

## **2013 жылғы желтоқсан айына зейнетақы активтерін сенімгерлік басқару бойынша шарттарға сәйкес «БЖЗҚ» АҚ зейнетақы активтерін инвестициялық басқару бойынша ақпарат**

2014 жылғы 1 қаңтардағы жағдай бойынша БЖЗҚ зейнетақы активтері (бұдан әрі - ЗА) 1 277,22 млрд. теңгені құрады.

### **Инвестициялық портфель**

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

Портфельдегі қаржы құралдарының түрі	01.12.2013 ж. үлесі	01.01.2014 ж. үлесі
ҚР МБҚ	49,13%	49,35%
Шетелдік мемлекеттердің МБҚ	1,89%	1,70%
ХҚҰ	2,10%	1,94%
ҚР эмитенттерінің корпоративтік облигациялары	22,53%	23,42%
Шетелдік эмитенттердің корпоративтік облигациялары	0,17%	0,71%
PPN (құрылымдық ноттар)	0,76%	0,70%
ҚР эмитенттерінің акциялары және депозитарлық қолхаттары	3,36%	3,40%
Шетелдік эмитенттердің акциялары және депозитарлық қолхаттары	0,72%	0,66%
Қымбат металдар (алтын)	5,15%	4,53%
Депозиттер	12,79%	10,96%
РЕПО	0,04%	0,89%
Ақша және басқа активтер	1,37%	1,74%
<b>Барлық ЗА</b>	<b>100,00%</b>	<b>100,00%</b>

Зейнетақы активтерінің инвестициялық портфелін өтеуге орташа алынған кірістілік жылына 5,38% құрады.

#### **Қазақстан Республикасының мемлекеттік бағалы қағаздары**

1-кестеге сәйкес, 2013 жылғы 1 қаңтардағы жағдай бойынша БЖЗҚ зейнетақы активтері инвестицияларының портфелі негізінде Қазақстан Республикасының мемлекеттік бағалы қағаздарымен ұсынылған. Портфельдегі олардың үлесі 49,13%-дан 49,35%-ға дейін ұлғайды. Есепті күнге БЖЗҚ портфеліндегі ҚР МБҚ көлемі 630,34 млрд. теңгені құрады.

ҚР МБҚ үлесінің ұлғаюы «Атамекен» ЖЗҚ зейнетақы активтерінің бірігуі, сонымен қатар есепті кезеңде бастапқы нарықта келесідей ҚР МБҚ сатып алуына байланысты туындады:

- 64,10 млрд. теңге көлемінде МЕУКАМ-300;
- 45,12 млрд. теңге көлемінде МЕУКАМ-96;
- 27,80 млрд. теңге мөлшерінде МЕУКАМ-072;
- 9,96 млрд. теңге мөлшерінде МЕОКАМ-060;
- 1,00 млрд. теңге мөлшерінде МЕУКАМ-180.

Портфельдегі ҚР МБҚ бойынша өтеуге орташа алынған кірістілік жылына 5,16% 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 қаңтардағы жағдай бойынша 1,70% және сәйкесінше 1,94% 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 4,13% және 4,22% құрады.

**2-кесте. 01.01.2014 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	20 309 479,60	1,59%
РФ Қаржы Мин.	1 405 139,78	0,11%
<b>Барлығы:</b>	<b>21 714 619,38</b>	<b>1,70%</b>
<b>Халықаралық қаржы ұйымы</b>		
ЕВРАЗБР (Еуразиялық Даму банкі)	17 389 475,28	1,36%
ЕБРД (Еуропалық Инвестициялық банк)	5 397 409,11	0,42%
EIB (Еуропалық Қайта құру және Даму банкі)	1 994 565,82	0,16%
<b>Барлығы:</b>	<b>24 781 450,21</b>	<b>1,94%</b>

**Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банктеріндегі депозиттер**

2013 жылғы желтоқсанда инвестициялық портфелдегі зейнетақы активтерінің жалпы көлемінің артуы және депозиттерді өтеу нәтижесінде депозиттердің үлесі төмендеді, ол зейнетақы активтерінің 10,96% құрады. ЕДБ-ға ұлттық валютада салымдарды орналастыру көлемі 115,52 млрд. теңгені, шетел валютасында - 100,00 млн. АҚШ долларын құрады.

