

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

2014 жылғы 1 ақпандағы жағдай бойынша БЖЗҚ зейнетақы активтері (бұдан әрі - ЗА) 1 738,52 млрд. теңгені құрады.

Инвестициялық портфель

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

Портфельдегі қаржы құралдарының түрі	01.01.2014 ж. үлесі	01.02.2014 ж. үлесі
ҚР МБҚ	49,35%	47,62%
Шетелдік мемлекеттердің МБҚ	1,70%	1,33%
ХҚҰ	1,94%	1,48%
ҚР эмитенттерінің корпоративтік облигациялары	23,42%	27,58%
Шетелдік эмитенттердің корпоративтік облигациялары	0,71%	0,54%
PPN (құрылымдық ноттар)	0,70%	0,92%
ҚР эмитенттерінің акциялары және депозитарлық қолхаттары	3,40%	3,17%
Шетелдік эмитенттердің акциялары және депозитарлық қолхаттары	0,66%	0,63%
Қымбат металдар (алтын)	4,53%	4,45%
Депозиттер	10,96%	8,87%
РЕПО	0,89%	1,94%
Ақша және басқа активтер	1,74%	1,47%
Барлық ЗА	100,00%	100,00%

Зейнетақы активтерінің инвестициялық портфелін өтеуге орташа алынған кірістілік жылына 5,43% құрады.

Қазақстан Республикасының мемлекеттік бағалы қағаздары

1-кестеге сәйкес, 2014 жылғы 1 ақпандағы жағдай бойынша БЖЗҚ зейнетақы активтері инвестицияларының портфелі негізінде Қазақстан Республикасының мемлекеттік бағалы қағаздарымен ұсынылған. Портфельдегі олардың үлесі 49,35%-дан 47,62%-ға дейін азайды. Есепті күнге БЖЗҚ портфеліндегі ҚР МБҚ көлемі 827,94 млрд. теңгені құрады.

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

- 3,92 млрд. теңге көлемінде МЕУКАМ-108;
- 1,00 млрд. теңге көлемінде МЕУЖКАМ-132.

Портфельдегі ҚР МБҚ бойынша өтеуге орташа алынған кірістілік жылына 4,89% 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 ақпандағы жағдай бойынша 1,33% және сәйкесінше 1,48% 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 0,42% және 3,29% құрады.

2-кесте. 01.02.2014 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	21 724 568,87	1,25%
РФ Қаржы Мин.	1 332 501,35	0,08%
Барлығы:	23 057 070,22	1,33%
Халықаралық қаржы ұйымы		
ЕВРАЗБР (Еуразиялық Даму банкі)	18 661 506,34	1,07%
ЕІВ (Еуропалық Инвестициялық банк)	5 141 190,78	0,30%
EBRD (Еуропалық Қайта құру және Даму банкі)	1 903 576,38	0,11%
Барлығы:	25 706 273,50	1,48%

Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банктеріндегі депозиттер

2013 жылғы қаңтарда инвестициялық портфелдегі зейнетақы активтерінің жалпы көлемінің артуы және депозиттерді өтеу нәтижесінде депозиттердің үлесі төмендеді, ол зейнетақы активтерінің 8,87% құрады. ЕДБ-ға ұлттық валютада салымдарды орналастыру көлемі 128,82 млрд. теңгені, шетел валютасында - 100,00 млн. АҚШ долларын құрады.

Қарастырылып отырған кезеңде келесі екінші деңгейдегі банктерде депозиттер өтелді:

- ✓ «Еуразиялық банк» АҚ 1,86 млрд. теңге мөлшерінде;

Мұнымен бірге, есепті кезеңде ЕДБ-ға депозиттер орналастырылмады.

ЕДБ депозиттер бойынша өтеуге орташа алынған кірістілік жылына 6,89% құрады.

Есепті күнге депозиттер Қазақстан Республикасының келесі банктеріне орналастырылған:

3-кесте. 01.02.2014 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	27 928 277,39	1,61%
«CaspiBank» АҚ	23 687 983,33	1,36%
«Банк ЦентрКредит» АҚ	23 042 917,81	1,33%
«Цеснабанк» АҚ	19 075 558,89	1,10%
«Казкоммерцбанк» АҚ	16 107 882,88	0,93%
«Еуразиялық банк» АҚ	15 040 422,44	0,87%
«АТФ Банк» АҚ	10 356 829,64	0,60%
«Банк ВТБ» АҚ ЕБ	8 000 655,56	0,46%
«Deltabank» АҚ	3 017 416,67	0,17%
«Банк «РВК» АҚ	2 543 944,44	0,15%
«Хоум Кредит» АҚ ЕБ	2 200 000,00	0,13%
«Альфа-Банк» АҚ ЕБ	2 070 273,97	0,12%
"БАНК KASSA NOVA» АҚ	700 000,00	0,04%
«Казинвестбанк» АҚ	500 000,00	0,03%
Барлығы:	154 272 163,02	8,87%

