ	3 587,63	46,14%	3 580,47	44,89%	-0,20%
Шетелдік мемлекеттердің МБҚ	948,84	12,20%	1 105,56	13,86%	16,52%
ХҚҰ	172,55	2,22%	171,92	2,16%	-0,36%
ҚР эмитенттерінің корпоративтік облигациялары	58,30	0,75%	60,31	0,76%	3,46%
ҚР квазимемлекеттік ұйымдардың облигациялары	791,68	10,18%	794,41	9,96%	0,34%
ҚР ЕДБ облигациялары	1 246, 49	16,03%	1 229,20	15,41%	-1,39%
Шетелдік эмитенттердің корпоративтік облигациялары	62,74	0,81%	59,61	0,75%	-5,00%
PPN (құрылымдық ноталар)	35,00	0,45%	33,89	0,42%	-3,17%
ҚР эмитенттерінің акциялары және депозитарлық қолхаттары	184,14	2,37%	162,69	2,04%	-11,65%
Шетелдік эмитенттердің акциялары және депозитарлық қолхаттары	23,68	0,30%	24,82	0,31%	4,78%
Депозиттер	325,82	4,19%	323,23	4,05%	-0,80%
Шетелдік банктердегі депозиттер	277,41	3,57%	243,46	3,05%	-12,24%
РЕПО	11,02	0,14%	23,11	0,29%	109,60%
Инвестициялық шоттардағы ақшалай қаражат	20,88	0,27%	84,76	1,06%	305,94%
Басқа активтер (дебиторлық берешек <sup>2</sup> , мерзімі өткен берешек, провизиялар)	28,62	0,37%	8,05	0,10%	-
Aviva Investors Global Services Limited* сыртқы басқаруындағы активтер	-	-	70,03	0,88%	-
<b>ҚРҰБ басқаруындағы ЗА жиынтығы</b>	<b>7 774,82</b>	<b>100,00%</b>	<b>7 975,51</b>	<b>100,00%</b>	<b>2,58%</b>
Зейнетақы жарналары және төлемдері шоттарындағы ақшалар	9,51		2,22		
<b>Зейнетақы активтерінің жиыны</b>	<b>7 784,33</b>		<b>7 977,73</b>		<b>2,48%</b>

\*- «Дамушы нарықтардың жаһандық облигациялары» мандатының аясында

БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфельіндегі борыштық қаржы құралдарын өтеуге орташа алынған кірістілік (YTM) 01.04.2018 жылғы жағдай бойынша жылдық 7,2% құрады, оның ішінде теңгеге номинирленген – жылдық 8,7%, шетелдік валютада – жылдық 3,8%.

### Қазақстан Республикасының мемлекеттік бағалы қағаздары

БЖЗҚ ЗА портфельінде негізгі үлесті ҚР МБҚ құрайды, олардың есепті айдағы ағымдағы құны 112,03 млрд. теңгеге ұлғайды және 3 580,47 млрд. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 44,89% құрады.

Есепті кезеңде номинал құны бойынша мынадай қаржы құралдары сатып алынды:

- 915,16 млрд. теңге көлеміндегі ҚРҰБ қысқа мерзімді дисконт ноттарының орташа алынған кірістілігі жылдық 8,67%;

<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 кіреді.

- 53,19 млрд. теңге көлеміндегі АҚШ долларына номинирленген ҚР Қаржы министрлігінің МБҚ-ның орташа алынған кірістілігі жылдық 4,86%;

- 20,00 млрд. теңге көлеміндегі теңгеге номинирленген ҚР Қаржы министрлігінің МБҚ-ның орташа алынған кірістілігі жылдық 8,60%;

Есепті кезеңде 889,76 млрд. теңге сомасына ҚРҰБ дисконт ноттары өтелді.

Есепті күнге теңгеге номинирленген ҚР МБҚ бойынша өтеуге орташа алынған кірістілік жылдық 7,6%, АҚШ долларымен – жылдық 4,3% құрады.

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

Есепті ай үшін шетелдік мемлекеттердің мемлекеттік бағалы қағаздарының ағымдағы құны 19,15 млрд. теңгеге ұлғайды және 1 105,56 млрд. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 13,86% құрады.

Есепті кезеңде орташа алынған кірістілік жылдық 1,87% құрайтын номинал құны бойынша 95,91 млрд.теңге көлемінде АҚШ қысқа мерзімді мемлекеттік бағалы қағаздары, сондай-ақ орташа алынған кірістілік жылдық 2,71% құрайтын 48,09 млрд. теңге көлемінде АҚШ орта мерзімді мемлекеттік бағалы қағаздары сатып алынды.

Қаралып отырған кезеңде 113,97 млрд. теңге сомасына шетелдік мемлекеттердің мемлекеттік бағалы қағаздары өтелді. Шетелдік мемлекеттердің мемлекеттік бағалы қағаздары сатылмады.

Есепті күнге БЖЗҚ ЗА портфельіндегі шетелдік мемлекеттердің МБҚ өтеуге орташа алынған кірістілігі жылдық 3,1% құрады.

### **Халықаралық қаржы ұйымдарының облигациялары**

Есепті айда Халықаралық қаржы ұйымдары облигацияларының ағымдағы құны 0,93 млрд. теңгеге кеміді және 171,92 млрд. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 2,16% құрады.