Қарастырылып отырған кезеңде келесі бес екінші деңгейдегі банктерде депозиттер өтелді:

- «АТФ Банк» АҚ 9,25 млрд. теңге мөлшерінде;
- «БанкЦентрКредит» АҚ 5,48 млрд. теңге мөлшерінде;
- «Банк ВТБ» АҚ 1,06 млрд. теңге мөлшерінде;
- «Цеснабанк» АҚ 2,00 млрд. теңге мөлшерінде;
- «Ресей Жинақбанкі» АҚ 115,72 млн. теңге мөлшерінде;

Мұнымен бірге, есепті кезеңде ЕДБ-ға депозиттер орналастырылмады.

ЕДБ депозиттер бойынша өтеуге орташа алынған кірістілік жылына 6,79% құрады.

Есепті күнге депозиттер Қазақстан Республикасының келесі банктеріне орналастырылған:

**3-кесте. 01.01.2014 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	27 789 071,34	2,18%
«Банк ЦентрКредит» АҚ	22 933 610,96	1,80%
«Цеснабанк» АҚ	16 983 825,56	1,33%
«Еуразиялық банк» АҚ	16 839 773,97	1,32%
«Казкоммерцбанк» АҚ	15 899 836,16	1,24%
«KaspiBank» АҚ	13 236 747,22	1,04%
«АТФ Банк» АҚ	10 302 359,33	0,81%
«Банк ВТБ» АҚ ЕБ	7 959 666,67	0,62%
«Банк «РВК» АҚ	2 538 111,11	0,20%
«Хоум Кредит» АҚ ЕБ	2 200 000,00	0,17%
«Альфа-Банк» АҚ ЕБ	2 057 534,25	0,16%
"БАНК KASSA NOVA» АҚ	700 000,00	0,05%
«Казинвестбанк» АҚ	500 000,00	0,04%
<b>Барлығы:</b>	<b>139 940 536,56</b>	<b>10,96%</b>

**ҚР эмитенттерінің корпоративтік облигациялары**

2013 жылғы желтоқсанда «Атамекен» ЖЗҚ зейнетақы активтерінің бірігуі нәтижесінде ҚР корпоративтік облигацияларының үлесі портфелдің 22,53%-дан 23,42%-ға ұлғайды.

Қарастырылып отырған кезеңде 6,41 млн. АҚШ доллары көлемінде «Казкоммерцбанк» АҚ еурооблигациялары, 5,02 млрд. теңге көлемінде «Ресей Жинақбанкі» АҚ ЕБ облигациялары сатып алынған болатын.

Есепті кезеңде 218,16 млн. теңге мөлшерінде «Логиком» АҚ, 1,72 млрд. теңге мөлшерінде «Resmi» АҚ корпоративтік облигациялары өтелді.

Портфельдегі ҚР эмитенттерінің корпоративтік облигациялары бойынша өтеуге орташа алынған кірістілік жылына 7,53% құрады.