ҚР эмитенттерінің корпоративтік облигациялары

2014 жылғы қаңтарда «МұнайГаз-Дем» ЖЗҚ және «Астана» ЖЗҚ зейнетақы активтерінің бірігуі нәтижесінде ҚР корпоративтік облигацияларының үлесі портфелдің 23,42%-дан 27,57%-ға ұлғайды. Екінші деңгейдегі банктердің және корпоративтік сектордың борыштық бағалы қағаздарына инвестицияланған активтер үлесі 16,88 % және сәйкесінше 10,70% құрады.

Қарастырылып отырған кезеңде 6,74 млрд. теңге көлемінде «Жинақбанк» АҚ ЕБ облигациялары сатып алынған болатын.

Есепті кезеңде ҚР эмитенттерінің корпоративтік облигациялары сатылған жоқ.

Портфельдегі ҚР эмитенттерінің корпоративтік облигациялары бойынша өтеуге орташа алынған кірістілік жылына 7,76% құрады.

4-кесте. 01.02.2014 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
«Ресей Жинақбанкі» АҚ ЕБ	46 359 594,27	2,67%
«Цеснабанк» АҚ	37 385 256,91	2,15%
«Каспий Банк» АҚ	29 329 879,67	1,69%
«Нұрбанк» АҚ	26 673 636,39	1,53%
«Еуразиялық банк» АҚ	24 006 954,58	1,38%
«Банк ЦентрКредит» АҚ	20 010 663,16	1,15%
«DeltaBank» АҚ	18 608 309,06	1,07%
«Казкоммерцбанк» АҚ	12 887 488,80	0,74%
«Казкоммерцбанк» АҚ Eurobond	11 269 971,25	0,65%
«Темірбанк» АҚ	11 053 228,58	0,64%
«Банк «Bank RBK» АҚ	9 833 715,23	0,57%
«Қазақстан халық Жинақ банкі» АҚ Eurobond	9 338 326,06	0,54%
«AsiacreditBank» АҚ	8 888 821,74	0,51%
«АТФ банк» АҚ Eurobond	8 755 594,26	0,50%
«Қазақстан халық Жинақ банкі» АҚ	7 608 052,73	0,44%
«АТФ банк» АҚ	5 827 157,09	0,34%
«Альянс Банк» АҚ	1 881 700,29	0,11%
«БАНК ВТБ» АҚ ЕҰ	1 850 616,06	0,11%
«Эксимбанк» АҚ	975 518,47	0,06%
«Казинвестбанк» АҚ	642 031,85	0,04%
«Банк KASSA NOVA» АҚ	204 372,40	0,01%
«БТА Банк» АҚ	15 496,53	0,00%
«Банк ЦентрКредит» АҚ Eurobond	0,00	0,00%
Барлығы:	293 406 385,38	16,88%

5-кесте. 01.02.2014 жылғы жағдай бойынша БЖЗҚ портфеліндегі ҚР корпоративтік облигациялары

ҚР эмитенттерінің корпоративтік облигациялары		
Бағалы қағаздар түрі және оның эмитенттерінің атауы	Ағымдағы құны мың теңгемен	Барлығы зейнетақы активтерінің ағымдағы құнынан пайызбен
«Қазақстан ипотекалық компаниясы» АҚ	23 978 480,94	1,38%
«Қазмұнайгаз» АҚ	23 407 864,64	1,35%
«АПК Инвест» АҚ	16 728 535,91	0,96%
"САМРҰҚ ҚАЗЫНА» ҰӘҚ АҚ	15 507 500,31	0,89%
«Казэкспортастық» АҚ	13 496 685,28	0,78%
"Өндірістік келісім-шарт корпорациясы» ҰК» АҚ	11 096 607,69	0,64%
«ДТЖ» АҚ	10 674 175,81	0,61%

