

Информация по инвестиционному управлению пенсионными активами АО «ЕНПФ»

По состоянию на 1 августа 2018 года пенсионные активы (далее – ПА) ЕНПФ, находящиеся в доверительном управлении Национального Банка Республики Казахстан (далее – НБРК), составили 8 576,23 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 01.08.2018 г.	Доля на 01.08.2018 г.	Прирост/снижение с начала года
ГЦБ РК	3 587,63	46,14%	4 071,71	47,48%	13,49%
ГЦБ иностранных государств	948,84	12,20%	964,87	11,25%	1,69%
МФО	172,55	2,22%	160,49	1,87%	-6,99%
Корпоративные облигации эмитентов РК	58,30	0,75%	54,70	0,64%	-6,18%
Облигации квазигосударственных организаций РК	791,68	10,18%	699,24	8,15%	-11,68%
Облигации БВУ РК	1 246, 49	16,03%	1 188,83	13,86%	-4,63%
Корпоративные облигации иностранных эмитентов	9,35	0,12%	9,48	0,11%	1,35%
Облигации иностранных эмитентов квазигосударственного сектора	53,39	0,69%	135,23	1,58%	153,26%
PPN (структурные ноты)	35,00	0,45%	29,25	0,34%	-16,42%
Акции и депозитарные расписки эмитентов РК	184,14	2,37%	156,46	1,82%	-15,03%
Акции и депозитарные расписки иностранных эмитентов	23,68	0,30%	23,14	0,27%	-2,29%
Депозиты	325,82	4,19%	306,11	3,57%	-6,05%
Депозиты НБРК	-	-	13,90	0,16%	
Депозиты в иностранных банках	277,41	3,57%	572,53	6,68%	106,38%
РЕПО	11,02	0,14%	-	0,00%	
Денежные средства на инвестиционных счетах (за вычетом обязательств по сделкам с ФИ)	20,88	0,27%	97,50	1,14%	
Прочие активы (дебиторская задолженность ² , просроченная задолженность, провизии)	28,62	0,37%	17,42	0,20%	-39,12%
Активы, находящиеся во внешнем управлении у Aviva Investors Global Services Limited*	-	-	75,37	0,88%	
Итого ПА, находящиеся в управлении НБРК	7 774,82	100,00%	8 576,23	100,00%	10,31%
Денежные средства на инвестиционных счетах для расчетов по совершенным сделкам			7,12		
Деньги на счетах пенсионных взносов и выплат	9,51		2,30		
Итого пенсионные активы	7 784,33		8 585,65		10,29%

* - в рамках мандата «Глобальные облигации развивающихся рынков»

По состоянию на 01.08.2018 года средневзвешенная доходность к погашению (YTM) долговых финансовых инструментов, находящихся в инвестиционном портфеле ПА ЕНПФ, составила 6,9% годовых, в том числе по номинированным в тенге – 8,3% годовых, в иностранной валюте – 3,7% 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 увеличилась на 121,83 млрд. тенге и составила 4 071,71 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 47,48%.

В отчетном периоде были приобретены следующие финансовые инструменты:

- краткосрочные дисконтные ноты НБРК в объеме 1 274,64 млрд. тенге со средневзвешенной доходностью 8,14% годовых;
- ГЦБ Министерства финансов РК, номинированные в тенге, в объеме 93,00 млрд. тенге со средневзвешенной доходностью 8,44% годовых;

В отчетном периоде произошло погашение и продажа дисконтных нот НБРК на сумму 1 236,83 млрд. тенге и 1,28 млрд. тенге соответственно.

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

Государственные ценные бумаги иностранных государств

Текущая стоимость государственных ценных бумаг иностранных государств за отчетный месяц увеличилась на 101,62 млрд. тенге и составила 964,87 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 11,25%.

