

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

2014 жылғы 1 мамырдағы жағдай бойынша БЖЗҚ зейнетақы активтері (бұдан әрі - ЗА) 4 036,02 млрд. теңгені құрады.

Инвестициялық портфель

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

Портфельдегі қаржы құралының түрі	01.04.2014 ж. үлесі	01.05.2014ж. үлесі
ҚР МБҚ	47,42%	46,86%
Шетелдік мемлекеттердің МБҚ	3,40%	3,15%
ХҚҰ	1,93%	1,14%
ҚР эмитенттерінің корпоративтік облигациялары	21,38%	21,07%
Шетелдік эмитенттердің корпоративтік облигациялары	1,05%	0,98%
PPN (құрылымдық ноттар)	1,80%	1,37%
ҚР эмитенттерінің акциялары және депозитарлық қолхаттары	4,47%	4,43%
Шетелдік эмитенттердің акциялары және депозитарлық қолхаттары	0,32%	0,30%
Қымбат металлдар (алтын)	4,26%	4,18%
Депозиттер	6,96%	6,06%
РЕПО	0,28%	0,00%
Ақша және басқа активтер	6,73%	10,46%
Барлық ЗА	100,00%	100,00%

Зейнетақы активтерінің инвестициялық портфелін өтеуге орташа алынған кірістілік жылына 5,33% құрады.

Қазақстан Республикасының мемлекеттік бағалы қағаздары

1-кестеге сәйкес, 2014 жылғы 1 мамырдағы жағдай бойынша БЖЗҚ зейнетақы активтері инвестицияларының портфелі негізінде Қазақстан Республикасының мемлекеттік бағалы қағаздарымен ұсынылған. Портфельдегі осы қағаздардың үлесі 47,42%-дан 46,86%-ға төмендеді. Есепті күнге БЖЗҚ портфеліндегі ҚР МБҚ көлемі 1 891,45 млрд. теңгені құрады.

Портфельдегі ҚР МБҚ бойынша өтеуге орташа алынған кірістілік жылына 5,78 % 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 мамырдағы жағдай бойынша 3,15% және сәйкесінше 1,14% құрады. Есепті кезеңде БЖЗҚ портфелінде аталған бағалы қағаздарды сатып алу, сату болған жоқ.

Шетелдік мемлекеттердің мемлекеттік бағалы қағаздарын және Халықаралық қаржы ұйымдарының облигацияларын өтеуге орташа алынған кірістілік жылына 1,17% және 6,78% құрады.

2-кесте. 01.05.2014 жылғы жағдай бойынша БЖЗҚ портфеліндегі шетелдік мемлекеттердің МБҚ және ХҚҰ облигациялары

Эмитент	ағымдағы құны мың теңгемен	Барлығы зейнетақы активтерінің ағымдағы құнынан пайызбен
Шетелдік мемлекеттердің МБҚ		
US Treasury/ АҚШ Үкіметі	122 518 874,37	3,04%

РФ Қаржы Мин.	4 591 484,23	0,11%
Барлығы:	127 110 358,61	3,15%
Халықаралық қаржы ұйымы		
ЕВРАЗБР (Еуразиялық Даму банкі)	38 075 537,95	0,94%
ЕІВ (Еуропалық Инвестициялық банк)	5 673 058,66	0,14%
EBRD (Еуропалық Қайта құру және Даму банкі)	2 109 819,00	0,06%
Барлығы:	45 858 415,62	1,14%

Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банктеріндегі депозиттер

2014 жылғы 1 мамырға инвестициялық портфельдегі депозиттер үлесі зейнетақы активтерінің 6,06% құрады. ЕДБ-ға ұлттық валютада салымдарды орналастыру көлемі 224,89 млрд. теңгені құрады, шетел валютасында 25,00 млн. АҚШ долларын құрады.

Қарастырылып отырған кезеңде келесі екінші деңгейдегі банктерде депозиттер өтелді:

- ✓ «Қазкоммерцбанк» АҚ 19,02 млрд. теңге мөлшерінде;
- ✓ «CaspiBank» АҚ 1,11 млрд. теңге мөлшерінде;
- ✓ «БанкЦентрКредит» АҚ 6,38 млрд. теңге мөлшерінде;
- ✓ «Цеснабанк» АҚ 5,88 млрд. теңге мөлшерінде;
- ✓ «Ресей Жинақбанкі» АҚ ЕБ 477,42 млн. теңге мөлшерінде;

Мұнымен бірге, есепті кезеңде ЕДБ-ға депозиттер орналастырылмады.

