

## 2014 жылғы ақпан айына зейнетақы активтерін сенімгерлік басқару бойынша шарттарға сәйкес «БЖЗҚ» АҚ зейнетақы активтерін инвестициялық басқару бойынша ақпарат

2014 жылғы 1 наурыздағы жағдай бойынша БЖЗҚ зейнетақы активтері (бұдан әрі - ЗА) 2 168,64 млрд. теңгені құрады.

### Инвестициялық портфель

1-кесте. Үлестер бойынша БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфелінің құрылымы.

Портфельдегі қаржы құралдарының түрі	01.02.2014 ж. үлесі	01.03.2014 ж. үлесі
ҚР МБҚ	47,62%	48,63%
Шетелдік мемлекеттердің МБҚ	1,33%	1,55%
ХҚҰ	1,48%	1,51%
ҚР эмитенттерінің корпоративтік облигациялары	27,58%	25,65%
Шетелдік эмитенттердің корпоративтік облигациялары	0,54%	1,03%
PPN (құрылымдық ноттар)	0,92%	0,98%
ҚР эмитенттерінің акциялары және депозитарлық қолхаттары	3,17%	3,13%
Шетелдік эмитенттердің акциялары және депозитарлық қолхаттары	0,63%	0,65%
Қымбат металдар (алтын)	4,45%	4,43%
Депозиттер	8,87%	6,87%
РЕПО	1,94%	2,98%
Ақша және басқа активтер	1,47%	2,59%
<b>Барлық ЗА</b>	<b>100,00%</b>	<b>100,00%</b>

Зейнетақы активтерінің инвестициялық портфелін өтеуге орташа алынған кірістілік жылына 5,62% құрады.

### Қазақстан Республикасының мемлекеттік бағалы қағаздары

1-кестеге сәйкес, 2014 жылғы 1 наурыздағы жағдай бойынша БЖЗҚ зейнетақы активтері инвестицияларының портфелі негізінде Қазақстан Республикасының мемлекеттік бағалы қағаздарымен ұсынылған. Портфельдегі олардың үлесі 47,62%-дан 48,63%-ға дейін ұлғайды. Есепті күнге БЖЗҚ портфеліндегі ҚР МБҚ көлемі 1 054,65 млрд. теңгені құрады.

Ағымдағы айда «Грантум» ЖЗҚ зейнетақы активтері біріктірілді. Есепті кезеңде бастапқы нарықта келесідей ҚР МБҚ сатып алынған:

- 10,32 млрд. теңге көлемінде МЕУКАМ-180;
- 10,04 млрд. теңге көлемінде МЕУКАМ-144;
- 3,87 млрд. теңге көлемінде МЕУЖКАМ-192.

Портфельдегі ҚР МБҚ бойынша өтеуге орташа алынған кірістілік жылына 4,91 % құрады.

### Шетелдік мемлекеттердің мемлекеттік бағалы қағаздары және Халықаралық қаржы ұйымдарының облигациялары

Шетелдік мемлекеттердің мемлекеттік бағалы қағаздарына және Халықаралық қаржы ұйымдарының облигацияларына инвестициялардың үлесі 2014 жылғы 1 наурыздағы жағдай бойынша 1,55% және сәйкесінше 1,51% құрады. Есепті кезеңде БЖЗҚ портфелінде аталған бағалы қағаздарды сатып алу, сату және өтеу болған жоқ.

Шетелдік мемлекеттердің мемлекеттік бағалы қағаздарын және Халықаралық қаржы ұйымдарының облигацияларын өтеуге орташа алынған кірістілік жылына 4,00% және 2,81% құрады.

**2-кесте.** 01.03.2014 жылғы жағдай бойынша БЖЗҚ портфеліндегі шетелдік мемлекеттердің МБҚ және ХҚҰ облигациялары

Эмитент	ағымдағы құны мың теңгемен	Барлығы зейнетақы активтерінің ағымдағы құнынан пайызбен
<b>Шетелдік мемлекеттердің МБҚ</b>		
US Treasury/ АҚШ Үкіметі	28 671 985,53	1,32%
РФ Қаржы Мин.	4 946 446,51	0,23%
<b>Барлығы:</b>	<b>33 618 432,04</b>	<b>1,55%</b>
<b>Халықаралық қаржы ұйымы</b>		
ЕВРАЗБР (Еуразиялық Даму банкі)	24 590 271,31	1,13%
EIB (Еуропалық Инвестициялық банк)	5 864 719,13	0,27%
EBRD (Еуропалық Қайта құру және Даму банкі)	2 182 144,72	0,11%
<b>Барлығы:</b>	<b>32 637 135,15</b>	<b>1,51%</b>

### Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банктеріндегі депозиттер

2014 жылғы ақпанда инвестициялық портфелдегі зейнетақы активтерінің жалпы көлемінің артуы және депозиттерді өтеу нәтижесінде депозиттердің үлесі төмендеді, ол зейнетақы активтерінің 6,87% құрады. ЕДБ-ға ұлттық валютада салымдарды орналастыру көлемі 116,52 млрд. теңгені, шетел валютасында - 125,00 млн. АҚШ долларын құрады.

Қарастырылып отырған кезеңде келесі екінші деңгейдегі банктерде депозиттер өтелді:

- ✓ «Каспий банк» АҚ 3,72 млрд. теңге мөлшерінде;
- ✓ «БанкЦентрКредит» АҚ 11,17млрд. теңге мөлшерінде;
- ✓ «Ресей Жинақбанкі» АҚ ЕБ 5,33 млрд. теңге мөлшерінде;

Мұнымен бірге, есепті кезеңде ЕДБ-ға депозиттер орналастырылмады.

ЕДБ депозиттер бойынша өтеуге орташа алынған кірістілік жылына 6,92 % құрады.

Есепті күнге депозиттер Қазақстан Республикасының келесі банктеріне орналастырылған:

**3-кесте.** 01.03.2014 жылғы жағдай бойынша БЖЗҚ портфеліндегі екінші деңгейдегі банктердегі салымдар

<b>ЕДБ депозиттері</b>		
Эмитент	ағымдағы құны мың теңгемен	Барлығы зейнетақы активтерінің ағымдағы құнынан пайызбен
«Ресей Жинақбанкі» АҚ ЕБ	22 692 069,27	1,05%
«Цеснабанк» АҚ	22 367 292,22	1,03%
«Еуразиялық банк» АҚ	20 095 529,26	0,93%
«CaspiBank» АҚ	20 080 025,00	0,93%
«Казкоммерцбанк» АҚ	19 131 963,94	0,88%
«Банк ЦентрКредит» АҚ	11 921 920,55	0,55%
«Банк ВТБ» АҚ ЕБ	11 284 844,54	0,52%
«АТФ Банк» АҚ	10 406 028,63	0,48%
«Deltabank» АҚ	3 041 166,67	0,14%
«Банк «РВК» АҚ	2 549 777,78	0,12%
«Хоум Кредит» АҚ ЕБ	2 200 000,00	0,10%
«Альфа-Банк» АҚ ЕБ	2 081 780,82	0,10%
"БАНК KASSA NOVA» АҚ	700 000,00	0,03%
«Казинвестбанк» АҚ	500 000,00	0,02%
<b>Барлығы:</b>	<b>149 052 398,68</b>	<b>6,87%</b>

### ҚР эмитенттерінің корпоративтік облигациялары

2014 жылғы 1 ақпанда «Грантум» ЖЗҚ зейнетақы активтерінің бірігуі және активтер көлемінің ұлғаюы нәтижесінде ҚР корпоративтік облигацияларының үлесі портфелдің 27,58%-

дан 25,65%-ға дейін төмендеді. Екінші деңгейдегі банктердің және корпоративтік сектордың борыштық бағалы қағаздарына инвестицияланған активтер үлесі 15,73 % және сәйкесінше 9,93% құрады.

Қарастырылып отырған кезеңде 3,51 млрд. теңге көлемінде «Қазақстан ипотекалық компаниясы» АҚ аукционында облигациялар сатып алынған болатын.

Есепті кезеңде ҚР эмитенттерінің корпоративтік облигациялары сатылған жоқ.

Портфелдегі ҚР эмитенттерінің корпоративтік облигациялары бойынша өтеуге орташа алынған кірістілік жылына 7,76% құрайды.