Халықаралық қаржы ұйымдарының бағалы қағаздары сатылмады, өтелмеді және сатып алынбады.

Есепті кезеңде БЖЗҚ ЗА портфельінде Халықаралық қаржы ұйымдарының облигацияларын өтеуге орташа алынған кірістілік жылдық 6,9% құрады.

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

Орташа алынған өтеу мерзімі 5,3 жыл болатын ҚР ЕДБ салымдарының ағымдағы құны есепті айда 4,05 млрд. теңгеге кеміді және 323,23 млрд. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 4,05% құрады.

Есепті кезеңде сомасы 1,39 млрд.теңге ҚР ЕДБ салымдары мерзімінен бұрын өтелді.

Есепті кезеңде БЖЗҚ ЗА ЕДБ салымдарға орналастырылмады.

Есепті күнге ҚР ЕДБ салымдарын өтеуге орташа алынған кірістілік жылдық 10,6% құрады.

### **Шетелдік банктердегі депозиттер**

Орташа алынған өтеу мерзімі 1,83 ай болатын есепті айда шетелдік банктердегі салымдардың ағымдағы құны 60,19 млрд. теңгеге кеміді және 243,46 млрд. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 3,05% құрады.

Есепті күнде шетелдік банктердегі салымдарды өтеуге орташа алынған кірістілік жылдық 1,9% құрады.

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

Есепті айда ҚР эмитенттерінің корпоративтік облигацияларының ағымдағы құны 0,54 млрд. теңгеге кеміді және 60,31 млрд. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 0,76% құрады.

Есепті кезеңде ҚР эмитенттерінің корпоративтік облигациялары өтелмеді, сатып алынбады және сатылмады.

Есепті күнге БЖЗҚ ЗА портфелінде ҚР эмитенттерінің корпоративтік облигацияларын өтеуге орташа алынған кірістілік жылдық 8,7% құрады.

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

Есепті айда ҚР квазимемлекеттік ұйымдардың облигацияларының ағымдағы құны 3,23 млрд. теңгеге ұлғайды және 794,41 млрд. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 9,96% құрады.

Қаралып отырған кезеңде БЖЗҚ ЗА портфелінде ҚР квазимемлекеттік ұйымдарының облигациялары өтелмеді, сатылмады және сатып алынбады.

Есепті күнге ҚР квазимемлекеттік ұйымдарының облигациялары бойынша өтеуге орташа алынған кірістілік теңгеге номинирленген жылдық 11,7%, АҚШ долларына – жылдық 5,3% құрады.

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

Есепті айда ҚР ЕДБ облигацияларының ағымдағы құны 6,50 млрд. теңгеге ұлғайды және 1 229,20 млрд. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 15,41% құрады.

Қаралып отырған кезеңде БЖЗҚ ЗА портфелінде ҚР ЕДБ облигациялары өтелмеді, сатылмады және сатып алынбады.

Есепті күнге теңгеге номинирленген ҚР ЕДБ облигациялары бойынша орташа алынған кірістілік жылдық 10,0%, АҚШ долларына – жылдық 7,0% құрады.

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

Есепті айда шетелдік эмитенттердің корпоративтік облигацияларының ағымдағы құны 0,31 млрд. теңгеге кеміді және 59,61 млрд. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 0,75% құрады.

Есепті кезеңде БЖЗҚ ЗА портфелінде шетелдік эмитенттердің корпоративтік облигациялары сатып алынбады, сатылмады және өтелмеді.

Есепті күнге БЖЗҚ ЗА портфелінде шетелдік эмитенттердің корпоративтік облигацияларын өтеуге орташа алынған кірістілік жылдық 5,8% құрады.

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

Есепті айда шетелдік эмитенттердің PPN (құрылымдық ноттар) ағымдағы құны 0,28 млрд. теңгеге кеміді және 33,89 млрд. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 0,42% құрады.

Есепті кезеңде БЖЗҚ ЗА портфелінде шетелдік эмитенттердің PPN (құрылымдық ноттар) сатып алынбады, сатылмады және өтелмеді.

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

Есепті айда ҚР эмитенттері акцияларының және депозитарлық қолхаттарының ағымдағы құны 4,23 млрд. теңгеге ұлғайды және 162,69 млрд. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 2,04% құрады.

Есепті айда 0,12 млрд. теңге көлемінде ҚР эмитенттерінің акциялары өткізілді, сондай-ақ «Қазкоммерцбанк» АҚ акционерлерінің кезектен тыс жалпы жиналысының шешіміне сай БЖЗҚ зейнетақы активтері портфеліндегі жай акцияларға осы эмитенттің артықшылықты акциялары конвертацияланды.

Есепті кезеңде БЖЗҚ ЗА портфелінде ҚР эмитенттерінің акциялары мен депозитарлық қолхаттары сатып алынбады.

#### **Шетелдік эмитенттердің акциялары және депозитарлық қолхаттары**

Есепті айда шетелдік эмитенттердің акциялары мен депозитарлық қолхаттарының ағымдағы құны 1,25 млрд. теңгеге кеміді және 24,82 млрд. теңгені құрады. Олардың портфельдегі үлесі 0,31% құрады.