**4-кесте. 01.01.2014 жылғы жағдай бойынша БЖЗҚ портфеліндегі ҚР эмитенттерінің 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>
«Цеснабанк» АҚ	22 434 414,33	1,76%
«Ресей Жинақбанкі» АҚ ЕБ	21 506 337,98	1,68%
«Банк ЦентрКредит» АҚ	18 109 269,20	1,42%
«Каспий Банк» АҚ	18 002 970,39	1,41%
«Қазмұнайгаз» АҚ	17 221 884,50	1,35%
«Нұрбанк» АҚ	14 594 099,26	1,14%
«Еуразиялық банк» АҚ	12 951 468,37	1,01%
«Қазақстан ипотекалық компаниясы» АҚ	12 727 778,08	1,00%
«Казкоммерцбанк» АҚ Eurobond	11 061 627,17	0,87%
«ДТЖ» АҚ	9 256 455,21	0,72%
«Қазақстан халық Жинақ банкі» АҚ Eurobond	9 225 596,80	0,72%
«САМРҰҚ ҚАЗЫНА» ӘҰҚ» АҚ	9 147 333,80	0,72%
«Қазақстан Инжиниринг» АҚ	7 738 462,45	0,61%
«DeltaBank» АҚ	7 692 935,70	0,60%
«Батыс транзит» АҚ	7 690 332,62	0,60%
«Қазақстан Даму банкі» АҚ Eurobond	7 668 752,22	0,60%
«Темірбанк» АҚ	7 377 408,44	0,58%
«Казкоммерцбанк» АҚ	7 376 980,76	0,58%
"Өндірістік келісім-шарт корпорациясы» ҰК» АҚ	6 991 326,34	0,55%
«Қазақстан Халық Жинақ банкі» АҚ	6 643 226,06	0,52%
«АТФ банк» АҚ Eurobond	6 041 867,82	0,47%
«Қазэкспортастық» АҚ	5 320 943,85	0,42%
«Цатек» АҚ	5 171 627,75	0,40%
«АПК Инвест» АҚ	4 984 698,53	0,39%
«АТФ банк» АҚ	4 786 742,56	0,37%
«КазСтройСервис» АҚ	3 868 878,31	0,30%
«Қазақстан Қағазы» АҚ	3 407 263,79	0,27%
«Банк ЦентрКредит» АҚ Eurobond	3 112 114,63	0,24%
«Болат Нұржанов атындағы Екібастұз ҚРЭС-1» ЖШС	2 768 713,99	0,22%
«INNOVA INVESTMENT» ЖШС	2 668 336,82	0,21%
«Банк «Bank RBK» АҚ	2 622 993,71	0,21%
«БТА Ипотека» АҚ	2 234 115,47	0,17%
«SAT & COMPANY» АҚ	2 165 091,53	0,17%
«СевКазЭнерго» АҚ	1 994 926,52	0,16%
"ПАВЛОДАРЭНЕРГО" АҚ	1 917 035,51	0,15%
«БАНК ВТБ» АҚ ЕҰ	1 840 038,97	0,14%
«АБДИ Компани» АҚ	1 542 237,42	0,12%
«AsiacreditBank» АҚ	1 014 537,44	0,08%
«Альянс Банк» АҚ	1 001 888,55	0,08%
«Аграрлық кредиттік корпорация» АҚ	690 939,28	0,05%
«Казинвестбанк» АҚ	636 664,02	0,05%

«CENTRAL ASIA CEMENT» АҚ	615 115,75	0,05%
«БЕККЕР И К» ЖШС	561 122,70	0,04%
«RG BRANDS» АҚ	548 755,85	0,04%
«Самрұқ-Энерго» АҚ	469 305,74	0,04%
«AMF GROUP» АҚ	456 124,92	0,04%
«Маңғыстау үлестіру электржелілік компания» АҚ	340 195,74	0,03%
"НOMEBROKER" АҚ	237 238,93	0,02%
«Банк KASSA NOVA» АҚ	202 951,40	0,02%
«Астана-финанс» АҚ	187 989,07	0,01%
«Тема И Ко» АҚ	159 179,07	0,01%
«ИМСТАЛЬКОН» АҚ	98 429,24	0,01%
«БТА Банк» АҚ	15 346,24	0,00%
«Қарағанды асбестоцемент өнімдері зауыты» АҚ	8 144,90	0,00%
<b>Барлығы:</b>	<b>299 110 215,67</b>	<b>23,42%</b>

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

«Атамекен» ЖЗҚ зейнетақы активтерін біріктіру нәтижесінде инвестициялық портфельдегі шетелдік эмитенттердің корпоративтік облигацияларының үлесі портфельдің 0,71% құрады. Портфельдегі құрылымдық ноттардың үлесі портфельдің 0,70% құрады.