**4-кесте.** 01.03.2014 жылғы жағдай бойынша БЖЗҚ портфеліндегі ҚР екінші деңгейдегі банктерінің облигациялары

<b>ҚР екінші деңгейдегі банктерінің корпоративтік облигациялары</b>		
<b>Бағалы қағаздар түрі және оның эмитенттерінің атауы</b>	<b>Ағымдағы құны мың теңгемен</b>	<b>Барлығы зейнетақы активтерінің ағымдағы құнынан пайызбен</b>
«Казкоммерцбанк» АҚ	50 058 746,10	2,31%
«Ресей Жинақбанкі» АҚ ЕБ	46 303 212,55	2,14%
«Цеснабанк» АҚ	40 159 530,67	1,85%
«Қазақстан халық Жинақ банкі» АҚ	33 806 823,36	1,56%
«Каспий Банк» АҚ	32 626 462,29	1,50%
«Нұрбанк» АҚ	28 781 247,55	1,33%
«Еуразиялық банк» АҚ	24 226 249,50	1,12%
«Банк ЦентрКредит» АҚ	23 439 698,76	1,08%
«DeltaBank» АҚ	18 739 143,51	0,86%
«Темірбанк» АҚ	11 580 255,14	0,53%
«Банк «Bank RBK» АҚ	9 900 769,53	0,46%
«AsiacreditBank» АҚ	8 948 772,36	0,41%
«АТФ банк» АҚ	5 859 454,60	0,27%
«БАНК ВТБ» АҚ ЕҰ	3 891 685,21	0,18%
«Эксимбанк» АҚ	983 295,08	0,05%
«Альянс Банк» АҚ	879 606,26	0,04%
«Казинвестбанк» АҚ	647 338,78	0,03%
«Банк KASSA NOVA» АҚ	205 798,80	0,01%
«БТА Банк» АҚ	17 685,95	0,00%
<b>Барлығы:</b>	<b>341 055 775,99</b>	<b>15,73%</b>

**5-кесте.** 01.03.2014 жылғы жағдай бойынша БЖЗҚ портфеліндегі ҚР корпоративтік облигациялары

<b>ҚР эмитенттерінің корпоративтік облигациялары</b>		
<b>Бағалы қағаздар түрі және оның эмитенттерінің атауы</b>	<b>Ағымдағы құны мың теңгемен</b>	<b>Барлығы зейнетақы активтерінің ағымдағы құнынан пайызбен</b>
«Қазмұнайгаз» АҚ	43 099 079,92	1,99%
«Қазақстан ипотекалық компаниясы» АҚ	27 703 604,24	1,28%
«АПК Инвест» АҚ	16 864 760,02	0,78%
"САМРҰҚ ҚАЗЫНА» ҰОҚ АҚ	15 587 467,25	0,72%
"Өндірістік келісім-шарт корпорациясы» ҰК» АҚ	12 709 736,02	0,59%
«ДТЖ» АҚ	12 209 146,21	0,56%
«Батыс транзит» АҚ	10 694 478,30	0,49%

Eurobond «Қазақстан Даму банкі» АҚ	9 128 535,89	0,42%
«Қазақстан Инжиниринг» АҚ	8 421 890,75	0,39%
«Цатек» АҚ	7 268 021,93	0,34%
"НУХ "КАЗАГРО" АҚ	6 736 100,80	0,31%
«Қазақстан Қағазы» АҚ	6 671 503,46	0,31%
«КазСтройСервис» АҚ	5 592 987,76	0,26%
«СевКазЭнерго» АҚ	4 014 592,76	0,19%
«Болат Нұржанов атындағы Екібастұз ҚРЭС-1»	3 853 478,50	0,18%
"ПАВЛОДАРЭНЕРГО" АҚ	3 580 424,19	0,17%
«БТА Ипотека» АҚ	3 328 518,47	0,15%
«INNOVA INVESTMENT» ЖШС	2 727 858,77	0,13%
«SAT & COMPANY» АҚ	2 615 274,68	0,12%
"НАК"КАЗАТОМПРОМ" АҚ	1 955 697,42	0,09%
«Самрұқ-Энерго» АҚ	1 611 061,17	0,07%
«АБДИ Компани» АҚ	1 600 033,33	0,07%
«AMF GROUP» АҚ	1 395 511,12	0,06%
«Казэкспортастық» АҚ	1 254 621,13	0,06%
«Аграрлық кредиттік корпорация» АҚ	1 085 688,86	0,05%
«БЕККЕР И К» ЖШС	803 402,43	0,04%
«CENTRAL ASIA CEMENT» АҚ	626 086,15	0,03%
«RG BRANDS» АҚ	557 630,70	0,03%
«ИМСТАЛЬКОН» АҚ	474 974,18	0,02%
«Маңғыстау үлестіру электржелілік компания» АҚ	344 627,84	0,02%
«Астана-финанс» АҚ	270 957,38	0,01%
"НОМЕБРОКЕР" АҚ	246 230,93	0,01%
«Тема И Ко» АҚ	156 468,34	0,01%
«ЭКОТОН +» АҚ	51 631,48	0,00%
«Қарағанды асбестоцемент өнімдері зауыты» АҚ	8 144,90	0,00%
"БРК-ЛИЗИНГ" АҚ	1 004,86	0,00%
<b>Жиыны :</b>	<b>215 251 232,14</b>	<b>9,93%</b>