В отчетном периоде были приобретены краткосрочные ГЦБ США в объеме 218,40 млрд. тенге по номинальной стоимости со средневзвешенной доходностью 2,00% годовых, а также долгосрочные ГЦБ Российской Федерации в объеме 13,47 млрд. тенге по номинальной стоимости со средневзвешенной доходностью 5,24% годовых.

В отчетном периоде произошло погашение государственных ценных бумаг иностранных государств на сумму 145,66 млрд. тенге.

В рассматриваемом периоде продаж государственных ценных бумаг иностранных государств не было.

Средневзвешенная доходность к погашению ГЦБ иностранных государств в портфеле ПА ЕНПФ на отчетную дату составила 3,5% годовых.

Облигации Международных финансовых организаций

Текущая стоимость облигаций Международных финансовых организаций за отчетный месяц увеличилась на 0,57 млрд. тенге и составила 160,49 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 1,87%.

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

Средневзвешенная доходность к погашению по облигациям Международных финансовых организаций, номинированным в тенге, составила 6,7% годовых, в долларах США – 5,0% годовых.

Депозиты в банках второго уровня Республики Казахстан

Текущая стоимость вкладов в БВУ РК, имеющих средневзвешенный срок погашения 5,2 лет, за отчетный месяц уменьшилась на 7,29 млрд. тенге и составила 306,11 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 3,57%.

В отчетном периоде произошло досрочное погашение вкладов БВУ РК на сумму 8,24 млрд. тенге. Размещений ПА ЕНПФ во вклады БВУ не было.

Средневзвешенная доходность к погашению вкладов БВУ РК на отчетную дату составила 10,2% годовых.

Депозиты в иностранных банках

Текущая стоимость вкладов в иностранных банках, имеющих средневзвешенный срок погашения 1,49 месяца, за отчетный месяц увеличилась на 31,07 млрд. тенге и составила 572,53 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 6,68%.

В отчетном месяце были размещены вклады в иностранных банках на сумму 181,06 млрд. тенге со средневзвешенной доходностью 2,36% годовых. В отчетном периоде произошло погашение вкладов на сумму 160,72 млрд. тенге.

Средневзвешенная доходность к погашению вкладов в иностранных банках на отчетную дату составила 2,4% годовых.

Депозиты в Национальном Банке РК

Текущая стоимость депозитов в Национальном Банке РК составила 13,90 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 0,16%.

В отчетном месяце в рамках управления текущей ликвидностью с целью поддержания доходности по пенсионным активам осуществлено инвестирование в однодневные депозиты Национального Банка РК на сумму 202,50 млрд. тенге со средневзвешенной доходностью 8,0% годовых. В отчетном периоде произошло погашение депозитов на сумму 188,60 млрд. тенге.

Средневзвешенная доходность к погашению вкладов в Национальном Банке РК на отчетную дату составила 8,0% годовых.

Корпоративные облигации эмитентов Республики Казахстан

Текущая стоимость корпоративных облигаций эмитентов РК за отчетный месяц уменьшилась на 6,44 млрд. тенге и составила 54,70 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 0,64%.

В отчетном месяце истек срок обращения по облигациям АО «AMF Group». Согласно проспекту выпуска данных облигаций выплата на сумму 0,73 млрд. тенге ожидается в период с 26.07.2018г. по 07.09.2018г.

В отчетном периоде 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 10,2% годовых.

Облигации квазигосударственных организаций Республики Казахстан

Текущая стоимость облигаций квазигосударственных организаций РК за отчетный месяц уменьшилась на 32,32 млрд. тенге и составила 699,24 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 8,15%.

В рассматриваемом периоде были реализованы облигации АО «Банк Развития Казахстана» на сумму 31,71 млрд. тенге, а также произошло погашение облигаций АО «КИК» на сумму 7,5 млрд. тенге (согласно проспекту выпуска облигаций выплата ожидается в период с 26.07.2018г. по 08.08.2018г.).

В отчетном периоде покупок облигаций квазигосударственных организаций РК не было.

