

Структура инвестиционного портфеля на 01 октября 2011 года

Наименование эмитента	Рейтинг/ листинговые катег. KASE	Текущая стоимость (млн.тг)	Удельный вес
Государственные ценные бумаги:			
Министерство финансов РК	BBB	88 100	65,2%
Облигации эмитентов, имеющих рейтинговую оценку:			
Рабобанк (Нидерланды)	AAA	870	0,6%
АО ФНБ "Самрук-Казына"	BBB	5	0,004%
АО "АТФ Банк"	BBB	1 951	1,4%
ДО АО Банк ВТБ (Казахстан)	BBB-	540	0,4%
АО "НК "КазМунайГаз"	BBB-	1 626	1,2%
ДБ АО "Сбербанк России"	BBB-	210	0,2%
АО "АгрКредитКорп"	BB	335	0,2%
АО "Народный Банк Казахстана"	BB	3 646	2,7%
АО "НК "Продовольственная контрактная корпорация"	BB-	2 556	1,9%
АО "Банк ЦентрКредит"	BB-	3 183	2,4%
АО "ИО "Казахстанская Ипотечная Компания"	B+	4 918	3,6%
АО "Холдинг КАЗЭКСПОРТАСТЫК"	B	495	0,4%
АО "Евразийский банк"	B	3 830	2,8%
АО "Казкоммерцбанк"	B	871	0,6%
АО "Нурбанк"	B	1 154	0,9%
АО "Темірбанк"	B	288	0,2%
АО "Банк ТуранАлем"	B-	1 793	1,3%
АО "Цеснабанк"	B-	1 099	0,8%
Облигации эмитентов, без рейтинга:			
ТОО "Эжибастузская ГРЭС-1"	1 категор.	2 230	1,7%
АО "Павлодарэнергосервис"	1 категор.	12	0,01%
АО "БатысТранзит"	2 категор.	410	0,3%
АО "БТА Ипотека"	2 категор.	952	0,7%
АО "Досжан темир жолы"	буф.кат.	1 517	1,1%
АО "Астана-Финанс"	буф.кат.	286	0,2%
АО "КазахстанКагазы"	буф.кат.	272	0,2%
АО "РТ Холдинг"	буф.кат.	1	0,001%
АО "Vita"	буф.кат.	0	0,0%
Акции эмитентов, имеющих рейтинговую оценку не ниже:			
China Mobile (ADR)	AA	7	0,005%
Caterpillar inc.	A	7	0,005%
KT Corporation (ADR)	A	7	0,005%
Vale De Rio Doce (ADR)	BBB+	7	0,005%
АО "Газпром" (ГДР)	BBB	571	0,4%
АО "РД Казмунайгаз"	BBB-	1 134	0,8%
АО "Народный Банк Казахстана"	BB	109	0,1%
АО "Казакхтелеком"	BB	336	0,2%
АО "Банк ЦентрКредит"	BB-	498	0,4%
АО "Темірбанк"	B	100	0,1%
Депозиты в банках второго уровня Республики Казахстан, имеющих рейтинговую оценку не ниже:			
АО "Каспийский Банк"	B+	1 048	0,8%
Текущие операции РЕПО:			
РЕПО		0	0,0%
Государственные ценные бумаги иностранных государств, ценные бумаги международных финансовых организаций:			
Европейский Инвестиционный Банк	AAA	2 310	1,7%
Европейский Банк Реконструкции и Развития	AAA	533	0,4%
Суверенные еврооблигации РФ	BBB	1 305	1,0%
МФО "Евразийский Банк Развития"	BBB	2 128	1,6%
Деньги на инвестиционном счете		1 834	1,4%
Всего пенсионных активов		135 085	100%