ЕДБ депозиттер бойынша өтеуге орташа алынған кірістілік жылына 7,65% құрады.

Есепті күнге депозиттер Қазақстан Республикасының келесі банктеріне орналастырылған:

3-кесте. 01.05.2014 жылғы жағдай бойынша БЖЗҚ портфеліндегі екінші деңгейдегі банктердегі салымдар

ЕДБ депозиттері		
Эмитент	ағымдағы құны мың теңгемен	Барлығы зейнетақы активтерінің ағымдағы құнынан пайызбен
«Ресей Жинақбанкі» АҚ ЕБ	72 195 102,34	1,79%
«CaspiBank» АҚ	40 832 913,89	1,01%
«Цеснабанк» АҚ	30 335 404,72	0,75%
«Еуразиялық банк» АҚ	25 817 720,88	0,64%
«Банк ЦентрКредит» АҚ	24 173 850,00	0,60%
«АТФ Банк» АҚ	21 089 477,90	0,52%
«Банк ВТБ» АҚ ЕБ	11 397 587,77	0,28%
«Хоум Кредит» АҚ ЕБ	4 268 000,00	0,11%
«Альфа-Банк» АҚ ЕБ	4 168 219,18	0,10%
«Deltabank» АҚ	3 088 666,67	0,08%
"БАНК KASSA NOVA» АҚ	3 000 000,00	0,07%
«Банк «РВК» АҚ	2 561 444,44	0,065%
«Казинвестбанк» АҚ	1 520 305,56	0,045%
Барлығы:	244 448 693,35	6,06%

ҚР эмитенттерінің корпоративтік облигациялары

2014 жылғы 1 мамырдағы ҚР корпоративтік облигацияларының үлесі портфелдің 21,07% құрайды. Екінші деңгейдегі банктердің және корпоративтік сектордың борыштық бағалы қағаздарына инвестицияланған активтер үлесі 11,75% және сәйкесінше 9,32% құрайды.

Есепті кезеңде ҚР эмитенттерінің корпоративтік облигацияларын сату, сатып алулар болған жоқ.

Портфельдегі ҚР эмитенттерінің корпоративтік облигацияларын өтеуге орташа алынған кірістілік жылына 8,67% құрайды.

4-кесте. 01.05.2014 жылғы жағдай бойынша БЖЗҚ портфеліндегі ҚР екінші деңгейдегі банктерінің облигациялары

ҚР екінші деңгейдегі банктерінің корпоративтік облигациялары		
Бағалы қағаздар түрі және оның эмитенттерінің атауы	ағымдағы құны мың теңгемен	Барлығы зейнетақы активтерінің ағымдағы құнынан пайызбен
«Казкоммерцбанк» АҚ	59 306 152,25	1,47%
«Цеснабанк» АҚ	56 754 530,09	1,41%
«Каспий Банк» АҚ	49 234 253,83	1,22%
«Ресей Жинақбанкі» АҚ ЕБ	47 420 020,40	1,17%
«Еуразиялық банк» АҚ	44 068 455,50	1,09%
«Банк ЦентрКредит» АҚ	40 422 362,14	1,00%
«Қазақстан халық Жинақ банкі» АҚ	36 521 432,28	0,90%
«Нұрбанк» АҚ	35 884 000,29	0,89%
«DeltaBank» АҚ	28 584 864,28	0,71%
«Темірбанк» АҚ	16 473 942,12	0,41%
«AsiacreditBank» АҚ	14 225 597,36	0,35%
«Банк «Bank RBK» АҚ	14 075 735,54	0,35%
БАНК ХОУМ КРЕДИТ АҚ ЕБ	10 778 377,08	0,27%
«АТФ банк» АҚ	6 852 905,79	0,17%
«БАНК ВТБ» АҚ ЕҰ	5 579 512,54	0,13%
АЛЬФА БАНК ЕБ	3 045 693,67	0,08%
«Эксимбанк» АҚ	2 816 996,39	0,07%
«Казинвестбанк» АҚ	1 317 292,74	0,03%
«Альянс Банк» АҚ	748 081,42	0,02%
«Банк KASSA NOVA» АҚ	208 656,20	0,01%
«БТА Банк» АҚ	18 000,13	0,00%
Барлығы:	474 336 861,99	11,75%