«Батыс транзит» АҚ	10 293 923,71	0,59%
«Қазақстан Инжиниринг» АҚ	7 804 773,48	0,45%
Eurobond «Қазақстан Даму банкі» АҚ	7 707 644,14	0,44%
«Цатек» АҚ	7 195 202,92	0,41%
«Қазақстан Қағазы» АҚ	6 238 609,42	0,36%
«СевКазЭнерго» АҚ	3 983 229,29	0,23%
«Болат Нұржанов атындағы Екібастұз ҚРЭС-1»	3 838 416,12	0,22%
«КазСтройСервис» АҚ	3 753 288,96	0,22%
"ПАВЛО ДАРЭНЕРГО" АҚ	3 552 384,40	0,20%
«БТА Ипотека» АҚ	3 195 091,28	0,18%
«INNOVA INVESTMENT» ЖШС	2 698 063,43	0,16%
«SAT & COMPANY» АҚ	2 651 694,52	0,15%
«АБДИ Компани» АҚ	1 587 497,35	0,09%
«AMF GROUP» АҚ	1 411 959,07	0,08%
«Аграрлық кредиттік корпорация» АҚ	1 078 818,57	0,06%
«БЕККЕР И К» ЖШС	836 453,65	0,05%
«CENTRAL ASIA CEMENT» АҚ	620 577,20	0,04%
«RG BRANDS» АҚ	553 123,31	0,03%
«ИМСТАЛЬКОН» АҚ	501 024,93	0,03%
«Самрұқ-Энерго» АҚ	471 675,99	0,03%
«Маңғыстау үлестіру электржелілік компания» АҚ	342 438,02	0,02%
«Астана-финанс» АҚ	270 957,39	0,02%
"НОМЕВРОКЕР" АҚ	241 734,93	0,01%
«Тема И Ко» АҚ	161 385,81	0,01%
«ЭКОТОН +» АҚ	51 041,64	0,00%
«Қарағанды асбестоцемент өнімдері зауыты» АҚ	8 144,90	0,00%
Жиыны :	185 939 005,03	10,70%

Шетелдік эмитенттердің корпоративтік облигациялары және PPN (құрылымдық ноттар)

«МұнайГаз-Дем» ЖЗҚ және «Астана» ЖЗҚ зейнетақы активтерін біріктіру нәтижесінде инвестициялық портфельдегі шетелдік эмитенттердің корпоративтік облигацияларының үлесі портфельдің 0,54% құрады. Портфельдегі құрылымдық ноттардың үлесі портфельдің 0,92% 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 6,02 % және сәйкесінше 3,18% құрады.

6-кесте. 01.02.2014 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		
COMMERZBANK AG	2 190 191,18	0,13%
MORGAN STANLEY	1 939 132,89	0,11%
JPMorganChaseBank	1 564 712,62	0,09%
UNICREDITBA AG	1 554 461,76	0,09%
RABOBANK NIDERLAND	883 887,86	0,05%
CATERPILLAR INC	402 070,86	0,02%
SAMARCO MINERACAO SA	276 074,05	0,02%
SOUTHERN COPPER CORP	194 334,18	0,01%

KFW	191 788,64	0,01%
ASTRAZENECA PLC	143 280,29	0,01%
IBM CORP	69 911,47	0,00%
Жиыны :	9 409 845,81	0,54%
Құрылымдық ноттар		
PPN MERRILL LYNCH/Bank of America Corp	16 040 598,70	0,92%
Жиыны :	16 040 598,70	0,92%

ҚР эмитенттерінің акциялары және депозитарлық қолхаттары

Есепті кезеңде БЖЗҚ портфеліндегі ҚР эмитенттері акцияларының және депозитарлық қолхаттардың үлесі портфелдің 3,40% -дан 3,17 %-ға дейін төмендеді. ҚР эмитенттері депозитарлық қолхаттары және акциялары үлесінің төмендеуі 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:

7-кесте. 01.02.2014 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	15 406 729,69	0,89%
«KCELL» АҚ	8 462 350,55	0,49%
«Цеснабанк» АҚ	7 073 945,84	0,41%
«Казтрансойл» АҚ	6 092 453,21	0,35%
«Қазақстан Халық Жинақ Банкі» АҚ	5 625 797,68	0,32%
«РД КазМунайГаз» АҚ	2 633 017,41	0,15%
«Нұрбанк» АҚ	2 385 975,18	0,14%
«Манғыстау үлестіру электр желілік компания» АҚ	1 768 155,51	0,10%
«Қазақтелеком» АҚ	1 314 441,85	0,08%
ЭКСИМБАНК АҚ жай акциялары	1 096 600,65	0,06%
«Mineral Resources of Central Asia» АҚ	1 002 585,17	0,06%
«БанкЦентрКредит» АҚ	750 314,75	0,04%
«Темірбанк» АҚ	488 707,65	0,03%
KAZAKHMYN PLC	365 315,66	0,02%
«Қазкоммерцбанк» АҚ	254 736,22	0,01%
«БТА банк» АҚ	112 053,71	0,01%
АТФ БАНК АҚ жай акциялары	108 152,68	0,01%
EURASIAN NATURAL RESOURCES CORPORATION PLC	95 696,96	0,01%
«Альянс Банк» АҚ	17 522,85	0,00%
Барлығы:	55 054 553,24	3,17%

