

Информация по инвестиционному управлению пенсионными активами АО «ЕНПФ»

По состоянию на 1 декабря 2018 года пенсионные активы (далее – ПА) ЕНПФ, находящиеся в доверительном управлении Национального Банка Республики Казахстан (далее – НБРК), составили 9 135,16 млрд. тенге¹.

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

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

| Наименование | Текущая стоимость на 01.01.2018 г. | Доля на 01.01.2018 г. | Текущая стоимость на 01.12.2018 г. | Доля на 01.12.2018 г. | Прирост/снижение с начала года |
|---|------------------------------------|-----------------------|------------------------------------|-----------------------|--------------------------------|
| ГЦБ РК | 3 587,63 | 46,14% | 4 173,32 | 45,68% | 16,33% |
| ГЦБ иностранных государств | 948,84 | 12,20% | 1 186,32 | 12,99% | 25,03% |
| МФО | 172,55 | 2,22% | 171,01 | 1,87% | -0,90% |
| Корпоративные облигации эмитентов РК | 58,30 | 0,75% | 53,06 | 0,58% | -8,99% |
| Облигации квазигосударственных организаций РК | 791,68 | 10,18% | 1 176,21 | 12,88% | 48,57% |
| Облигации БВУ РК | 1 246, 49 | 16,03% | 1 246,69 | 13,65% | 0,02% |
| Корпоративные облигации иностранных эмитентов | 9,35 | 0,12% | 8,64 | 0,09% | -7,64% |
| Облигации иностранных эмитентов квазигосударственного сектора | 53,39 | 0,69% | 224,79 | 2,46% | 321,00% |
| PPN (структурные ноты) | 35,00 | 0,45% | 30,89 | 0,34% | -11,74% |
| Акции и депозитарные расписки эмитентов РК | 184,14 | 2,37% | 216,33 | 2,37% | 17,48% |
| Акции и депозитарные расписки иностранных эмитентов | 23,68 | 0,30% | 20,85 | 0,23% | -11,96% |
| Депозиты | 325,82 | 4,19% | 278,94 | 3,05% | -14,39% |
| Депозиты НБРК | - | - | 132,00 | 1,44% | |
| Депозиты в иностранных банках | 277,41 | 3,57% | 268,44 | 2,94% | -3,24% |
| РЕПО | 11,02 | 0,14% | - | 0,00% | |
| Денежные средства на инвестиционных счетах | 20,88 | 0,27% | 39,25 | 0,43% | |
| Прочие активы (дебиторская задолженность ² , просроченная задолженность, провизии) | 28,62 | 0,37% | 3,85 | 0,04% | |
| Активы, находящиеся во внешнем управлении у Aviva Investors Global Services Limited* | - | - | 79,88 | 0,87% | |
| Итого ПА, находящиеся в управлении НБРК** | 7 774,82 | 100,00% | 9 135,16 | 100,00% | 17,50% |
| Обязательства к оплате по совершенным сделкам | | | 175,30 | | |
| Деньги на счетах пенсионных взносов и выплат | 9,51 | | 2,16 | | |
| Итого пенсионные активы | 7 784,33 | | 9 312,63 | | 19,63 |

* - в рамках мандата «Глобальные облигации развивающихся рынков»

** - с учетом обязательств к оплате по совершенным сделкам на сумму 175,30 млрд. тенге

По состоянию на 01.12.2018г. 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 – 4,0% годовых.

¹ без учета денег на счетах пенсионных взносов и выплат.

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.

Государственные ценные бумаги Республики Казахстан

Основную долю в портфеле ПА ЕНПФ занимают ГЦБ РК, текущая стоимость которых за отчетный месяц уменьшилась на 367,68 млрд. тенге и составила 4 173,32 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 45,68%.

В отчетном периоде были приобретены краткосрочные дисконтные ноты НБРК в объеме 1 958,57 млрд. тенге со средневзвешенной доходностью 8,78% годовых.

В рассматриваемом периоде произошло погашение дисконтных нот НБРК на сумму 2 311,44 млрд. тенге.

На отчетную дату средневзвешенная доходность к погашению по ГЦБ РК, номинированным в тенге, составила 7,0% годовых, в долларах США – 4,4% годовых.