5-кесте. 01.05.2014 жылғы жағдай бойынша БЖЗҚ портфеліндегі ҚР корпоративтік облигациялары

ҚР корпоративтік облигациялары		
Бағалы қағаздар түрі және оның эмитенттерінің атауы	ағымдағы құны мың теңгемен	Барлығы зейнетақы активтерінің ағымдағы құнынан пайызбен
«Қазмұнайгаз» АҚ	78 886 506,15	1,95%
"САМРҰҚ ҚАЗЫНА» ҰӘҚ АҚ	73 149 935,10	1,81%
«Қазақстан ипотекалық компаниясы» АҚ	36 554 532,41	0,91%
"Өндірістік келісім-шарт корпорациясы» ҰК» АҚ	24 112 996,73	0,60%
«АПК Инвест» АҚ	17 026 953,11	0,42%
«ДТЖ» АҚ	14 789 343,34	0,37%
«Цатек» АҚ	13 326 517,80	0,33%
«Қазақстан Инжиниринг» АҚ	12 287 801,44	0,30%
«Қазақстан Қағазы» АҚ	10 755 184,70	0,27%
«Батыс транзит» АҚ	10 051 159,61	0,25%
Eurobond «Қазақстан Даму банкі» АҚ	10 016 753,30	0,25%

«КазСтройСервис» АҚ	9 508 129,86	0,24%
«SAT & COMPANY» АҚ	9 019 204,55	0,22%
"НУХ "КАЗАГРО" АҚ	6 845 759,43	0,17%
«Болат Нұржанов атындағы Екібастұз ҚРЭС-1»	6 562 861,17	0,16%
«СевКазЭнерго» АҚ	6 405 766,10	0,16%
"ПАВЛОДАРЭНЕРГО" АҚ	5 889 079,50	0,15%
«БТА Ипотека» АҚ	3 584 709,44	0,09%
«ИМСТАЛЬКОН» АҚ	3 180 796,90	0,08%
«АБДИ Компани» АҚ	3 028 584,31	0,08%
«INNOVA INVESTMENT» ЖШС	2 790 841,87	0,07%
«Самрұқ-Энерго» АҚ	2 371 120,52	0,06%
"НАК"КАЗАТОМПРОМ" АҚ	2 362 054,75	0,06%
«Аграрлық кредиттік корпорация» АҚ	2 260 598,64	0,06%
"НОМЕВРОКЕР" АҚ	2 221 483,27	0,06%
«КТЖ» АҚ	1 704 805,85	0,04%
«АТАМЕКЕН-АГРО» АҚ	1 559 108,84	0,04%
«AMF GROUP» АҚ	1 409 007,98	0,03%
«БЕККЕР И К» ЖШС	1 342 217,84	0,03%
«Казэкспортастық» АҚ	823 004,94	0,02%
«CENTRAL ASIA CEMENT» АҚ	637 057,18	0,02%
«RG BRANDS» АҚ	594 353,80	0,01%
«Астана-финанс» АҚ	418 342,76	0,01%
«Тема И Ко» АҚ	160 777,98	0,00%
«ЭКОТОН +» АҚ	114 760,77	0,00%
«Қарағанды асбестоцементтік өнімдер зауыты» (КЗАИ) АҚ	62 076,86	0,00%
"ТӨРТ-ҚҰДЫҚ" АҚ	50 102,72	0,00%
"БРК-ЛИЗИНГ" АҚ	1 018,04	0,00%
Барлығы:	375 865 309,54	9,31%

Шетелдік эмитенттердің корпоративтік облигациялары, PPN (құрылымдық ноттар)

Инвестициялық портфельдегі шетелдік эмитенттердің корпоративтік облигациялары үлесі 0,98% құрады. Портфельдегі құрылымдық ноттардың үлесі портфельдегі 1,37% құрады.

Шетелдік эмитенттердің корпоративтік облигацияларын және құрылымдық ноттарын сатып алу және сату болған жоқ.

Портфельдегі Шетелдік эмитенттердің корпоративтік облигацияларын және құрылымдық ноттарын өтеуге орташа алынған кірістілік жылына 7,32 % және сәйкесінше 9,03% құрайды.