Есепті кезеңде шетелдік эмитенттердің акциялары мен депозитарлық қолхаттары сатылмады, сондай-ақ сатып алынбады.

### Зейнетақы активтерін сыртқы сенімгерлік басқару

БЖЗҚ-ның Инвестициялық декларациясында көзделген ЗА портфелінің валюталық бөлігін жаңа стратегиялық бөлу аясында 2018 жылғы 12 наурызда 220,0 млн. Доллар мөлшерінде Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкінің сенімгерлікпен басқаруындағы БЖЗҚ зейнетақы активтерінің бөлігі «Дамушы нарықтардың жаһандық облигациялары» мандаты бойынша Aviva Investors Global Services Limited сыртқы басқарушыға берілді.

Бұл компания Лондон қаласында орналасқан және Aviva plc британдық топтың активтерін басқару бойынша бөлімше болып табылады. Aviva plc басқаруындағы активтердің көлемі 437 млрд. астам АҚШ долларын құрайды. Компания инвестициялардың әртүрін, оның ішінде акцияларға, облигацияларға, жылжымайтын мүлікке және т.б. инвестицияларды басқарады.

Индекс көрсетілген мандат аясында эталон портфель болып табылады, оған 2018 жылғы 01 сәуірдегі жағдай бойынша Латын Америкасына және Шығыс Еуропаға, Оңтүстік-Шығыс Азияға және т.б. жататын рейтингісі «BB» төмен емес 29 дамушы елдердің 251 бағалы қағаздарының шығарылымы кіреді.

### Валюталық құрылым

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

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

Валюта	<i>млрд. теңге</i>				
	01.01.2018 жылға ағымдағы құны	01.01.2018 жылға үлесі	01.04.2018 жылға ағымдағы құны	01.04.2018 жылға үлесі	Жыл басынан өсуі/төмендеуі, %
Ұлттық валюта	5 619,71	72,28%	5 536,61	69,42%	-1,48%
АҚШ доллары	2 110,34	27,14%	2 395,12	30,03%	13,49%
Ресей рублі	36,90	0,47%	35,77	0,45%	-3,06%
Басқа валюталар	7,88	0,10%	8,01	0,10%	1,77%
<b>Жиыны:</b>	<b>7 774,82</b>	<b>100,00%</b>	<b>7 975,51</b>	<b>100,00%</b>	<b>2,58%</b>

### Инвестициялық қызметтің нәтижелері

Инвестициялық қызметтің нәтижесінде, сондай-ақ шетелдік валюталар бағамының құбылмалылығы салдарынан және қаржы құралдарының нарықтық құнының өзгеруі нәтижесінде 2018 жылдың басынан есептелген инвестициялық табыс көлемі 75,84 млрд. теңгені құрады. Салымшылардың (алушылардың) шоттарына бөлінген БЖЗҚ зейнетақы активтерінің табыстылығы 2018 жылдың басынан бастап 0,85% құрады.

Көрсетілген кезеңге есептелген инвестициялық табыс құрылымы 3-кестеде көрсетілген.

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

Атауы	2018 жыл үшін инвестициялық табыс
Бағалы қағаздар, орналастырылған салымдар және «кері РЕПО» операциялары бойынша сыйақы түріндегі табыстар	130,94
Бағалы қағаздарды нарықтық қайта бағалаудан табыстар (шығындар)	27,79
Шетелдік валютаны қайта бағалаудан табыстар (шығындар)	-90,57
Басқа табыстар (шығындар)	7,68
<b>Жиыны:</b>	<b>75,84</b>

### Инвестициялық декларация параметрлерін сақтау туралы ақпарат

Сенімгерлік басқарудағы БЖЗҚ<sup>3</sup> ЗА құрылымдық үлестіруі БЖЗҚ Инвестициялық декларациясының талаптарына сәйкес келеді. Валюталық позициялар үлесі рұқсат етілген деңгей шегінде қалады және БЖЗҚ Инвестициялық декларациясының талаптарын бұзбайды. 01.04.2018 жылғы жағдай бойынша БЖЗҚ ЗА бойынша инвестициялау лимиттерін сақтау туралы деректер 4-кестеде көрсетілген.

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

№	Қаржы құралдарының түрі	Нақты мәні (зейнетақы активтерінен пайызбен)	Орындалуы (иә/жоқ)
<b>1</b>	<b>Шетелдік эмитенттер:</b>	<b>20,74%</b>	<b>иә</b>
1.1	Мемлекеттік, агенттік және халықаралық қаржы ұйымдарының (ХҚҰ) бағалы қағаздары:	16,16%	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	12,37%	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	3,79%	иә
1.2	Корпоративтік борыштық бағалы қағаздар:	0,75%	иә
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	0,08%	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	0,67%	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	0,00%	иә
1.4	Акциялар, акцияларға депозитарлық қолхаттар	0,31%	иә
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)	3,08%	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	0,43%	иә
1.7	Ислам қаржыландыру құралдары:	0,00%	иә
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>77,11%</b>	<b>иә</b>
2.1	Қазақстан Республикасының Қаржы министрлігі, Қазақстан Республикасының Ұлттық Банкі шығарған Қазақстан Республикасының мемлекеттік бағалы қағаздары	45,29%	иә
2.1-1	Қазақстан Республикасының жергілікті атқарушы органдары шығарған Қазақстан Республикасының мемлекеттік бағалы қағаздары	0,00%	иә
2.1-2	Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкінің депозиттері	0,00%	иә
2.2	Квзимемлекеттік сектор субъектілерінің бағалы қағаздары	10,55%	иә
2.3	Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банктерінің қаржы құралдары	20,93%	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	0,11%	иә
2.4-1	Қазақстан Республикасы Үкіметінің кепілдігі және/немесе кепілдемесімен шығарылған мемлекеттік емес борышты бағалы қағаздары	0,00%	иә
2.5	Қазақстан қор биржасының ресми тізімінің бірінші санатына кіретін Қазақстан Республикасының квазимемлекеттік секторы мен екінші деңгейдегі банктері	0,22%	иә