Государственные ценные бумаги иностранных государств

Текущая стоимость государственных ценных бумаг иностранных государств за отчетный месяц уменьшилась на 59,85 млрд. тенге и составила 1 186,32 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 12,99%.

В отчетном периоде были приобретены краткосрочные ГЦБ США в объеме 174,11 млрд. тенге по номинальной стоимости с доходностью 2,41% годовых.

В рамках нового стратегического распределения валютной части портфеля ПА, предусмотренного Инвестиционной декларацией ЕНПФ, приобретены ГЦБ развивающихся стран, номинированные в долларах США, на сумму 3,65 млрд. тенге по номинальной стоимости со средневзвешенной доходностью 4,20%, в том числе:

- ГЦБ Чили в объеме 1,04 млрд. тенге с доходностью 3,80% годовых;

- ГЦБ Филиппин в объеме 2,61 млрд. тенге со средневзвешенной доходностью 4,37% годовых.

В рассматриваемом периоде произошло погашение ГЦБ США на сумму 243,79 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 3,8% годовых.

Облигации Международных финансовых организаций

Текущая стоимость облигаций международных финансовых организаций за отчетный месяц увеличилась на 5,43 млрд. тенге и составила 171,01 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 1,87%.

В отчетном периоде были приобретены облигации Евразийского Банка Развития в объеме 5,00 млрд. тенге по номинальной стоимости с доходностью 9,70% годовых.

Продаж и погашений ценных бумаг международных финансовых организаций не было.

Средневзвешенная доходность к погашению по облигациям международных финансовых организаций, номинированным в тенге, составила 6,5% 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 2,30 млрд. тенге и составила 278,94 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 3,05%.

В отчетном периоде произошло частичное досрочное погашение вкладов БВУ РК на сумму 2,91 млрд. тенге.

Средневзвешенная доходность к погашению вкладов БВУ РК на отчетную дату составила 9,7% годовых.

Депозиты в иностранных банках

Текущая стоимость вкладов в иностранных банках, имеющих средневзвешенный срок погашения 2,08 месяца, за отчетный месяц увеличилась на 42,98 млрд. тенге и составила 268,44 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 2,94%.

В отчетном месяце в иностранных банках были размещены вклады, номинированные в долларах США и российских рублях, на сумму 74,10 млрд. тенге со средневзвешенной доходностью 2,81% годовых и 3,89 млрд. тенге с доходностью 6,95% годовых соответственно.

В отчетном периоде произошло погашение вкладов на сумму 37,27 млрд. тенге.

Средневзвешенная доходность к погашению вкладов в иностранных банках на отчетную дату составила 2,6% годовых.

Депозиты в Национальном Банке РК

Текущая стоимость депозитов в Национальном Банке РК составила 132,00 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 1,44%.

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 3 981,00 млрд. тенге со средневзвешенной доходностью 8,25% годовых. В отчетном периоде произошло погашение депозитов на общую сумму 4 034,00 млрд. тенге.

Средневзвешенная доходность к погашению вкладов в Национальном Банке РК на отчетную дату составила 8,25% годовых.

Корпоративные облигации эмитентов Республики Казахстан

Текущая стоимость корпоративных облигаций эмитентов РК за отчетный месяц увеличилась на 0,40 млрд. тенге и составила 53,06 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 увеличились на 448,57 млрд. тенге и составила 1 176,21 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 12,88%.

В рассматриваемом периоде были приобретены облигации АО «НУХ «КазАгро» в объеме 450,00 млрд. тенге по номинальной стоимости с доходностью 10,00% 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 10,4% годовых, в долларах США – 5,0% годовых.

Облигации банков второго уровня Республики Казахстан

Текущая стоимость облигаций БВУ РК за отчетный месяц уменьшилась на 5,30 млрд. тенге и составила 1 246,69 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 13,65%.

В отчетном периоде в рамках облигационной программы для БВУ РК на сумму 200 млрд. тенге были приобретены облигации БВУ РК на общую сумму 7,08 млрд. тенге со средневзвешенной доходностью 11,35% годовых.

В рассматриваемом периоде произошло погашение облигаций БВУ РК в объеме 12,14 млрд. тенге.

Продаж 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 уменьшилась на 0,37 млрд. тенге и составила 8,64 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 0,09%.

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 7,8% годовых.