6-кесте. 01.05.2014 жылғы жағдай бойынша БЖЗҚ портфеліндегі шетелдік эмитенттердің корпоративтік облигациялары және құрылымдық ноттары

Эмитент	ағымдағы құны мың теңгемен	Барлығы зейнетақы активтерінің ағымдағы құнынан пайызбен
Шетелдік эмитенттердің корпоративтік облигациялары		
JPMorganChaseBank	12 984 266,72	0,32%
NOMURA BANK INTL PLC	4 688 244,23	0,12%
ОАО ГАЗПРОМ	4 513 291,30	0,11%
KORDEVBANK	3 710 822,67	0,09%
MORGAN STANLEY	2 496 196,32	0,06%
ОАО SBERBANK	1 958 428,90	0,05%
РОССЕЛЬХОЗБАНК	1 657 720,78	0,04%

UNICREDITBA AG	1 541 954,40	0,04%
RABOBANK NIDERLAND	1 226 519,63	0,03%
GOLDMAN SACHS	1 132 239,52	0,03%
ОАО ROSNEFT	1 093 077,55	0,03%
BARCLAYS BANK	1 057 019,50	0,02%
CATERPILLAR INC	450 799,20	0,01%
SAMARCO MINERACAO SA	345 335,20	0,01%
SOUTHERN COPPER CORP	248 280,68	0,01%
KFW	229 310,54	0,01%
ASTRAZENECA PLC	174 563,13	0,00%
IBM CORP	83 098,60	0,00%
Барлығы:	39 591 168,86	0,98%
құрылымдық ноттар		
PPN MERRILL LYNCH/Bank of America Corp	14 989 090,11	0,37%
SOCIETE GENERAL PPN	19 453 269,00	0,48%
JPMorganChaseBank PPN	8 661 909,98	0,22%
DEUTSHE BANK AG PPN	5 913 566,40	0,15%
GOLDMAN SACHS PPN	3 312 878,40	0,08%
COMMERZBANK AG PPN	2 554 932,33	0,06%
CITIGROUP INC PPN	360 660,00	0,01%
Барлығы:	55 246 306,21	1,37%

ҚР эмитенттерінің акциялары және депозитарлық қолхаттары

Есепті кезеңде БЖЗҚ портфеліндегі ҚР эмитенттерінің акциялары және депозитарлық қолхаттардың үлесі портфелдің 4,43% құрады.

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

Акциялар мен депозитарлық қолхаттарға инвестиция ішінде ҚР компаниялары бар:

7-кесте. 01.05.2014 жылғы жағдай бойынша БЖЗҚ портфеліндегі ҚР эмитенттерінің акциялары мен депозитарлық қолхаттары

ҚР эмитенттерінің акциялары мен депозитарлық қолхаттары		
Эмитент	ағымдағы құны мың теңгемен	Барлығы зейнетақы активтерінің ағымдағы құнынан пайызбен
«Қазақстан Халық Жинақ Банкі» АҚ	55 425 283,09	1,37%
«KCELL» АҚ	28 612 495,37	0,71%
«РД КазМунайГаз» АҚ	27 379 064,01	0,68%
«SAT & COMPANY» АҚ	19 143 202,77	0,47%
«Казтрансойл» АҚ	11 212 594,96	0,28%
"АТАМЕКЕН-АГРО" АҚ	10 128 234,85	0,25%
«Цеснабанк» АҚ	7 753 643,56	0,19%
«Қазақтелеком» АҚ	4 536 872,28	0,11%
«Нұрбанк» АҚ	2 385 975,18	0,06%
ЭКСИМБАНК АҚ	2 211 449,17	0,05%
«Манғыстау үлестіру электр желілік компания» АҚ	1 767 699,51	0,04%
"REAL-INVEST" АҚ	1 467 529,21	0,04%
«Mineral Resources of Central Asia» АҚ	1 347 052,96	0,03%
"БАЯН СУЛУ" АҚ	1 097 478,68	0,03%

«Темірбанк» АҚ	1 060 045,70	0,03%
«БанкЦентрКредит» АҚ	826 889,47	0,02%
«БТА банк» АҚ	812 292,76	0,02%
DELTA BANK	710 937,92	0,02%
«Қазкоммерцбанк» АҚ	346 436,08	0,01%
KAZTRANSKOM	337 328,88	0,01%
"АКТЮБЗАВНЕФОБОР" АҚ	209 596,64	0,01%
АТФ БАНК АҚ	124 128,28	0,00%
«Альянс Банк» АҚ	6 065,99	0,00%
Барлығы:	178 902 297,35	4,43%

Шетелдік эмитенттердің акциялары және депозитарлық қолхаттары

Есепті күнге БЖЗҚ зейнетақы активтерінің портфеліндегі шетелдік эмитенттердің акцияларының үлесі портфелдің 0,30% құрады.