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

	субъектілерінің үлесті бағалы қағаздарын қоспағанда мемлекеттік емес үлесті бағалы қағаздары		
2.6	Қазақстан қор биржасының ресми тізіміне енгізілген ислам қаржыландыру құралдары	0,00%	иә

### 5-кесте. Қаржы құралдарының жекелеген түрлеріне БЖЗҚ ЗА бойынша инвестициялау лимиттері

№	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	Күймадағы 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	ҰСН (ISIN)	Теңгемен номиналды құны
01.03.2018	21.07.2045	ҚР МБҚ	ҚР Үкіметі	XS1263139856	11 086 230 000
01.03.2018	13.03.2018	ҚР МБҚ	ҚР Ұлттық Банкі	KZWIKD122094	23 800 000 000
02.03.2018	14.03.2018	ҚР МБҚ	ҚР Ұлттық Банкі	KZWIKD122102	26 450 000 000
02.03.2018	21.07.2045	ҚР МБҚ	ҚР Үкіметі	XS1263139856	12 412 015 000
05.03.2018	12.03.2018	ҚР МБҚ	ҚР Ұлттық Банкі	KZWIKD072125	97 000 000 000
07.03.2018	14.10.2024	ҚР МБҚ	ҚР Үкіметі	XS1120709669	3 201 900 000
07.03.2018	21.07.2045	ҚР МБҚ	ҚР Үкіметі	XS1263139856	7 684 560 000
07.03.2018	14.10.2044	ҚР МБҚ	ҚР Үкіметі	XS1120709826	1 600 950 000
07.03.2018	04.04.2018	ҚР МБҚ	ҚР Ұлттық Банкі	KZWIKD282153	105 865 083 500
12.03.2018	19.03.2018	ҚР МБҚ	ҚР Ұлттық Банкі	KZWIKD072166	107 900 000 000
13.03.2018	20.03.2018	ҚР МБҚ	ҚР Ұлттық Банкі	KZWIKD072174	25 400 000 000
13.03.2018	21.07.2045	ҚР МБҚ	ҚР Үкіметі	XS1263139856	5 788 800 000
13.03.2018	14.10.2044	ҚР МБҚ	ҚР Үкіметі	XS1120709826	1 929 600 000
14.03.2018	21.07.2045	ҚР МБҚ	ҚР Үкіметі	XS1263139856	3 863 760 000
14.03.2018	11.04.2018	ҚР МБҚ	ҚР Ұлттық Банкі	KZWIKD282195	104 108 300 800
15.03.2018	27.03.2018	ҚР МБҚ	ҚР Ұлттық Банкі	KZWIKD122201	14 100 000 000
15.03.2018	21.07.2045	ҚР МБҚ	ҚР Үкіметі	XS1263139856	1 608 900 000
16.03.2018	14.10.2044	ҚР МБҚ	ҚР Үкіметі	XS1120709826	1 613 600 000
19.03.2018		Жай акциялар*	«Қазкоммерцбанк» АҚ	KZ1C00400016	195 509 222
19.03.2018	28.02.2025	АҚШ МБҚ	АҚШ Үкіметі	US9128283Z13	16 030 000 000
19.03.2018	26.03.2018	ҚР МБҚ	ҚР Ұлттық Банкі	KZWIKD072232	108 600 000 000
19.03.2018	21.07.2045	ҚР МБҚ	ҚР Үкіметі	XS1263139856	2 404 500 000
19.03.2018	28.06.2018	АҚШ МБҚ	АҚШ Үкіметі	US912796PM50	32 060 000 000
19.03.2018	28.02.2023	АҚШ МБҚ	АҚШ Үкіметі	US9128284A52	32 060 000 000
20.03.2018	27.03.2018	ҚР МБҚ	ҚР Ұлттық Банкі	KZWIKD072240	23 500 000 000
20.03.2018	13.08.2029	ҚР МБҚ	ҚР Үкіметі	KZKDKY150118	20 000 000 000
26.03.2018	06.09.2018	АҚШ МБҚ	АҚШ Үкіметі	US912796PY98	31 926 000 000
26.03.2018	20.09.2018	АҚШ МБҚ	АҚШ Үкіметі	US912796PZ63	31 926 000 000
26.03.2018	02.04.2018	ҚР МБҚ	ҚР Ұлттық Банкі	KZWIKD072257	96 157 026 900
27.03.2018	03.04.2018	ҚР МБҚ	ҚР Ұлттық Банкі	KZWIKD072265	40 000 000 000
28.03.2018	25.04.2018	ҚР МБҚ	ҚР Ұлттық Банкі	KZWIKD282286	116 280 306 200
29.03.2018	05.04.2018	ҚР МБҚ	ҚР Ұлттық Банкі	KZWIKD072299	26 000 000 000
<b>Жиыны</b>					<b>1 132 553 042 322</b>