Облигации иностранных эмитентов квазигосударственного сектора

Текущая стоимость облигаций иностранных эмитентов квазигосударственного сектора за отчетный месяц увеличилась на 0,93 млрд. тенге и составила 224,79 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 2,46%.

Продаж, погашений и покупок 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 0,15 млрд. тенге и составила 30,89 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 55,11 млрд. тенге и составила 216,33 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 2,37%.

В отчетном периоде были приобретены депозитарные расписки АО «Национальная атомная компания «Казатомпром» в объеме 56,13 млрд. тенге.

Продаж акций и депозитарных расписок эмитентов РК не было.

Акции и депозитарные расписки иностранных эмитентов

Текущая стоимость акций и депозитарных расписок иностранных эмитентов за отчетный месяц увеличилась на 1,08 млрд. тенге и составила 20,85 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 0,23%.

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 01.12.2018г. | Доля на 01.12.2018г. | Прирост/снижение с начала года |
| Национальная валюта | 5 619,71 | 72,28% | 6 287,73 | 68,83% | 11,89% |
| Доллары США | 2 110,34 | 27,14% | 2 810,23 | 30,76% | 33,17% |
| Российские рубли | 36,90 | 0,47% | 30,32 | 0,33% | -17,84% |

| | | | | | |
|---------------|-----------------|----------------|-----------------|----------------|---------------|
| Другие валюты | 7,88 | 0,10% | 6,88 | 0,08% | -12,60% |
| Итого: | 7 774,82 | 100,00% | 9 135,16 | 100,00% | 17,50% |

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 800,19 млрд. тенге. Доходность пенсионных активов ЕНПФ, распределенная на счета вкладчиков (получателей) с начала 2018 года, составила 9,24%.

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» | 502,22 |
| Доходы (убытки) от рыночной переоценки ценных бумаг | -13,13 |
| Доходы (убытки) от переоценки иностранной валюты | 303,39 |
| Доходы (убытки) от внешнего управления | 9,36 |
| Прочие доходы (убытки) | -1,65 |
| Итого: | 800,19 |

Информация о соблюдении параметров инвестиционной декларации

Структурное распределение ПА ЕНПФ, находящихся в доверительном управлении, соответствует требованиям Инвестиционной декларации ЕНПФ³. Доли валютных позиций остаются в рамках допустимого уровня и не нарушают требований Инвестиционной декларации ЕНПФ. Сведения о соблюдении лимитов инвестирования по ПА ЕНПФ по состоянию на 01.12.2018г. 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: | 21,73% | да |
| 1.1 | Государственные, агентские и ценные бумаги международных финансовых организаций (МФО): | 15,61% | да |
| 1) | с рейтингом не ниже «BBB-» по международной шкале агентства «Standard & Poor's» или рейтингом аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | 11,57% | да |
| 2) | с рейтингом от «BB+» до «BB-» по международной шкале агентства «Standard & Poor's» или рейтингом аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств | 4,04% | да |
| 1.2 | Корпоративные долговые ценные бумаги: | 2,22% | 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 | 0,23% | да |