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

Акцияларға инвестициялау ішінде мынадай компаниялар бар:

8-кесте. 01.05.2014 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	2 582 674,09	0,06%
ГАЗПРОМ АҚ	2 493 240,05	0,06%
DEUTSHE BANK AG	1 337 691,78	0,03%
RIO TINTO PLC	1 158 183,55	0,03%
MCMORAN COPPER	1 114 207,20	0,03%
"Банк ВТБ" ААҚ	909 085,09	0,02%
KAZAKHMYS PLC	606 768,42	0,02%
ORANGE	438 789,68	0,01%
ГМК "НОР.НИКЕЛЬ" ААҚ	386 537,05	0,01%
NEWMONT MINING CORP	298 560,19	0,01%
BARRICK GOLD CORP	218 266,90	0,01%
CHINA MOBILE ADR	136 948,16	0,01%
POSCO ADR	127 930,10	0,00%
EURASIAN NATURAL RESOURCES CORPORATION PLC	114 388,77	0,00%
CATERPILLAR INC	95 308,41	0,00%
VALE DE RIO DOCE SA	25 931,88	0,00%
Барлығы:	12 044 511,34	0,30%

Тазартылған қымбат металдар

Тазартылған қымбат металға инвестициялау алтынмен жүргізіледі. Инвестициялық портфелдегі алтын үлесі портфелдің 4,18 % құрайды. Есепті кезеңде тазартылған қымбат металл сатылған және сатып алынған жоқ.

Есепті айдың басына алтын бағасы бір троя унциясына 1 295,75 АҚШ долларын құрады, мұндайда айдың аяғында алтын бағасы бір троя унциясына 1 294,25 АҚШ долларын құрады.

9-кесте. 01.05.2014 жылғы жағдай бойынша БЖЗҚ портфеліндегі тазартылған қымбат металл

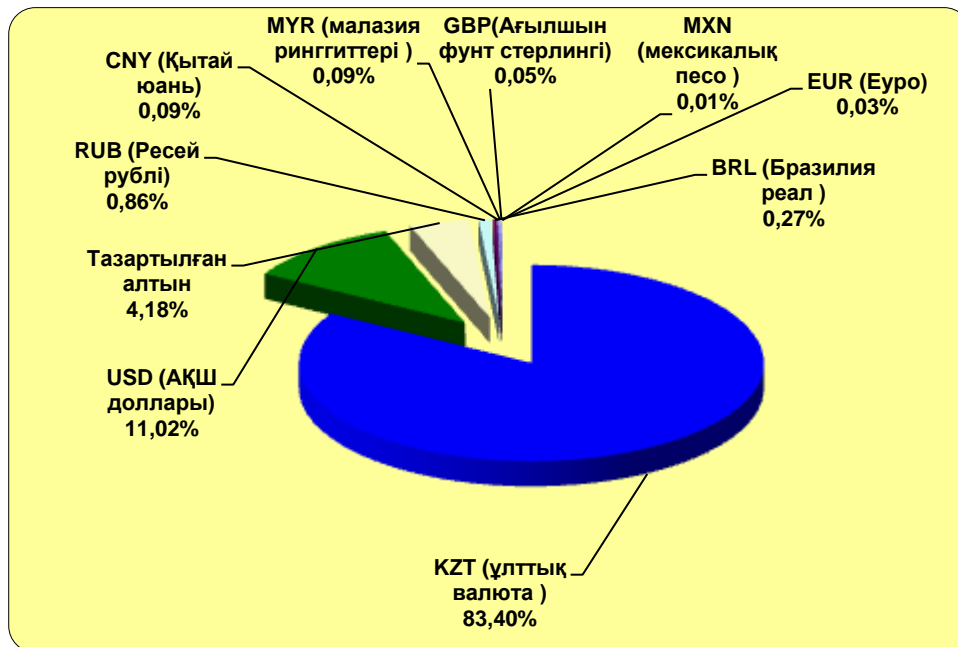
Тазартылған қымбат металл		
Тазартылған алтын	ағымдағы құны мың теңгемен	Барлығы зейнетақы активтерінің ағымдағы құнынан пайызбен
Алтын	168 817 957,50	4,18%
<i>Барлығы:</i>	<i>168 817 957,50</i>	<i>4,18%</i>

Валюталар бойынша құрылымдық үлестіру.