### Шетелдік эмитенттердің корпоративтік облигациялары және PPN (құрылымдық ноттар)

«Грантум» ЖЗҚ зейнетақы активтерін біріктіру нәтижесінде инвестициялық портфельдегі шетелдік эмитенттердің корпоративтік облигацияларының үлесі портфельдің 1,03% құрады. Портфельдегі құрылымдық ноттардың үлесі портфельдің 0,98% құрады.

Есепті кезеңде шетелдік эмитенттердің корпоративтік облигацияларын және құрылымдық ноттарын сатып алу, сату және өтеу болған жоқ.

Портфельдегі шетелдік эмитенттердің корпоративтік облигациялары және құрылымдық ноттары бойынша өтеуге орташа алынған кірістілік жылына 6,55 % және сәйкесінше 3,54% құрады.

**6-кесте.** 01.03.2014 жылғы жағдай бойынша БЖЗҚ портфеліндегі шетелдік эмитенттердің корпоративтік облигациялары және құрылымдық ноттары

Эмитент	ағымдағы құны мың теңгемен	Барлығы зейнетақы активтерінің ағымдағы құнынан пайызбен
<b>Шетелдік эмитенттердің корпоративтік облигациялары</b>		
ОАО ГАЗПРОМ	4 832 676,40	0,22%
JPMorganChaseBank	3 292 070,20	0,15%
MORGAN STANLEY	2 399 632,03	0,11%

ОАО SBERBANK	1 998 681,20	0,09%
РОССЕЛЬХОЗБАНК	1 789 608,12	0,08%
KTJ BV	1 674 700,01	0,08%
UNICREDITBA AG	1 622 610,56	0,07%
ОАО ROSNEFT	1 203 573,24	0,06%
BARCLAYS BANK	1 027 137,64	0,05%
RABOBANK NIDERLAND	930 881,90	0,04%
CATERPILLAR INC	460 442,42	0,02%
SAMARCO MINERACAO SA	338 665,01	0,02%
KFW	238 279,66	0,02%
SOUTHERN COPPER CORP	235 641,73	0,01%
ASTRAZENECA PLC	172 004,35	0,01%
IBM CORP	82 489,97	0,01%
<b>Жиыны :</b>	<b>22 299 094,44</b>	<b>1,03%</b>
<b>Құрылымдық ноттар</b>		
PPN MERRILL LYNCH/Bank of America Corp	13 497 396,83	0,62%
SOCIETE GENERAL PPN	5 333 304,80	0,24%
COMMERZBANK AG PPN	2 523 126,95	0,12%
<b>Жиыны :</b>	<b>21 353 828,57</b>	<b>0,98%</b>

#### **ҚР эмитенттерінің акциялары және депозитарлық қолхаттары**

Есепті кезеңде БЖЗҚ портфеліндегі ҚР эмитенттерінің акцияларының және депозитарлық қолхаттардың үлесі портфелдің 3,17 бастап 3,13 % дейін төмендеді.

Есепті кезеңде ҚР эмитенттерінің акциялары мен депозитарлық қолхаттарын сату және сатып алу болған жоқ.

«Грантум» ЖЗҚ АҚ зейнетақы активтері құрамындағы «БАЯН СУЛУ» АҚ акциялары 1,09 млрд. теңге мөлшерінде БЖЗҚ АҚ инвестициялық портфелінің құрамына ауыстырылған болатын.