³ 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 | 2,94% | 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 | 0,34% | 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: | 79,13% | да |
| 2.1 | Государственные ценные бумаги Республики Казахстан, выпущенные Министерством финансов Республики Казахстан, Национальным Банком Республики Казахстан | 45,68% | 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 | 1,44% | да |
| 2.2 | Ценные бумаги субъектов квазигосударственного сектора | 13,93% | да |
| 2.3 | Финансовые инструменты банков второго уровня Республики Казахстан | 17,71% | 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 | 0,09% | 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 |
|-------------|----------------|-----------------------|-----------------------------------|--------------|-------------------------------|
| 01.11.2018 | 12.11.2018 | ГЦБ РК | Национальный Банк РК | KZW1KD074345 | 150 000 000 000 |
| 02.11.2018 | 27.03.2025 | ГЦБ Чили | Правительство Республики Чили | US168863BW77 | 1 039 668 000 |
| 02.11.2018 | 13.11.2018 | ГЦБ РК | Национальный Банк РК | KZW1KD074352 | 150 000 000 000 |
| 02.11.2018 | 21.03.2019 | ГЦБ США | Правительство США | US912796RC50 | 81 688 200 000 |
| 05.11.2018 | 05.12.2018 | ГЦБ РК | Национальный Банк РК | KZW1KD284381 | 141 871 830 700 |
| 05.11.2018 | 14.11.2018 | ГЦБ РК | Национальный Банк РК | KZW1KD074378 | 49 949 986 500 |
| 06.11.2018 | 06.11.2022 | Облигации | Евразийский банк развития | KZP03Y04E904 | 5 000 000 000 |
| 12.11.2018 | 12.12.2018 | ГЦБ РК | Национальный Банк РК | KZW1KD284456 | 100 000 000 000 |
| 12.11.2018 | 21.11.2018 | ГЦБ РК | Национальный Банк РК | KZW1KD074444 | 130 613 096 700 |
| 13.11.2018 | 22.11.2018 | ГЦБ РК | Национальный Банк РК | KZW1KD074469 | 150 000 000 000 |
| 13.11.2018 | | Депозитарные расписки | АО «НАК «Казатомпром» | US63253R2013 | 56 129 997 904 |
| 13.11.2018 | 02.02.2042 | ГЦБ Филиппин | Правительство Республики Филиппин | US718286CB15 | 1 871 000 000 |
| 14.11.2018 | 23.11.2018 | ГЦБ РК | Национальный Банк РК | KZW1KD074477 | 130 061 840 800 |
| 15.11.2018 | 26.11.2018 | ГЦБ РК | Национальный Банк РК | KZW1KD074493 | 150 000 000 000 |

| | | | | | |
|--------------|------------|--------------|-----------------------------------|--------------|--------------------------|
| 19.11.2018 | 28.11.2018 | ГЦБ РК | Национальный Банк РК | KZW1KD074519 | 119 031 530 200 |
| 20.11.2018 | 29.11.2018 | ГЦБ РК | Национальный Банк РК | KZW1KD074535 | 150 000 000 000 |
| 20.11.2018 | 04.04.2019 | ГЦБ США | Правительство США | US912796RD34 | 36 495 000 000 |
| 21.11.2018 | 30.11.2018 | ГЦБ РК | Национальный Банк РК | KZW1KD074543 | 112 260 973 000 |
| 22.11.2018 | 04.12.2018 | ГЦБ РК | Национальный Банк РК | KZW1KD084567 | 150 000 000 000 |
| 23.11.2018 | 04.12.2018 | ГЦБ РК | Национальный Банк РК | KZW1KD074576 | 100 000 000 000 |
| 27.11.2018 | 27.11.2021 | Облигации | ДБ АО «Сбербанк» | KZP01Y03E488 | 2 080 000 000 |
| 27.11.2018 | 04.04.2019 | ГЦБ США | Правительство США | US912796RD34 | 55 924 500 000 |
| 28.11.2018 | 27.01.2023 | Облигации | АО «Kaspi Bank» | KZP03Y08E830 | 5 000 000 000 |
| 29.11.2018 | 11.12.2018 | ГЦБ РК | Национальный Банк РК | KZW1KD074626 | 80 000 000 000 |
| 29.11.2018 | 13.01.2037 | ГЦБ Филиппин | Правительство Республики Филиппин | US718286BW60 | 742 560 000 |
| 29.11.2018 | 29.11.2033 | Облигации | АО «НУХ «КазАгро» | KZP01Y15G065 | 450 000 000 000 |
| 30.11.2018 | 12.12.2018 | ГЦБ РК | Национальный Банк РК | KZW1KD074634 | 94 776 488 700 |
| Итого | | | | | 2 654 536 672 504 |