На отчетную дату средневзвешенная доходность к погашению по облигациям квазигосударственных организаций РК, номинированным в тенге, составила 10,7% годовых, в долларах США – 5,0% годовых.

Облигации банков второго уровня Республики Казахстан

Текущая стоимость облигаций БВУ РК за отчетный месяц уменьшилась на 12,86 млрд. тенге и составила 1 188,83 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 13,86%.

Продаж, погашений и покупок облигаций БВУ РК не было.

На отчетную дату средневзвешенная доходность к погашению по облигациям БВУ РК, номинированным в тенге, составила 9,9% годовых, в долларах США – 6,6% годовых.

Корпоративные облигации иностранных эмитентов

Текущая стоимость корпоративных облигаций иностранных эмитентов за отчетный месяц увеличилась на 0,32 млрд. тенге и составила 9,48 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 0,11%.

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

Средневзвешенная доходность к погашению корпоративных облигаций иностранных эмитентов в портфеле ПА ЕНПФ на отчетную дату составила 7,5% годовых.

Облигации иностранных эмитентов квазигосударственного сектора

Текущая стоимость облигаций иностранных эмитентов квазигосударственного сектора за отчетный месяц увеличилась на 12,31 млрд. тенге и составила 135,23 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 1,58%.

В рамках нового стратегического распределения валютной части портфеля ПА, предусмотренного Инвестиционной декларацией ЕНПФ, приобретены облигации иностранных эмитентов квазигосударственного сектора Индонезии, номинированные в долларах США, в объеме 13,16 млрд. тенге по номинальной стоимости со средневзвешенной доходностью 4,46% годовых.

В отчетном месяце произошло погашение облигаций ОАО «Россельхозбанк» на сумму 3,29 млрд. тенге. Продаж облигаций иностранных эмитентов квазигосударственного сектора в отчетном месяце не было.

Средневзвешенная доходность к погашению иностранных эмитентов квазигосударственного сектора в портфеле ПА ЕНПФ на отчетную дату составила 4,7% годовых.

PPN (структурные ноты) иностранных эмитентов

Текущая стоимость PPN (структурных нот) иностранных эмитентов за отчетный месяц уменьшилась на 5,89 млрд. тенге и составила 29,25 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 0,34%.

В отчетном периоде произошло погашение PPN (структурных нот) иностранных эмитентов на сумму 6,37 млрд. тенге.

Продаж 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 5,79 млрд. тенге и составила 156,46 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 1,82%.

В отчетном периоде по итогам присоединения АО «Казкоммерцбанк» к АО «Народный Банк Казахстана» в портфеле ПА ЕНПФ произведен обмен простых акций АО «Казкоммерцбанк» на простые акции АО «Народный Банк Казахстана», а также получены простые акции и депозитарные расписки АО «KCELL» на сумму 4,49 млрд. тенге в счет погашения части обязательств по вкладам БВУ РК.

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 0,02 млрд. тенге и составила 23,14 млрд. тенге. Их доля в портфеле составила 0,27%.

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

<i>млрд. тенге</i>					
Валюта	Текущая стоимость на 01.01.2018 г.	Доля на 01.01.2018 г.	Текущая стоимость на 01.08.2018 г.	Доля на 01.08.2018 г.	Прирост/снижение с начала года
Национальная валюта	5 619,71	72,28%	5 803,45	67,67%	3,27%
Доллары США	2 110,34	27,14%	2 734,19	31,88%	29,56%
Российские рубли	36,90	0,47%	30,37	0,35%	-17,69%
Другие валюты	7,88	0,10%	8,21	0,10%	4,28%
Итого:	7 774,82	100,00%	8 576,23	100,00%	10,31%

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 449,70 млрд. тенге. Доходность пенсионных активов ЕНПФ, распределенная на счета вкладчиков (получателей) с начала 2018 года, составила 5,3%.