Осымен бірге «Атамекен» ЖЗҚ АҚ зейнетақы активтерінің құрамындағы 7,13 млрд. теңге мөлшеріндегі COMMERZBANK AG, MORGAN STANLEY, UNICREDITBA AG, CATERPILLAR INC, SAMARCO MINERACAO SA, SOUTHERN COPPER CORP, KFW, ASTRAZENECA PLC, IBM CORP корпоративтік облигациялары БЖЗҚ АҚ инвестициялық портфельінің құрамына ауыстырылған болатын.

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 6,21 % және сәйкесінше 2,56% құрады.

### 5-кесте. 01.01.2014 жылғы жағдай бойынша БЖЗҚ портфельіндегі шетелдік эмитенттердің корпоративтік облигациялары және құрылымдық ноттары

Эмитент	ағымдағы құны мың теңгемен	Барлығы зейнетақы активтерінің ағымдағы құнынан пайызбен
<b>Шетелдік эмитенттердің корпоративтік облигациялары</b>		
COMMERZBANK AG	2 296 059,29	0,18%
MORGAN STANLEY	1 948 647,23	0,15%
UNICREDITBA AG	1 597 789,44	0,13%
JPMorganChaseBank	1 021 830,17	0,08%
RABOBANK NIDERLAND	928 925,09	0,07%
CATERPILLAR INC	422 608,21	0,03%
SAMARCO MINERACAO SA	279 236,96	0,02%
SOUTHERN COPPER CORP	189 644,78	0,01%
KFW	192 757,30	0,02%
ASTRAZENECA PLC	138 240,09	0,01%
IBM CORP	68 844,82	0,01%
<b>Жиыны :</b>	<b>9 084 583,39</b>	<b>0,71%</b>
<b>Құрылымдық ноттар</b>		
PPN MERRILL LYNCH/Bank of America Corp	8 962 158,70	0,70%
<b>Жиыны :</b>	<b>8 962 158,70</b>	<b>0,70%</b>

### ҚР эмитенттерінің акциялары және депозитарлық қолхаттары

Есепті кезеңде БЖЗҚ портфеліндегі ҚР эмитенттері акцияларының және депозитарлық қолхаттардың үлесі портфелдің 3,36% -дан 3,40 %-ға дейін артты. ҚР эмитенттері депозитарлық қолхаттары және акциялары үлесінің артуы зейнетақы активтерінің жалпы көлемінің ұлғаюы нәтижесінде туындады.

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

Акциялар мен депозитарлық қолхаттарға инвестиция ішінде мынадай ҚР компаниялары бар:

**6-кесте.** 01.01.2014 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
«SAT & COMPANY» АҚ	13 473 018,73	1,05%
«KCELL» АҚ	7 965 840,11	0,62%
«Цеснабанк» АҚ	6 235 062,68	0,49%
«Қазақстан Халық Жинақ Банкі» АҚ	4 476 757,89	0,35%
«Нұрбанк» АҚ	2 032 568,60	0,16%
«Казтрансойл» АҚ	2 025 246,60	0,16%
«Манғыстау үлестіру электр желілік компания» АҚ	1 768 155,51	0,14%
«Қазақтелеком» АҚ	1 490 465,31	0,12%
«РД КазМунайГаз» АҚ	1 410 424,59	0,11%
«Mineral Resources of Central Asia» АҚ	1 002 585,17	0,08%
«БанкЦентрКредит» АҚ	713 085,07	0,06%
«Темірбанк» АҚ	285 958,64	0,02%
KAZAKHMYN PLC	183 281,49	0,01%
«БТА банк» АҚ	162 006,62	0,01%
«Қазкоммерцбанк» АҚ	97 224,20	0,01%
EURASIAN NATURAL RESOURCES CORPORATION PLC	95 196,32	0,01%
«Альянс Банк» АҚ	3 629,74	0,00%
<b>Барлығы:</b>	<b>43 420 507,29</b>	<b>3,40%</b>

### Шетелдік эмитенттердің акциялары және депозитарлық қолхаттары

Есепті күнге БЖЗҚ зейнетақы активтерінің портфеліндегі шетелдік эмитенттердің акцияларының үлесі портфелдің 0,66% құрады.

Желтоқсан айында шетелдік эмитенттердің акциялары мен депозитарлық қолхаттарын сату және сатып алу болған жоқ.