Таблица 7. Сведения по размещениям во вклады в отчетном месяце

| Дата сделки | Дата погашения | Наименование банка | Сумма сделки в тенге |
|--------------|----------------|----------------------|--------------------------|
| 01.11.2018 | 02.11.2018 | Национальный Банк РК | 192 000 000 000 |
| 01.11.2018 | 01.02.2019 | ING Bank N.V. | 3 887 200 000 |
| 02.11.2018 | 05.11.2018 | Национальный Банк РК | 183 000 000 000 |
| 05.11.2018 | 06.11.2018 | Национальный Банк РК | 185 000 000 000 |
| 06.11.2018 | 07.11.2018 | Национальный Банк РК | 157 000 000 000 |
| 07.11.2018 | 08.11.2018 | Национальный Банк РК | 94 000 000 000 |
| 08.11.2018 | 09.11.2018 | Национальный Банк РК | 203 000 000 000 |
| 09.11.2018 | 12.11.2018 | Национальный Банк РК | 285 000 000 000 |
| 12.11.2018 | 13.11.2018 | Национальный Банк РК | 400 000 000 000 |
| 13.11.2018 | 14.11.2018 | Национальный Банк РК | 445 000 000 000 |
| 14.11.2018 | 15.11.2018 | Национальный Банк РК | 400 000 000 000 |
| 15.11.2018 | 16.11.2018 | Национальный Банк РК | 295 000 000 000 |
| 16.11.2018 | 19.11.2018 | Национальный Банк РК | 150 000 000 000 |
| 19.11.2018 | 20.11.2018 | Национальный Банк РК | 30 000 000 000 |
| 20.11.2018 | 21.11.2018 | Национальный Банк РК | 72 000 000 000 |
| 21.11.2018 | 22.11.2018 | Национальный Банк РК | 94 000 000 000 |
| 21.11.2018 | 21.02.2019 | Mizuho | 36 828 000 000 |
| 22.11.2018 | 23.11.2018 | Национальный Банк РК | 111 000 000 000 |
| 23.11.2018 | 26.11.2018 | Национальный Банк РК | 135 000 000 000 |
| 26.11.2018 | 27.11.2018 | Национальный Банк РК | 88 000 000 000 |
| 28.11.2018 | 29.11.2018 | Национальный Банк РК | 290 000 000 000 |
| 28.11.2018 | 28.02.2019 | Mizuho | 37 273 000 000 |
| 29.11.2018 | 30.11.2018 | Национальный Банк РК | 40 000 000 000 |
| 30.11.2018 | 04.12.2018 | Национальный Банк РК | 132 000 000 000 |
| Итого | | | 4 058 988 200 000 |

Таблица 8. 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 |
|--------------|-----------------|-------------------------------|-----------------------------|---------------------------|
| KZW1KD074246 | ГЦБ РК | Национальный Банк РК | 01.11.2018 | 100 000 000 000 |
| US912796QF90 | ГЦБ США | Правительство США | 02.11.2018 | 62 380 080 000 |
| KZW1KD074253 | ГЦБ РК | Национальный Банк РК | 02.11.2018 | 89 525 723 300 |
| KZW1KD074287 | ГЦБ РК | Национальный Банк РК | 05.11.2018 | 150 000 000 000 |
| KZW1KD074295 | ГЦБ РК | Национальный Банк РК | 06.11.2018 | 150 000 000 000 |
| KZW1KD284084 | ГЦБ РК | Национальный Банк РК | 07.11.2018 | 100 000 000 000 |
| KZP02Y05C980 | Облигации | АО «ДБ «Альфа-Банк» | 08.11.2018 | 3 000 000 000 |
| KZW1KD074329 | ГЦБ РК | Национальный Банк РК | 08.11.2018 | 100 000 000 000 |
| KZW1KD074337 | ГЦБ РК | Национальный Банк РК | 09.11.2018 | 100 000 000 000 |
| US912796PD51 | ГЦБ США | Правительство США | 09.11.2018 | 63 350 500 000 |
| KZW1KD074345 | ГЦБ РК | Национальный Банк РК | 12.11.2018 | 150 000 000 000 |
| KZW1KD074352 | ГЦБ РК | Национальный Банк РК | 13.11.2018 | 150 000 000 000 |
| KZP02Y10C725 | Облигации | АО «Народный Банк Казахстана» | 14.11.2018 | 9 135 500 000 |
| KZW1KD074378 | ГЦБ РК | Национальный Банк РК | 14.11.2018 | 49 949 986 500 |
| KZW1KD284142 | ГЦБ РК | Национальный Банк РК | 14.11.2018 | 80 000 000 000 |
| US912796QJ13 | ГЦБ США | Правительство США | 16.11.2018 | 62 400 200 000 |