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»	312,87
Доходы (убытки) от рыночной переоценки ценных бумаг	12,66
Доходы (убытки) от переоценки иностранной валюты	119,34
Доходы (убытки) от внешнего управления	4,85
Прочие доходы (убытки)	- 0,02
Итого:	449,70

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 01.08.2018г. 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:	22,10%	да
1.1	Государственные, агентские и ценные бумаги международных финансовых организаций (МФО):	13,12%	да

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

1)	с рейтингом не ниже «BBB-» по международной шкале агентства «Standard & Poor's» или рейтингом аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств	9,25%	да
2)	с рейтингом от «BB+» до «BB-» по международной шкале агентства «Standard & Poor's» или рейтингом аналогичного уровня одного из других рейтинговых агентств	3,87%	да
1.2	Корпоративные долговые ценные бумаги:	1,69%	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	1,28%	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	0,41%	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	0,27%	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	6,68%	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:	75,10%	да
2.1	Государственные ценные бумаги Республики Казахстан, выпущенные Министерством финансов Республики Казахстан, Национальным Банком Республики Казахстан	47,48%	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	0,16%	да
2.2	Ценные бумаги субъектов квазигосударственного сектора	8,62%	да
2.3	Финансовые инструменты банков второго уровня Республики Казахстан	18,49%	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	0,10%	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	0,26%	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
02.07.2018	23.04.2033	ГЦБ РК	Правительство РК	KZKDKY150149	6 000 000 000
02.07.2018	09.07.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD073156	6 800 000 000
03.07.2018	25.10.2018	ГЦБ США	Правительство США	US912796QE26	43 561 000 000
03.07.2018	10.07.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD073164	15 000 000 000
05.07.2018	12.07.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD073198	94 000 000 000
09.07.2018	04.02.2030	ГЦБ РК	Правительство РК	KZKDKY150123	30 000 000 000
09.07.2018	01.11.2018	ГЦБ США	Правительство США	US912796QF90	57 704 640 000
09.07.2018	08.11.2018	ГЦБ США	Правительство США	US912796PD51	58 391 600 000
09.07.2018	16.07.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD073206	65 000 000 000
10.07.2018	17.07.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD073214	30 000 000 000
11.07.2018	08.08.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD283235	85 300 000 000
12.07.2018	19.07.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD073248	95 000 000 000
16.07.2018	23.07.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD073271	37 000 000 000
16.07.2018	10.05.2031	ГЦБ РК	Правительство РК	KZKDKY130067	30 000 000 000
17.07.2018	24.07.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD073289	35 000 000 000
18.07.2018	15.08.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD283300	100 000 000 000
19.07.2018	26.07.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD073313	70 000 000 000
19.07.2018	15.11.2018	ГЦБ США	Правительство США	US912796QJ13	58 743 500 000
20.07.2018	27.07.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD073321	50 000 000 000
23.07.2018	30.07.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD073347	65 500 000 000
23.07.2018	16.04.2032	ГЦБ РК	Правительство РК	KZKDKY140033	24 000 000 000
23.07.2018	02.05.2023	Еврооблигации	Pelabuhan Indonesia III	USY7140DAB65	1 037 040 000
24.07.2018	31.07.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD073354	63 000 000 000
24.07.2018	15.05.2027	Еврооблигации	Perusahaan Listrik Negar	US71568QAC15	1 723 200 000
24.07.2018		Акции простые*	АО «KCELL»	KZ1C59150017	1 838 698 920
24.07.2018	23.06.2047	ГЦБ РФ	Ministry of Finance of the Russian Federation	RU000A0JXU14	6 203 520 000
25.07.2018	22.08.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD283375	80 000 000 000
25.07.2018	22.11.2021	Еврооблигации	Perusahaan Listrik Negar	US71568QAA58	1 731 550 000
25.07.2018	01.08.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD073362	68 520 207 300
26.07.2018		Деп. расписка*	АО «KCELL»	US48668G2057	2 650 510 442
26.07.2018	02.08.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD073388	80 000 000 000
26.07.2018	21.05.2028	Еврооблигации	Perusahaan Listrik Negar	US71568QAE70	1 729 550 000
27.07.2018	03.08.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD073396	74 517 098 500
27.07.2018	04.04.2042	ГЦБ РФ	Ministry of Finance of the Russian Federation	XS0767473852	3 807 650 000
27.07.2018	23.06.2047	ГЦБ РФ	Ministry of Finance of the Russian Federation	RU000A0JXU14	3 461 500 000
30.07.2018	30.07.2036	ГЦБ РК	Правительство РК	KZKDKY180013	3 000 000 000
30.07.2018	06.08.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD073412	90 000 000 000
30.07.2018		Акции простые**	АО «Народный банк Казахстана»	KZ1C33870011	179 976 621
30.07.2018	20.05.2023	Еврооблигации	Pertamina Persero PT	USY7138AAE02	1 735 300 000
30.07.2018	03.05.2022	Еврооблигации	Pertamina Persero PT	USY7138AAC46	1 735 300 000
31.07.2018	07.08.2018	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KD073420	70 000 000 000
31.07.2018	03.05.2022	Еврооблигации	Pertamina Persero PT	USY7138AAC46	1 733 500 000
31.07.2018	01.10.2024	Еврооблигации	Pelabuhan Indonesia III	USY7140DAA82	1 733 500 000
					1 617 338 841 783