Акцияларға инвестициялау ішінде мынадай компаниялар бар:

**7-кесте.** 01.01.2014 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	2 559 194,34	0,20%
DEUTSHE BANK	1 247 642,29	0,10%
ГАЗПРОМ АҚ	1 064 544,24	0,08%
MCMORAN COPPER	1 039 905,00	0,08%
RIO TINTO PLC	993 264,42	0,08%
"Банк ВТБ" ААҚ	879 377,19	0,07%

ORANGE	307 541,29	0,02%
ГМК "НОР.НИКЕЛЬ" ААҚ	302 151,10	0,02%
VALE DE RIO DOCE SA	24 571,72	0,007%
BARRICK GOLD CORP	7 444,45	0,003%
<b>Барлығы:</b>	<b>8 425 636,05</b>	<b>0,66%</b>

### Тазартылған қымбат металдар

Тазартылған қымбат металға инвестициялау алтынмен жүргізіледі. Инвестициялық портфельдегі алтын үлесі портфельден 5,15 %-дан біршама 4,53%-ға төмендеді. Есепті кезеңде тазартылған қымбат металды сату және сатып алу болған жоқ.

Есепті айдың басына алтын бағасы бір троя унциясына 1 245,25 АҚШ долларын құрады, мұндайда айдың аяғында алтын бағасы бір троя унциясына 1 209,25 АҚШ долларына дейін төмендеді.

**8-кесте.** 01.01.2014 жылғы жағдай бойынша БЖЗҚ портфеліндегі тазартылған қымбат металдар

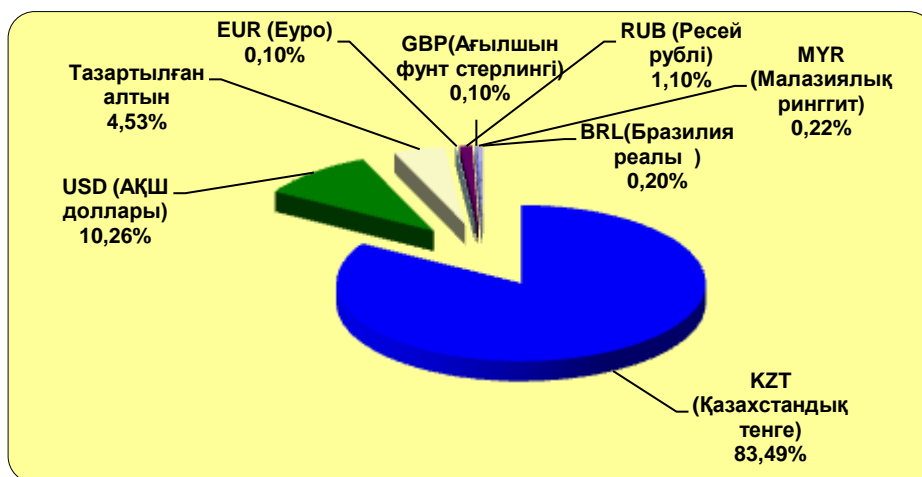
Тазартылған қымбат металл		
Тазартылған алтын	ағымдағы құны мың теңгемен	Барлығы зейнетақы активтерінің ағымдағы құнынан пайызбен
Алтын	57 844 130,84	4,53%
<b>Барлығы:</b>	<b>57 844 130,84</b>	<b>4,53%</b>

### Валюталар бойынша құрылымдық үлестіру.

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

- ұлттық валюта – 83,49%;
- АҚШ доллары – 10,26%;
- Тазартылған алтын – 4,53%;
- Ресей рублі – 1,10%;
- Малазия рингиттері – 0,22%;
- Еуро – 0,10%;
- Ағылшын фунт стерлингі – 0,10%;
- Бразилия реалы – 0,20%.

**1-сурет.** 01.01.2014 жылғы жағдай бойынша валюта бөлігінде БЖЗҚ зейнетақы активтері портфелінің құрылымы



### Инвестициялық қызметтің нәтижесі

2013 жылғы желтоқсан айы үшін БЖЗҚ зейнетақы активтері бойынша есептелген инвестициялық табыс/шығын 10,78 млрд. теңгені құрады.