Акциялар мен депозитарлық қолхаттарға инвестиция ішінде мынадай ҚР компаниялары бар:

**7-кесте.** 01.03.2014 жылғы жағдай бойынша БЖЗҚ портфеліндегі ҚР эмитенттерінің акциялары мен депозитарлық қолхаттары

<b>ҚР эмитенттерінің акциялары мен депозитарлық қолхаттары</b>		
<b>Эмитент</b>	<b>Ағымдағы құны мың теңгемен</b>	<b>Барлығы зейнетақы активтерінің ағымдағы құнынан пайызбен</b>
«KCELL» АҚ	15 707 421,35	0,72%
«SAT & COMPANY» АҚ	15 406 729,69	0,71%
«Казтрансойл» АҚ	8 354 530,54	0,39%
«Цеснабанк» АҚ	7 073 945,84	0,33%
«Қазақстан Халық Жинақ Банкі» АҚ	6 199 674,49	0,29%
«РД КазМунайГаз» АҚ	4 314 424,20	0,20%
«Нұрбанк» АҚ	2 385 975,18	0,11%
«Манғыстау үлестіру электр желілік компания» АҚ	1 768 155,51	0,08%
«Қазақтелеком» АҚ	1 365 151,34	0,06%
"БАЯН СУЛУ" АҚ жай акциялары	1 097 478,68	0,05%
ЭКСИМБАНК АҚ	1 096 600,65	0,05%
«Mineral Resources of Central Asia» АҚ	1 002 585,17	0,05%
«БанкЦентрКредит» АҚ	774 973,84	0,04%

«Темірбанк» АҚ	692 565,96	0,03%
«Қазкоммерцбанк» АҚ	305 553,07	0,01%
«БТА банк» АҚ	185 027,17	0,01%
АТФ БАНК АҚ	108 152,68	0,00%
«Альянс Банк» АҚ	3 181,14	0,00%
<b>Барлығы:</b>	<b>67 842 126,50</b>	<b>3,13%</b>

### Шетелдік эмитенттердің акциялары және депозитарлық қолхаттары

Есепті күнге БЖЗҚ зейнетақы активтерінің портфеліндегі шетелдік эмитенттердің акцияларының үлесі портфелдің 0,65% құрады.

2014 жылғы ақпанда шетелдік эмитенттердің акциялары мен депозитарлық қолхаттарын сату және сатып алу болған жоқ.

«Грантум» ЖЗҚ АҚ зейнетақы активтері құрамындағы NEWMONT MINING CORP акциялары 265,59 млн. теңге мөлшерінде БЖЗҚ АҚ инвестициялық портфелінің құрамына ауыстырылған болатын.

Акцияларға инвестициялау ішінде мынадай компаниялар бар:

**8-кесте.** 01.03.2014 жылғы жағдай бойынша БЖЗҚ портфеліндегі шетелдік эмитенттердің акциялары мен депозитарлық қолхаттары

Шетелдік эмитенттердің акциялары мен депозитарлық қолхаттары		
Эмитент	ағымдағы құны мың теңгемен	Барлығы зейнетақы активтерінің ағымдағы құнынан пайызбен
Ресей Жинақбанкі	3 540 235,25	0,16%
ГАЗПРОМ АҚ	3 055 421,30	0,14%
DEUTSHE BANK AG	1 514 394,00	0,07%
RIO TINTO PLC	1 280 076,86	0,06%
"Банк ВТБ" ААҚ	1 144 414,16	0,05%
MCMORAN COPPER	1 105 032,24	0,05%
KAZAKHMYS PLC	602 300,68	0,03%
ORANGE	383 298,29	0,02%
ГМК "НОР.НИКЕЛЬ" ААҚ	364 631,81	0,02%
NEWMONT MINING CORP	265 593,27	0,01%
BARRICK GOLD CORP	261 537,57	0,01%
CHINA MOBILE ADR	148 041,94	0,01%
POSCO ADR	124 915,77	0,01%
EURASIAN NATURAL RESOURCES CORPORATION PLC	115 087,43	0,01%
CATERPILLAR INC	89 745,72	0,00%
VALE DE RIO DOCE SA	28 571,61	0,00%
<b>Барлығы:</b>	<b>14 023 297,88</b>	<b>0,65%</b>

### Тазартылған қымбат металдар

Тазартылған қымбат металға инвестициялау алтынмен жүргізіледі. Инвестициялық портфелдегі алтын үлесі портфелден 4,45 %-дан біршама 4,43%-ға төмендеді. Есепті кезеңде тазартылған қымбат металды сату және сатып алу болған жоқ.