Шетелдік эмитенттердің акциялары және депозитарлық қолхаттары

Есепті күнге БЖЗҚ зейнетақы активтерінің портфеліндегі шетелдік эмитенттердің акцияларының үлесі портфелдің 0,63% құрады.

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

«Астана» ЖЗҚ АҚ зейнетақы активтері құрамындағы CATERPILLAR INC, POSCO, CHINA MOBILE акциялары 324,69 млн. теңге мөлшерінде БЖЗҚ АҚ инвестициялық портфельінің құрамына ауыстырылған болатын.

Акцияларға инвестициялау ішінде мынадай компаниялар бар:

8-кесте. 01.02.2014 жылғы жағдай бойынша БЖЗҚ портфельіндегі 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	3 108 560,48	0,18%
ГАЗПРОМ АҚ	2 577 990,04	0,15%
DEUTSHE BANK AG	1 314 690,11	0,08%
"Банк ВТБ" ААҚ	1 022 470,20	0,06%
RIO TINTO PLC	928 877,62	0,05%
MCMORAN COPPER	916 952,40	0,05%
ORANGE	315 560,91	0,02%
ГМК "НОР.НИКЕЛЬ" ААҚ	289 766,67	0,02%
BARRICK GOLD CORP	201 060,78	0,01%
CHINA MOBILE ADR	127 110,52	0,01%
POSCO ADR	107 122,55	0,01%
CATERPILLAR INC	67 081,07	0,00%
VALE DE RIO DOCE SA	21 238,73	0,00%
Барлығы:	10 998 482,09	0,63%

Тазартылған қымбат металдар

Тазартылған қымбат металға инвестициялау алтынмен жүргізіледі. Инвестициялық портфельдегі алтын үлесі портфельден 4,53 %-дан біршама 4,44%-ға төмендеді. Есепті кезеңде тазартылған қымбат металды сату және сатып алу болған жоқ.

Есепті айдың басына алтын бағасы бір троя унциясына 1 232,25 АҚШ долларын құрады, мұндайда айдың аяғында алтын бағасы бір троя унциясына 1 246,50 АҚШ долларына дейін ұлғайды.

9-кесте. 01.02.2014 жылғы жағдай бойынша БЖЗҚ портфельіндегі тазартылған қымбат металл

Тазартылған қымбат металл		
Тазартылған алтын	ағымдағы құны мың теңгемен	Барлығы зейнетақы активтерінің ағымдағы құнынан пайызбен
Алтын	77 345 121,95	4,45%
Барлығы:	77 345 121,95	4,45%

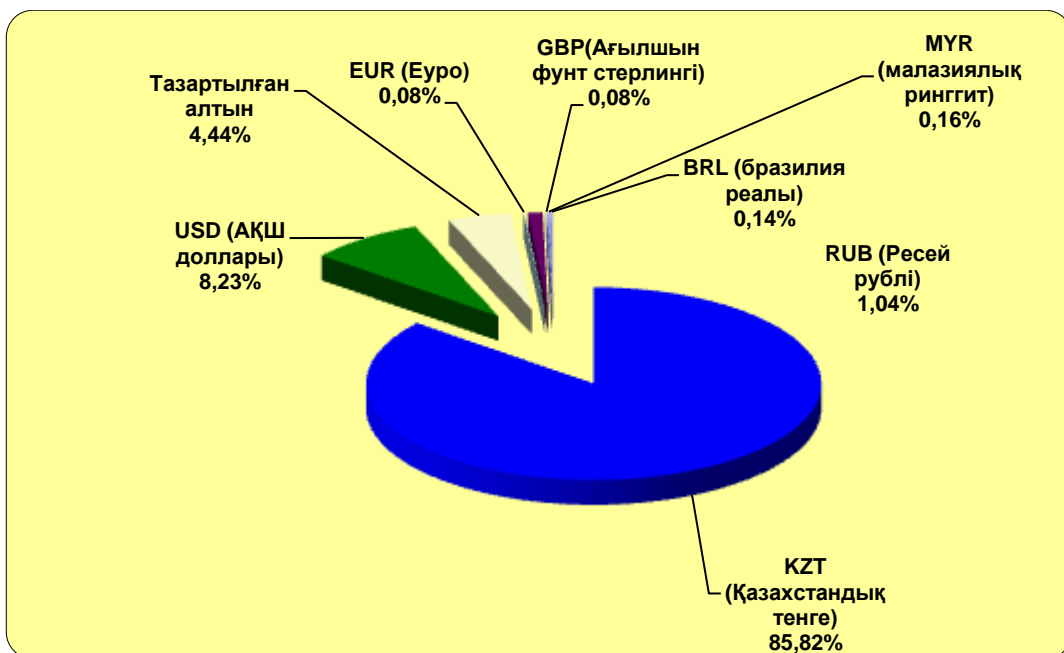
Валюталар бойынша құрылымдық үлестіру.