\* - конвертация

#### 7-кесте. Есепті айда қаржы құралдарын сату/конвертациялау бойынша мәлімет

Мәміле жасалған күн	Өтеу күні	Құрал түрі	Бағалы қағаз эмитенті	ҰСН (ISIN)	Мәміле сомасы теңгемен
14.03.2018	сату	Артықшылықты акциялар	«Банк ЦентрКредит» АҚ	KZ1P36280116	124 245 600
19.03.2018	конвертация	Артықшылықты акциялар	«Қазкоммерцбанк» АҚ	KZ1P00400211	207 977 354
<b>Жиыны</b>					<b>332 222 954</b>

**8-кесте. Есепті айда шетелдік банктердегі орналастырылған салымдар бойынша мәліметтер**

Мәміле күні	Өтеу күні	Банк атауы	Тенгемен мәміле сомасы
29.03.2018	27.06.2018	Bank of Tokyo-Mitsubishi, LTD.	63 165 960 000
<b>Жиыны</b>			<b>63 165 960 000</b>

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

ҮСН (ISIN)	Құрал түрі	Бағалы қағаз эмитенті	Нақты өтелген күн	Тенгемен өтелетін сома
KZW1KD072034	ҚР МБҚ	ҚР Ұлттық Банкі	02.03.2018	22 997 642 900
KZW1KD072059	ҚР МБҚ	ҚР Ұлттық Банкі	05.03.2018	95 400 000 000
KZW1KD281858	ҚР МБҚ	ҚР Ұлттық Банкі	07.03.2018	100 000 000 000
KZW1KD072125	ҚР МБҚ	ҚР Ұлттық Банкі	12.03.2018	97 000 000 000
KZW1KD122094	ҚР МБҚ	ҚР Ұлттық Банкі	13.03.2018	23 800 000 000
KZW1KD122102	ҚР МБҚ	ҚР Ұлттық Банкі	14.03.2018	26 450 000 000
KZW1KD281932	ҚР МБҚ	ҚР Ұлттық Банкі	14.03.2018	85 700 000 000
RU000A0JRCJ6	РФ МБҚ	РФ Үкіметі	15.03.2018	2 260 000 000
XS0564087541	РФ МБҚ	РФ Үкіметі	15.03.2018	1 610 250 000
KZW1KD072166	ҚР МБҚ	ҚР Ұлттық Банкі	19.03.2018	107 900 000 000
KZW1KD072174	ҚР МБҚ	ҚР Ұлттық Банкі	20.03.2018	25 400 000 000
KZW1KD332016	ҚР МБҚ	ҚР Ұлттық Банкі	26.03.2018	94 255 546 300
KZW1KD072232	ҚР МБҚ	ҚР Ұлттық Банкі	26.03.2018	108 600 000 000
US912796NX34	АҚШ МБҚ	АҚШ Үкіметі	26.03.2018	48 208 260 000
KZW1KD122201	ҚР МБҚ	ҚР Ұлттық Банкі	27.03.2018	14 100 000 000
KZW1KD072240	ҚР МБҚ	ҚР Ұлттық Банкі	27.03.2018	23 500 000 000
KZW1KD282088	ҚР МБҚ	ҚР Ұлттық Банкі	28.03.2018	64 654 951 000
US912796LS66	АҚШ МБҚ	АҚШ Үкіметі	29.03.2018	61 889 880 000
<b>Жиыны</b>				<b>1 003 726 530 200</b>

**10-кесте. Есепті айдағы салымдар бойынша негізгі борышты өтеу жөніндегі мәліметтер**

Төлеу күні	Жабу күні	Банк атауы	Өтеуге сома тенгемен
12.03.2018	12.03.2018	Bank of Tokyo-Mitsubishi, LTD.	43 274 250 000
20.03.2018	20.03.2018	Bank of Montreal	43 245 900 000
30.03.2018	30.03.2018	Bank of Montreal	35 332 410 000
30.03.2018	27.10.2019	«Capital Bank Kazakhstan»* АҚ	1 391 000 000
<b>Жиыны</b>			<b>123 243 560 000</b>