* - получены в счет погашения части обязательств по вкладам БВУ РК

** - получены в результате обмена на простые акции АО «Казкоммерцбанк»

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
02.07.2018	15.03.2019	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	KZW1KY012227	1 275 686 550
20.07.2018	10.06.2019	Облигации	АО «Банк Развития Казахстана»	KZP01Y03F261	31 713 196 667
30.07.2018		Акции простые*	АО «Казкоммерцбанк»	KZ1C00400016	185 167 247
Итого					33 174 050 464

* - списаны по итогам обмена на простые акции АО «Народный банк Казахстана»

Таблица 8. Сведения по размещениям во вклады в отчетном месяце

Дата сделки	Дата погашения	Наименование банка	Сумма сделки в тенге
02.07.2018	10.10.2018	Rabobank Nederland	78 572 600 000
02.07.2018	04.10.2018	Mizuho Corporate Bank	68 324 000 000
02.07.2018	15.10.2018	DBS BANK LTD	34 162 000 000
03.07.2018	04.07.2018	Национальный Банк РК	1 000 000 000
04.07.2018	05.07.2018	Национальный Банк РК	1 000 000 000
11.07.2018	12.07.2018	Национальный Банк РК	20 000 000 000
12.07.2018	13.07.2018	Национальный Банк РК	20 000 000 000
13.07.2018	16.07.2018	Национальный Банк РК	20 000 000 000
16.07.2018	17.07.2018	Национальный Банк РК	20 000 000 000
17.07.2018	18.07.2018	Национальный Банк РК	20 000 000 000
18.07.2018	19.07.2018	Национальный Банк РК	20 000 000 000
19.07.2018	20.07.2018	Национальный Банк РК	16 400 000 000
20.07.2018	23.07.2018	Национальный Банк РК	31 900 000 000
30.07.2018	31.07.2018	Национальный Банк РК	18 300 000 000
31.07.2018	01.08.2018	Национальный Банк РК	13 900 000 000
Итого			383 558 600 000