Есепті айдың басына алтын бағасы бір троя унциясына 1 246,50 АҚШ долларын құрады, мұндайда айдың аяғында алтын бағасы бір троя унциясына 1 327,75 АҚШ долларын құрады.

**9-кесте.** 01.03.2014 жылғы жағдай бойынша БЖЗҚ портфеліндегі тазартылған қымбат металл

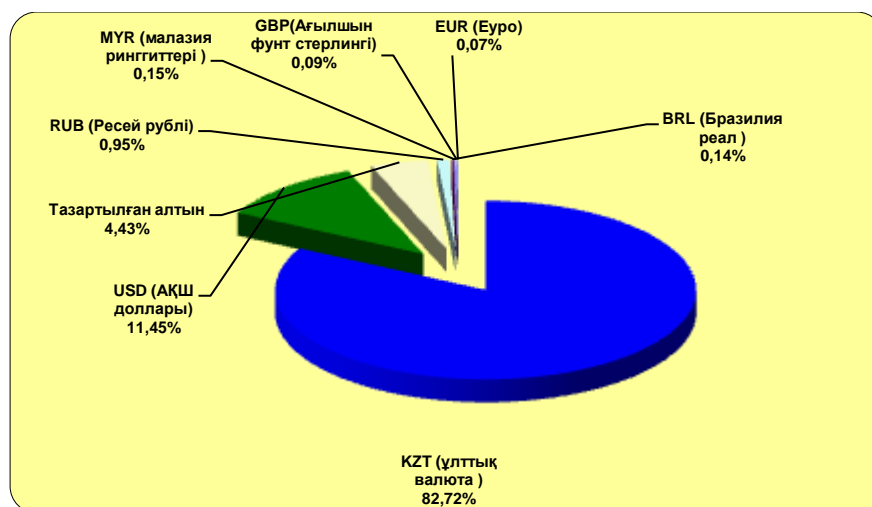
Тазартылған қымбат металл		
Тазартылған алтын	ағымдағы құны мың теңгемен	Барлығы зейнетақы активтерінің ағымдағы құнынан пайызбен
Алтын	96 032 403,98	4,43%
<i>Барлығы:</i>	<i>96 032 403,98</i>	4,43%

### Валюталар бойынша құрылымдық үлестіру.

Валюта бөлігінде БЖЗҚ зейнетақы активтері инвестициялық портфелінің құрылымы келесідей түрде берілген:

- ұлттық валюта – 82,72%;
- АҚШ доллары – 11,45%;
- Тазартылған алтын – 4,43%;
- Ресей рублі – 0,95%;
- малазия ринггиттері – 0,15%;
- еуро – 0,07%;
- ағылшын фунт стерлингі – 0,09%;
- бразилия реалы – 0,14%.

**1-сурет.** 01.03.2014 жылғы жағдай бойынша валюта бөлігінде БЖЗҚ зейнетақы активтері портфелінің құрылымы



### Инвестициялық қызметтің нәтижесі

2014 жылғы ақпан айы үшін БЖЗҚ зейнетақы активтері бойынша есептелген инвестициялық табыс/шығын 58,71 млрд. теңгені құрады.

Инвестициялық табыс/шығынның құрылымы:

- ✓ Екінші деңгейдегі банктердегі салымдар бойынша инвестициялық табыс 829,11 млн. теңгені құрады.
- ✓ Бағалы қағаздар бойынша инвестициялық шығын (-5,12) млрд. теңгені құрады.
- ✓ «Кері РЕПО» операциялары бойынша инвестициялық табыс 179,19 млн. теңгені құрады.
- ✓ Тазартылған қымбат металлдар (алтын) бойынша инвестициялық табыс 4,47 млрд. теңгені құрады.
- ✓ Валюталық қайтабағалаудан инвестициялық табыс 58,36 млрд. теңгені құрады.



2014 жылғы ақпан айы үшін БЖЗҚ шартты зейнетақы бірлігі өсімінің қарқыны 2,74% құрады.

**Уақытша инвестициялық декларация параметрлерінің сақталуы туралы ақпарат**

Зейнетақы активтерін шоғырландыруды жалғастыруға байланысты ақпанда борыштық құралдар бойынша лимит 2,33% -ға асып кеткен.