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

- ұлттық валюта – 85,82%;
- АҚШ доллары – 8,23%;
- Тазартылған алтын – 4,44%;
- Ресей рублі – 1,04%;
- малазия ринггиттері – 0,16%;
- еуро – 0,08%;
- ағылшын фунт стерлингi – 0,08%;

бразилия реалы – 0,14%.

1-сурет. 01.02.2014 жылғы жағдай бойынша валюта бөлігінде БЖЗҚ зейнетақы активтері портфелінің құрылымы



Инвестициялық қызметтің нәтижесі

2014 жылғы қаңтар айы үшін БЖЗҚ зейнетақы активтері бойынша есептелген инвестициялық табыс/шығын 11,03 млрд. теңгені құрады.

Инвестициялық табыс/шығынның құрылымы:

- ✓ Екінші деңгейдегі банктердегі салымдар бойынша инвестициялық табыс 813,93 млн. теңгені құрады.
- ✓ Бағалы қағаздар бойынша инвестициялық табыс 5,99 млрд. теңгені құрады.
- ✓ «Кері РЕПО» операциялары бойынша инвестициялық табыс 82,54 млн. теңгені құрады.
- ✓ Тазартылған қымбат металлдар (алтын) бойынша инвестициялық табыс 3,15 млрд. теңгені құрады.
- ✓ Валюталық қайтабағалаудан инвестициялық табыс 978,22 млн. теңгені құрады.

2014 жылғы қаңтар айы үшін БЖЗҚ шартты зейнетақы бірлігі өсімінің қарқыны 0,69% 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. 01.02.2014 жылғы жағдай бойынша инвестициялау нысандарының тізбесі мен лимиттері

Қаржы құралының түрі	Инвестициялау лимиттері	Үлесі
Борыштық құралдар	80% дейін	79,47%
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%	49,57%

Шетел мемлекеттерінің орталық үкіметімен шығарылған (берген) мемлекеттік мәртебесі бар бағалы қағаздар	35% аспайтын	1,33%
Қор биржасының ресми тізіміне енген Қазақстан Республикасының жергілікті атқарушы органдары шығарған облигациялар	10% аспайтын	0,31%
Қазақстан Республикасы эмитенттерінің мемлекеттік емес борыштық бағалы қағаздары, оның ішінде:	30% аспайтын	27,58%
1) Қазақстан Республикасы ұйымдарының ипотекалық облигациялары	15% аспайтын	1,33%
2) «Самрұқ-Қазына» ұлттық әл-ауқат қоры» акционерлік қоғамы шығарған борыштық бағалы қағаздар	10% аспайтын	0,89%
халықаралық және шетел ұйымдары шығарған борыштық бағалы қағаздар	35% аспайтын	1,48%
құрылымдық ноттар (principal protected notes)	5% аспайтын	0,92%
Үлесті құралдар	30% дейін	3,8%
Қазақстан Республикасының ұйымдары, шетел ұйымдары шығарған мемлекеттік емес үлесті бағалы қағаздар, оның ішінде	30% аспайтын	3,8%
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	3,17%
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	0,63%
Екінші деңгейдегі банктердегі салымдар	25% дейін	8,87%
Басқа құралдар	30% дейін	4,45%
Тазартылған қымбат металдар, оның ішінде метал депозиттері	10% дейін	4,45%
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%
Валюталық нетто-позиция	50% дейін	14,20%
АҚШ доллары, Еуро, Ағылшын фунт стерлингінде ашық валюталық позиция	50% аспайтын	12,85%
Басқа валюталар бойынша ашық валюталық позиция	15% аспайтын	1,35 %