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

НИИ (ISIN)	Вид инструмента	Эмитент ценной бумаги	Дата фактического погашения	Сумма к погашению в тенге
KZW1KD073099	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	03.07.2018	19 600 000 000
KZW1KD073123	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	05.07.2018	84 500 000 000
US912796PN34	ГЦБ США	Правительство США	09.07.2018	58 391 600 000
KZW1KD073156	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	09.07.2018	6 800 000 000
KZW1KD103136	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	09.07.2018	83 826 675 100
KZW1KD073164	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	10.07.2018	15 000 000 000
KZW1KD282989	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	11.07.2018	101 000 000 000
KZW1KD073198	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	12.07.2018	94 000 000 000
US912796PQ64	ГЦБ США	Правительство США	13.07.2018	77 963 150 000
XS0374655693	Структурная нота	Goldman Sachs International	16.07.2018	5 086 141 717
KZW1KD073206	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	16.07.2018	65 000 000 000
KZW1KD073214	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	17.07.2018	30 000 000 000
KZW1KD283052	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	18.07.2018	129 577 074 200
KZW1KD073248	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	19.07.2018	95 000 000 000
KZW1KD073271	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	23.07.2018	37 000 000 000
KZW1KD073289	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	24.07.2018	35 000 000 000
XS0089375249	ГЦБ РФ	Правительство РФ	24.07.2018	9 305 280 000
KZW1KD283110	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	25.07.2018	192 030 674 000
XS0955232854	Евробонды	Russian Agricultural Bank OJSC	25.07.2018	3 289 945 000
KZW1KD073313	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	26.07.2018	70 000 000 000
KZW1KD073321	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	27.07.2018	50 000 000 000
XS0376284849	Структурная нота	JPMorgan Chase & Co.	27.07.2018	1 279 609 783
KZW1KD073347	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	30.07.2018	65 500 000 000
KZW1KD073354	ГЦБ РК	Национальный Банк РК	31.07.2018	63 000 000 000
Итого				1 392 150 149 801

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

Дата сделки	Дата погашения	Наименование банка	Сумма сделки в тенге
02.07.2018	20.10.2019	АО «Нурбанк»	360 000 000
02.07.2018	08.12.2019	АО «Нурбанк»	340 000 000
03.07.2018	03.07.2018	Credit Agricole	42 532 000 000
04.07.2018	04.07.2018	Национальный Банк РК	1 000 000 000
05.07.2018	05.07.2018	Национальный Банк РК	1 000 000 000
09.07.2018	09.07.2018	Ing Bank N.V.	55 987 240 000
11.07.2018	28.10.2019	ДО АО "Банк ВТБ (Казахстан)	70 000 000
12.07.2018	26.10.2019	АО «Банк Kassa Nova»	195 000 000
12.07.2018	12.07.2018	Национальный Банк РК	20 000 000 000
13.07.2018	13.07.2018	Национальный Банк РК	20 000 000 000
16.07.2018	20.10.2019	АО «AsiaCredit Bank (АзияКредит Банк)»	217 000 000

16.07.2018	16.07.2018	Национальный Банк РК	20 000 000 000
16.07.2018	15.12.2019	АО «AsiaCredit Bank (АзияКредит Банк)»	103 000 000
17.07.2018	29.12.2019	АО «КАЗКОММЕРЦБАНК»	1 200 000 000
17.07.2018	03.11.2019	АО «КАЗКОММЕРЦБАНК»	660 000 000
17.07.2018	17.07.2018	Национальный Банк РК	20 000 000 000
18.07.2018	18.07.2018	Национальный Банк РК	20 000 000 000
19.07.2018	19.07.2018	Credit Agricole	62 199 000 000
19.07.2018	19.07.2018	Национальный Банк РК	20 000 000 000
20.07.2018	20.07.2018	Национальный Банк РК	16 400 000 000
23.07.2018	23.07.2018	Национальный Банк РК	31 900 000 000
24.07.2018	08.12.2019	АО «Банк Астаны»	1 838 698 920
24.07.2018	28.10.2019	ДО АО Банк ВТБ (Казахстан)	110 000 000
26.07.2018	21.10.2019	АО «Банк Астаны»	2 650 510 442
30.07.2018	10.12.2019	АО «Банк ЦентрКредит»	500 000 000
31.07.2018	31.07.2018	Национальный Банк РК	18 300 000 000
			357 562 449 362