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

- ұлттық валюта – 83,40%;
- АҚШ доллары – 11,02%;
- Тазартылған алтын – 4,18%;
- Ресей рублі – 0,86%;
- малазия ринггиттері – 0,09%;
- еуро – 0,03%;
- ағылшын фунт стерлингi – 0,05%;
- бразилия реалы – 0,27%.
- мексикалық песо – 0,01%.
- Қытай юань – 0,09%.

1-сурет. 01.05.2014 жылғы жағдай бойынша валюта бөлігінде БЖЗҚ зейнетақы активтері портфелінің құрылымы



Инвестициялық қызметтің нәтижесі

2014 жылғы сәуір айы үшін БЖЗҚ зейнетақы активтері бойынша есептелген инвестициялық табыс 30,61 млрд. теңгені құрады.

Инвестициялық табыс/шығынның құрылымы:

- ✓ Екінші деңгейдегі банктердегі салымдар бойынша инвестициялық табыс 1,52 млрд. теңгені құрады.
- ✓ Бағалы қағаздар бойынша инвестициялық табыс 29,11 млрд. теңгені құрады.
- ✓ «Кері РЕПО» операциялары бойынша инвестициялық табыс 33,89 млн. теңгені құрады.

✓ Тазартылған қымбат металдар (алтын) бойынша инвестициялық шығын (- 196,10) млрд. теңгені құрады.

✓ Валюталық қайтабағалаудан инвестициялық табыс 138,75 млрд. теңгені құрады.

2014 жылғы сәуір айында алтынға бағалардың құбылмалылығы аталған кезеңде шығынға әкелді.

2014 жылғы сәуір айы үшін БЖЗҚ шартты зейнетақы бірлігі өсімінің қарқыны 0,65% құрады.

Уақытша инвестициялық декларация параметрлерінің сақталуы туралы ақпарат

Зейнетақы активтерін құрылымдық үлестіру БЖЗҚ уақытшы инвестициялық декларациясының талаптарына сәйкес келеді. Валюталық позиция үлестері мүмкін деңгей шегінде қалады және БЖЗҚ уақытша инвестициялық декларациясының талаптарын бұзбайды.

9-кесте. 01.05.2014 жылғы жағдай бойынша инвестициялау нысандарының тізбесі мен нысандары

Қаржы құралының түрі	Инвестициялау лимиттері	Үлесі
Борыштық құралдар	100% аспайды	74,57%
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%	46,73%
Шетел мемлекеттерінің орталық үкіметімен шығарылған (берген) мемлекеттік мәртебесі бар бағалы қағаздар	35% аспайтын	3,15%
Қор биржасының ресми тізіміне енген Қазақстан Республикасының жергілікті атқарушы органдары шығарған облигациялар	10% аспайтын	0,14%
Қазақстан Республикасы эмитенттерінің мемлекеттік емес борыштық бағалы қағаздары, оның ішінде:	30% аспайтын	20,93%
1) Қазақстан Республикасы ұйымдарының ипотекалық облигациялары	15% аспайтын	0,70%
2) «Самұқ-Қазына» ұлттық әл-ауқат қоры» акционерлік қоғамы шығарған борыштық бағалы қағаздар	10% аспайтын	1,81%
халықаралық және шетел ұйымдары шығарған борыштық бағалы қағаздар	35% аспайтын	1,14%
құрылымдық ноттар	5% аспайтын	1,37%
Үлесті құралдар	30% аспайтын	4,73%
Қазақстан Республикасының ұйымдары, шетел ұйымдары шығарған мемлекеттік емес үлесті бағалы қағаздар, оның ішінде	30% аспайтын	4,73%
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	4,43%
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	0,30%
Екінші деңгейдегі банктердегі салымдар	25% аспайтын	6,06%
Басқа құралдар	30% аспайтын	4,18%
Тазартылған қымбат металдар, оның ішінде метал депозиттері	10% аспайтын	4,18%
туынды қаржы құралдары, оның ішінде опцион, форвард, 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%
Валюталық нетто-позиция	50% аспайтын	16,60%
АҚШ доллары, Еуро, Ағылшын фунт стерлингіде ашық валюталық позиция	50% аспайтын	15,28%
Басқа валюталар бойынша ашық валюталық позиция	15% аспайтын	1,31%