\* - салымды ішінара өтеу

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

По состоянию на 1 апреля 2018 года пенсионные активы (далее – ПА) ЕНПФ, находящиеся в доверительном управлении Национального Банка Республики Казахстан (далее – НБРК), составили 7 975,51 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 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 01.04.2018 г.	Доля на 01.04.2018 г.	Прирост/снижение с начала года
ГЦБ РК	3 587,63	46,14%	3 580,47	44,89%	-0,20%
ГЦБ иностранных государств	948,84	12,20%	1 105,56	13,86%	16,52%
МФО	172,55	2,22%	171,92	2,16%	-0,36%
Корпоративные облигации эмитентов РК	58,30	0,75%	60,31	0,76%	3,46%
Облигации квазигосударственных организаций РК	791,68	10,18%	794,41	9,96%	0,34%
Облигации БВУ РК	1 246,49	16,03%	1 229,20	15,41%	-1,39%
Корпоративные облигации иностранных эмитентов	62,74	0,81%	59,61	0,75%	-5,00%
PPN (структурные ноты)	35,00	0,45%	33,89	0,42%	-3,17%
Акции и депозитарные расписки эмитентов РК	184,14	2,37%	162,69	2,04%	-11,65%
Акции и депозитарные расписки иностранных эмитентов	23,68	0,30%	24,82	0,31%	4,78%
Депозиты	325,82	4,19%	323,23	4,05%	-0,80%
Депозиты в иностранных банках	277,41	3,57%	243,46	3,05%	-12,24%
РЕПО	11,02	0,14%	23,11	0,29%	109,60%
Денежные средства на инвестиционных счетах	20,88	0,27%	84,76	1,06%	305,94%
Прочие активы (дебиторская задолженность <sup>5</sup> , просроченная задолженность, провизии)	28,62	0,37%	8,05	0,10%	-
Активы, находящиеся во внешнем управлении у Aviva Investors Global Services Limited*	-	-	70,03	0,88%	-
<b>Итого ПА, находящиеся в управлении НБРК</b>	<b>7 774,82</b>	<b>100,00%</b>	<b>7 975,51</b>	<b>100,00%</b>	<b>2,58%</b>
Деньги на счетах пенсионных взносов и выплат	9,51		2,22		
<b>Итого пенсионные активы</b>	<b>7 784,33</b>		<b>7 977,73</b>		<b>2,48%</b>

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

По состоянию на 01.04.2018 года средневзвешенная доходность к погашению (УТМ) долговых финансовых инструментов, находящихся в инвестиционном портфеле ПА ЕНПФ, составила 7,2% годовых, в том числе по номинированным в тенге – 8,7% годовых, в иностранной валюте – 3,8% годовых.

### Государственные ценные бумаги Республики Казахстан

Основную долю в портфеле ПА ЕНПФ занимают ГЦБ РК, текущая стоимость которых за отчетный месяц увеличилась на 112,03 млрд. тенге и составила 3 580,47 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 44,89%.

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

<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.



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

- краткосрочные дисконтные ноты НБРК в объеме 915,16 млрд. тенге со средневзвешенной доходностью 8,67% годовых;
- ГЦБ Министерства финансов РК, номинированные в долларах США, в объеме 53,19 млрд. тенге со средневзвешенной доходностью 4,86% годовых;
- ГЦБ Министерства финансов РК, номинированные в тенге, в объеме 20,00 млрд. тенге со средневзвешенной доходностью 8,60% годовых;

В отчетном периоде произошло погашение дисконтных нот НБРК на сумму 889,76 млрд. тенге.

На отчетную дату средневзвешенная доходность к погашению по ГЦБ РК, номинированным в тенге, составила 7,6% годовых, в долларах США – 4,3% годовых.

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

Текущая стоимость государственных ценных бумаг иностранных государств за отчетный месяц увеличилась на 19,15 млрд. тенге и составила 1 105,56 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 13,86%.

В отчетном периоде были приобретены по номинальной стоимости краткосрочные ГЦБ США в объеме 95,91 млрд. тенге со средневзвешенной доходностью 1,87% годовых, а также среднесрочные ГЦБ США в объеме 48,09 млрд. тенге со средневзвешенной доходностью 2,71% годовых.

В рассматриваемом периоде произошло погашение государственных ценных бумаг иностранных государств на сумму 113,97 млрд. тенге. Продаж государственных ценных бумаг иностранных государств не было.

Средневзвешенная доходность к погашению ГЦБ иностранных государств в портфеле ПА ЕНПФ на отчетную дату составила 3,1% годовых.

### **Облигации Международных финансовых организаций**

Текущая стоимость облигаций Международных финансовых организаций за отчетный месяц уменьшилась на 0,93 млрд. тенге и составила 171,92 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 2,16%.

Продаж, погашений 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 6,9% 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 4,05 млрд. тенге и составила 323,23 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 4,05%.

В отчетном периоде произошло досрочное погашение вкладов БВУ РК на сумму 1,39 млрд. тенге.

Размещений ПА ЕНПФ во вклады 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 1,83 месяца, за отчетный месяц уменьшилась на 60,19 млрд. тенге и составила 243,46 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 3,05%.

Средневзвешенная доходность к погашению вкладов в иностранных банках на отчетную дату составила 1,9% годовых.

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

Текущая стоимость корпоративных облигаций эмитентов РК за отчетный месяц уменьшилась на 0,54 млрд. тенге и составила 60,31 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 0,76%.

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

Средневзвешенная доходность к погашению корпоративных облигаций эмитентов РК в портфеле ПА ЕНПФ на отчетную дату составила 8,7% годовых.

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

Текущая стоимость облигаций квазигосударственных организаций РК за отчетный месяц увеличилась на 3,23 млрд. тенге и составила 794,41 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 9,96%.

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 увеличилась на 6,50 млрд. тенге и составила 1 229,20 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 15,41%.

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 0,31 млрд. тенге и составила 59,61 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 0,75%.

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 0,28 млрд. тенге и составила 33,89 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 4,23 млрд. тенге и составила 162,69 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 2,04%.