Инвестициялық табыс/шығынның құрылымы:

- ✓ Екінші деңгейдегі банктердегі салымдар бойынша инвестициялық табыс 793,94 млн. теңгені құрады.
- ✓ Бағалы қағаздар бойынша инвестициялық табыс 11,01 млрд. теңгені құрады.
- ✓ «Кері РЕПО» операциялары бойынша инвестициялық табыс 15,35 млн. теңгені құрады.
- ✓ Тазартылған қымбат металлдар (алтын) бойынша инвестициялық шығын (-1,55) млрд. теңгені құрады.
- ✓ Валюталық қайтабағалаудан инвестициялық табыс 512,88 млн. теңгені құрады.

2013 жылғы желтоқсан айы үшін БЖЗҚ шартты зейнетақы бірлігі өсімінің қарқыны 0,85% құрады.

2013 жылға БЖЗҚ зейнетақы активтері бойынша есептелген инвестициялық табыс/шығын 24,35 млрд. теңгені құрады.

Инвестициялық табыс/шығынның құрылымы:

- ✓ Екінші деңгейдегі банктердегі салымдар бойынша инвестициялық табыс 8,19 млрд. теңгені құрады.
- ✓ Бағалы қағаздар бойынша инвестициялық табыс 31,79 млрд. теңгені құрады.
- ✓ «Кері РЕПО» операциялары бойынша инвестициялық табыс 600,17 млн. теңгені құрады.
- ✓ Тазартылған қымбат металлдар (алтын) бойынша инвестициялық шығын (-18,01) млрд. теңгені құрады.
- ✓ Валюталық қайтабағалаудан инвестициялық табыс 1,77 млрд. теңгені құрады.

2013 жыл үшін БЖЗҚ шартты зейнетақы бірлігі өсімінің қарқыны 2,22% құрады.

### Уақытша инвестициялық декларация параметрлерінің сақталуы туралы ақпарат

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

### 9-кесте. 01.12.2013 жылғы жағдай бойынша инвестициялау нысандарының тізбесі мен лимиттері

Қаржы құралының түрі	Инвестициялау лимиттері	Үлесі
<b>Борыштық құралдар</b>	<b>80% дейін</b>	<b>77,83%</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>50,24%</b>
Шетел мемлекеттерінің орталық үкіметімен шығарылған (берген) мемлекеттік мәртебесі бар бағалы қағаздар	35% аспайтын	<b>1,70%</b>
Қор биржасының ресми тізіміне енген Қазақстан Республикасының жергілікті атқарушы органдары шығарған облигациялар	10% аспайтын	<b>0,41%</b>
Қазақстан Республикасы эмитенттерінің мемлекеттік емес борыштық бағалы қағаздары, оның ішінде:	30% аспайтын	<b>23,27%</b>
1) Қазақстан Республикасы ұйымдарының ипотекалық облигациялары	15% аспайтын	1,15%
2) «Самрұқ-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>1,94%</b>
құрылымдық ноттар (principal protected notes)	5% аспайтын	<b>0,70%</b>

<b>Үлесті құралдар</b>	<b>30% дейін</b>	<b>4,06%</b>
Қазақстан Республикасының ұйымдары, шетел ұйымдары шығарған мемлекеттік емес үлесті бағалы қағаздар, оның ішінде	30% аспайтын	4,06%
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	3,40%
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	0,66%
<b>Екінші деңгейдегі банктердегі салымдар</b>	<b>25% дейін</b>	<b>10,96%</b>
<b>Басқа құралдар</b>	<b>30% дейін</b>	<b>4,53%</b>
Тазартылған қымбат металдар, оның ішінде метал депозиттері	10% дейін	<b>4,53%</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>16,97%</b>
АҚШ доллары, Еуро, Ағылшын фунт стерлингінде ашық валюталық позиция	50% аспайтын	14,99%
Басқа валюталар бойынша ашық валюталық позиция	15% аспайтын	1,53%