Валюталық позиция үлестері мүмкін деңгей шегінде қалады және БЖЗҚ уақытша инвестициялық декларациясының талаптарын бұзбайды.

**9-кесте. 01.03.2014 жылғы жағдай бойынша инвестициялау нысандарының тізбесі мен лимиттері**

<b>Қаржы құралының түрі</b>	<b>Инвестициялау лимиттері</b>	<b>Үлесі</b>
<b>Борыштық құралдар</b>	<b>80% дейін</b>	<b>82,33%</b>
Қазақстан Республикасының Қаржы Министрлігі және Қазақстан Республикасының Ұлттық Банкі шығарған Қазақстан Республикасының мемлекеттік бағалы қағаздары (басқа мемлекеттің заңнамасына сәйкес эмитенттелген), сонымен қатар «кері РЕПО» операциясының мәні болып табылатын бағалы қағаздарды қосқанда Қазақстан Республикасы Үкіметінің кепілдігімен шығарылған бағалы қағаздар	кемінде 20%	<b>51,61%</b>
Шетел мемлекеттерінің орталық үкіметімен шығарылған (берген) мемлекеттік мәртебесі бар бағалы қағаздар	35% аспайтын	<b>1,55%</b>
Қор биржасының ресми тізіміне енген Қазақстан Республикасының жергілікті атқарушы органдары шығарған облигациялар	10% аспайтын	<b>0,26%</b>
Қазақстан Республикасы эмитенттерінің мемлекеттік емес борыштық бағалы қағаздары, оның ішінде:	30% аспайтын	<b>25,55%</b>
1) Қазақстан Республикасы ұйымдарының ипотекалық облигациялары	15% аспайтын	1,12%
2) «Самұқ-Қазына» ұлттық әл-ауқат қоры» акционерлік қоғамы шығарған борыштық бағалы қағаздар	10% аспайтын	0,72%
халықаралық және шетел ұйымдары шығарған борыштық бағалы қағаздар	35% аспайтын	<b>1,50%</b>
құрылымдық ноттар (principal protected notes)	5% аспайтын	<b>0,87%</b>
<b>Үлесті құралдар</b>	<b>30% дейін</b>	<b>3,78%</b>
Қазақстан Республикасының ұйымдары, шетел ұйымдары шығарған мемлекеттік емес үлесті бағалы қағаздар, оның ішінде	30% аспайтын	3,78%
1) Қазақстан Республикасының ұйымдары шығарған арапайым, артықшылықты акциялар және Қазақстан Республикасының ұйымдары шығарған акцияларға жаһандық депозитарлық қолхаттар және американдық депозитарлық қолхаттар (GDR, ADR), сонымен қатар қазақстандық акциялар индексіне фьючерстерді қосқанда мемлекеттік емес үлесті бағалы қағаздар	15% аспайтын	3,13%
2) шетел ұйымдары шығарған арапайым, артықшылықты акциялар және шетел ұйымдары шығарған акцияларға жаһандық депозитарлық қолхаттар және американдық депозитарлық қолхаттар(GDR, ADR), сонымен қатар шетелдік акциялар индексіне фьючерстерді қосқанда мемлекеттік емес үлесті бағалы қағаздар	30% аспайтын	0,65%
<b>Екінші деңгейдегі банктердегі салымдар</b>	<b>25% дейін</b>	<b>6,87%</b>
<b>Басқа құралдар</b>	<b>30% дейін</b>	<b>4,43%</b>
Тазартылған қымбат металдар, оның ішінде метал депозиттері	10% дейін	<b>4,43%</b>
туынды қаржы құралдары, оның ішінде опцион, форворд, своп, фьючерс, егер олар инвестициялық тәуекелді хеджирлеуге пайдаланылатын болса	шектеусіз	0,00%
туынды қаржы құралдары, оның ішінде фьючерстер, опциондар, своптар, форвардтар	30% аспайтын	0,00%
<b>Валюталық нетто-позиция</b>	<b>50% дейін</b>	<b>17,28%</b>
АҚШ доллары, Еуро, Ағылшын фунт стерлингіде ашық валюталық позиция	50% аспайтын	16,04%
Басқа валюталар бойынша ашық валюталық позиция	15% аспайтын	1,24%