| | | | | |
|--------------|---------|----------------------|------------|--------------------------|
| KZW1KD074444 | ГЦБ РК | Национальный Банк РК | 21.11.2018 | 130 613 096 700 |
| KZW1KD074469 | ГЦБ РК | Национальный Банк РК | 22.11.2018 | 150 000 000 000 |
| KZW1KD074477 | ГЦБ РК | Национальный Банк РК | 23.11.2018 | 130 061 840 800 |
| US912796QK85 | ГЦБ США | Правительство США | 26.11.2018 | 55 654 500 000 |
| KZW1KD074493 | ГЦБ РК | Национальный Банк РК | 26.11.2018 | 150 000 000 000 |
| KZW1KD074519 | ГЦБ РК | Национальный Банк РК | 28.11.2018 | 119 031 530 200 |
| KZW1KD284316 | ГЦБ РК | Национальный Банк РК | 28.11.2018 | 150 000 000 000 |
| KZW1KD074535 | ГЦБ РК | Национальный Банк РК | 29.11.2018 | 150 000 000 000 |
| KZW1KD074543 | ГЦБ РК | Национальный Банк РК | 30.11.2018 | 112 260 973 000 |
| Итого | | | | 2 567 363 930 500 |

Таблица 9. Сведения по погашениям основного долга по вкладам в отчетном месяце

| Дата операции | Дата погашения | Наименование банка | Сумма сделки в тенге |
|---------------|----------------|------------------------------|--------------------------|
| 01.11.2018 | 01.11.2018 | Национальный Банк РК | 185 000 000 000 |
| 02.11.2018 | 02.11.2018 | Национальный Банк РК | 192 000 000 000 |
| 05.11.2018 | 05.11.2018 | Национальный Банк РК | 183 000 000 000 |
| 06.11.2018 | 06.11.2018 | Национальный Банк РК | 185 000 000 000 |
| 06.11.2018 | 06.11.2018 | ДО АО Банк ВТБ (Казахстан) | 450 000 000 |
| 07.11.2018 | 07.11.2018 | АО «AsiaCredit Bank» | 5 722 000 |
| 07.11.2018 | 07.11.2018 | АО «AsiaCredit Bank» | 450 000 000 |
| 07.11.2018 | 07.11.2018 | Национальный Банк РК | 157 000 000 000 |
| 08.11.2018 | 08.11.2018 | Национальный Банк РК | 94 000 000 000 |
| 09.11.2018 | 09.11.2018 | Национальный Банк РК | 203 000 000 000 |
| 12.11.2018 | 12.11.2018 | Национальный Банк РК | 285 000 000 000 |
| 13.11.2018 | 13.11.2018 | Национальный Банк РК | 400 000 000 000 |
| 14.11.2018 | 14.11.2018 | Национальный Банк РК | 445 000 000 000 |
| 14.11.2018 | 29.12.2019 | АО «ДБ «Альфа-Банк» | 40 388 889 |
| 15.11.2018 | 15.11.2018 | Национальный Банк РК | 400 000 000 000 |
| 16.11.2018 | 16.11.2018 | Национальный Банк РК | 295 000 000 000 |
| 19.11.2018 | 19.11.2018 | Национальный Банк РК | 150 000 000 000 |
| 20.11.2018 | 20.11.2018 | Национальный Банк РК | 30 000 000 000 |
| 21.11.2018 | 21.11.2018 | Национальный Банк РК | 72 000 000 000 |
| 22.11.2018 | 22.11.2018 | Национальный Банк РК | 94 000 000 000 |
| 23.11.2018 | 23.11.2018 | Национальный Банк РК | 111 000 000 000 |
| 26.11.2018 | 26.11.2018 | Национальный Банк РК | 135 000 000 000 |
| 26.11.2018 | 26.11.2018 | АО «Capital Bank Kazakhstan» | 1 909 000 000 |
| 27.11.2018 | 27.11.2018 | Национальный Банк РК | 88 000 000 000 |
| 28.11.2018 | 28.11.2018 | ДО АО Банк ВТБ (Казахстан) | 50 000 000 |
| 28.11.2018 | 28.11.2018 | Bank of Tokyo-Mitsubishi | 37 273 000 000 |
| 29.11.2018 | 29.11.2018 | Национальный Банк РК | 290 000 000 000 |
| 30.11.2018 | 30.11.2018 | Национальный Банк РК | 40 000 000 000 |
| Итого | | | 4 074 178 110 889 |