В отчетном месяце были реализованы акции эмитента РК в объеме 0,12 млрд. тенге, а также согласно решению внеочередного общего собрания акционеров АО «Казкоммерцбанк» была произведена конвертация привилегированных акций данного эмитента, находящихся в портфеле пенсионных активов ЕНПФ, на его простые акции.

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 уменьшилась на 1,25 млрд. тенге и составила 24,82 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 0,31%.

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

### Внешнее доверительное управление пенсионными активами

В рамках нового стратегического распределения валютной части портфеля ПА, предусмотренного Инвестиционной декларацией ЕНПФ, 12 марта 2018 года часть пенсионных активов ЕНПФ в размере 220,0 млн. долларов США, находящихся в доверительном управлении у Национального Банка Республики Казахстан, передана внешнему управляющему Aviva Investors Global Services Limited по мандату «Глобальные облигации развивающихся рынков».

Данная компания базируется в городе Лондон и является подразделением по управлению активами британской группы Aviva plc. Объем активов под управлением Aviva plc составляет более 437 млрд. долларов США. Компания управляет различными видами инвестиций, в том числе инвестициями в акции, облигации, недвижимость и др.

Эталонным портфелем в рамках указанного мандата является индекс, включающий по состоянию на 01 апреля 2018 года 251 выпуск ценных бумаг 29 развивающихся стран с рейтингом не ниже «BB», относящихся к Латинской Америке и Восточной Европе, Юго-Восточной Азии и др.

### 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**

<i>млрд. тенге</i>					
Валюта	Текущая стоимость на 01.01.2018 г	Доля на 01.01.2018 г.	Текущая стоимость на 01.04.2018 г.	Доля на 01.04.2018 г.	Прирост/снижение с начала года
Национальная валюта	5 619,71	72,28%	5 536,61	69,42%	-1,48%
Доллары США	2 110,34	27,14%	2 395,12	30,03%	13,49%
Российские рубли	36,90	0,47%	35,77	0,45%	-3,06%
Другие валюты	7,88	0,10%	8,01	0,10%	1,77%
<b>Итого:</b>	<b>7 774,82</b>	<b>100,00%</b>	<b>7 975,51</b>	<b>100,00%</b>	<b>2,58%</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 75,84 млрд. тенге. Доходность пенсионных активов ЕНПФ, распределенная на счета вкладчиков (получателей) с начала 2018 года, составила 0,85%.

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

**Таблица 3. Структура инвестиционного дохода, полученного по ПА ЕНПФ, находящимся в доверительном управлении НБРК**

<i>млрд. тенге</i>	
Наименование	Инвестиционный доход за 2018 год
Доходы в виде вознаграждения по ценным бумагам, в том числе по размещенным вкладам и операциям «обратное РЕПО»	130,94

Доходы (убытки) от рыночной переоценки ценных бумаг	27,79
Доходы (убытки) от переоценки иностранной валюты	-90,57
Прочие доходы (убытки)	7,68
<b>Итого:</b>	<b>75,84</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. Сведения о соблюдении лимитов инвестирования по ПА ЕНПФ по состоянию на 01.04.2018г. представлены в Таблице 4.

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

№	Вид финансового инструмента	Фактическое значение (в процентах от ПА)	Выполнение (да/нет)
<b>1</b>	<b>Зарубежные эмитенты:</b>	<b>20,74%</b>	<b>да</b>
1.1	Государственные, агентские и ценные бумаги международных финансовых организаций (МФО):	16,16%	да
1)	с рейтингом не ниже «BBB-» по международной шкале агентства «Standard & Poor's» или рейтингом аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств	12,37%	да
2)	с рейтингом от «BB+» до «BB-» по международной шкале агентства «Standard & Poor's» или рейтингом аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств	3,79%	да
1.2	Корпоративные долговые ценные бумаги:	0,75%	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	0,67%	да
1.3	Ценные бумаги под залог недвижимости (MBS) и активов (ABS) с рейтинговой оценкой ценной бумаги и/или эмитента не ниже «BBB-» по международной шкале агентства «Standard & Poor's» или рейтинговой оценкой аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств	0,00%	да
1.4	Акции, депозитарные расписки на акции	0,31%	да
1.5	Депозиты (вклады) в иностранных банках, имеющих рейтинговую оценку не ниже «A-» по международной шкале агентства «Standard & Poor's» или рейтинговую оценку аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств	3,08%	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	0,43%	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>77,11%</b>	<b>да</b>
2.1	Государственные ценные бумаги Республики Казахстан, выпущенные Министерством финансов Республики Казахстан, Национальным Банком Республики Казахстан	45,29%	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	10,55%	да
2.3	Финансовые инструменты банков второго уровня Республики Казахстан	20,93%	да

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

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	0,11%	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	0,22%	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
01.03.2018	21.07.2045	ГЦБ РК	Правительство РК	XS1263139856	11 086 230 000
01.03.2018	13.03.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD122094	23 800 000 000
02.03.2018	14.03.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD122102	26 450 000 000
02.03.2018	21.07.2045	ГЦБ РК	Правительство РК	XS1263139856	12 412 015 000
05.03.2018	12.03.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD072125	97 000 000 000
07.03.2018	14.10.2024	ГЦБ РК	Правительство РК	XS1120709669	3 201 900 000
07.03.2018	21.07.2045	ГЦБ РК	Правительство РК	XS1263139856	7 684 560 000
07.03.2018	14.10.2044	ГЦБ РК	Правительство РК	XS1120709826	1 600 950 000
07.03.2018	04.04.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD282153	105 865 083 500
12.03.2018	19.03.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD072166	107 900 000 000
13.03.2018	20.03.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD072174	25 400 000 000
13.03.2018	21.07.2045	ГЦБ РК	Правительство РК	XS1263139856	5 788 800 000
13.03.2018	14.10.2044	ГЦБ РК	Правительство РК	XS1120709826	1 929 600 000
14.03.2018	21.07.2045	ГЦБ РК	Правительство РК	XS1263139856	3 863 760 000
14.03.2018	11.04.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD282195	104 108 300 800
15.03.2018	27.03.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD122201	14 100 000 000
15.03.2018	21.07.2045	ГЦБ РК	Правительство РК	XS1263139856	1 608 900 000
16.03.2018	14.10.2044	ГЦБ РК	Правительство РК	XS1120709826	1 613 600 000
19.03.2018		Простые акции*	АО «Казкоммерцбанк»	KZ1C00400016	195 509 222
19.03.2018	28.02.2025	ГЦБ США	Правительство США	US9128283Z13	16 030 000 000
19.03.2018	26.03.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD072232	108 600 000 000
19.03.2018	21.07.2045	ГЦБ РК	Правительство РК	XS1263139856	2 404 500 000
19.03.2018	28.06.2018	ГЦБ США	Правительство США	US912796PM50	32 060 000 000
19.03.2018	28.02.2023	ГЦБ США	Правительство США	US9128284A52	32 060 000 000
20.03.2018	27.03.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD072240	23 500 000 000
20.03.2018	13.08.2029	ГЦБ РК	Правительство РК	KZKDKY150118	20 000 000 000
26.03.2018	06.09.2018	ГЦБ США	Правительство США	US912796PY98	31 926 000 000
26.03.2018	20.09.2018	ГЦБ США	Правительство США	US912796PZ63	31 926 000 000
26.03.2018	02.04.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD072257	96 157 026 900
27.03.2018	03.04.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD072265	40 000 000 000
28.03.2018	25.04.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD282286	116 280 306 200
29.03.2018	05.04.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD072299	26 000 000 000
<b>Итого</b>					<b>1 132 553 042 322</b>

\* - конвертация

**Таблица 7. Сведения по продаже/конвертации финансовых инструментов в отчетном месяце**

Дата сделки	Операция	Вид инструмента	Эмитент ценной бумаги	НИН (ISIN)	Сумма сделки в тенге
14.03.2018	продажа	Прив. акции	АО «Банк ЦентрКредит»	KZ1P36280116	124 245 600

19.03.2018	конвертация	Прив. акции	АО «Казкомерцбанк»	KZ1P00400211	207 977 354
<b>Итого</b>					<b>332 222 954</b>

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

Дата сделки	Дата погашения	Наименование банка	Сумма сделки в тенге
29.03.2018	27.06.2018	Bank of Tokyo-Mitsubishi, LTD.	63 165 960 000
<b>Итого</b>			<b>63 165 960 000</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
KZW1KD072034	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	02.03.2018	22 997 642 900
KZW1KD072059	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	05.03.2018	95 400 000 000
KZW1KD281858	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	07.03.2018	100 000 000 000
KZW1KD072125	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	12.03.2018	97 000 000 000
KZW1KD122094	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	13.03.2018	23 800 000 000
KZW1KD122102	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	14.03.2018	26 450 000 000
KZW1KD281932	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	14.03.2018	85 700 000 000
RU000A0JRCJ6	ГЦБ РФ	Правительство РФ	15.03.2018	2 260 000 000
XS0564087541	ГЦБ РФ	Правительство РФ	15.03.2018	1 610 250 000
KZW1KD072166	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	19.03.2018	107 900 000 000
KZW1KD072174	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	20.03.2018	25 400 000 000
KZW1KD332016	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	26.03.2018	94 255 546 300
KZW1KD072232	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	26.03.2018	108 600 000 000
US912796NX34	ГЦБ США	Правительство США	26.03.2018	48 208 260 000
KZW1KD122201	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	27.03.2018	14 100 000 000
KZW1KD072240	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	27.03.2018	23 500 000 000
KZW1KD282088	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	28.03.2018	64 654 951 000
US912796LS66	ГЦБ США	Правительство США	29.03.2018	61 889 880 000
<b>Итого</b>				<b>1 003 726 530 200</b>

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

Дата выплаты	Дата закрытия	Наименование банка	Сумма к погашению в тенге
12.03.2018	12.03.2018	Bank of Tokyo-Mitsubishi, LTD.	43 274 250 000
20.03.2018	20.03.2018	Bank of Montreal	43 245 900 000
30.03.2018	30.03.2018	Bank of Montreal	35 332 410 000
30.03.2018	27.10.2019	АО «Capital Bank Kazakhstan»*	1 391 000 000
<b>Итого</b>			<b>123 243 560 000</b>

\* - частичное погашение вклада