

**Қазақстан Республикасының бағалы қағаздар нарығының
2010 жылғы 1 шілдедегі ағымдағы жағдайы**

Осы кездегі Қазақстан Республикасының бағалы қағаздар нарығының институционалды инфрақұрылымы мынадай үлгіде ұсынылады.

	1.07.09	1.10.09	1.01.10	1.04.10	1.07.10
Оның ішінде барлық брокерлер-дилерлер:	92	86	83	83	81
банктер	24	24	24	24	24
олардың I -санаттағысы	22	22	22	22	22
банктік емес ұйымдар	56	53	53	53	52
олардың I -санаттағысы	47	44	44	44	42
АӨҚО қатысушылары	12	9	6	6	5
Тіркеушілер	13	12	12	11	11
Кастодиандар	11	11	11	11	11
ЖЗҚ зейнетақы активтерін инвестициялық басқарушылар	14	14	14	14	16
Инвестициялық портфельді басқарушылар, оның ішінде:	60	54	49	49	49
инвестициялық компаниялар	4	3	2	2	2
ӨӨРУ	2	2	2	2	2
Трансфер-агенттер	3	3	3	3	3
Бағалы қағаздармен сауда-саттықты ұйымдастырушы	1	1	1	1	1

2010 жылғы екінші тоқсанда бағалы қағаздар нарығындағы қызметті жүзеге асыру құқығына 5 лицензия, оның ішінде: номиналды ұстаушы ретінде клиенттер шоттарын жүргізу құқығымен брокерлік және дилерлік қызметті жүзеге асыруға 1 лицензия ("FIVE BROKERS' CAPITAL" АҚ), инвестициялық портфельді басқаруға 1 лицензия ("FIVE BROKERS' CAPITAL" АҚ), номиналды ұстаушы ретінде клиенттер шоттарын жүргізу құқығынсыз брокерлік және дилерлік қызметті жүзеге асыруға 1 лицензия ("ГРАНТУМ" ЖЗҚ» АҚ ("Қазкоммербанк" АҚ ЕҰ), зейнетақы активтерін басқару жөніндегі қызметті жүзеге асыруға 2 лицензия ("ГРАНТУМ" ЖЗҚ» АҚ ("Қазкоммербанк" АҚ ЕҰ), "ҰларҮміт" ЖЗҚ» АҚ) берілді. Сонымен қатар есепті кезең ішінде 4 лицензияның, оның ішінде бағалы қағаздар нарығында номиналды ұстаушы ретінде клиенттер шоттарын жүргізу құқығымен брокерлік және (немесе) дилерлік қызметті жүзеге асыруға берілген 3 лицензияның («GLOTUR INVEST» АҚ, «Тор Инвест» АҚ, «The Royal Bank of Scotland Securities (Kazakhstan)» АҚ) және инвестициялық портфельді басқаруға берілген 1 лицензияның («Тор Инвест» АҚ) қолданылуы тоқтатылды. Сондай-ақ есепті кезеңде 1 ұйым ("Тенгри Финанс" АҚ) бағалы қағаздар нарығында номиналды ұстаушы ретінде клиенттер шоттарын жүргізу құқығымен брокерлік және дилерлік қызметті жүзеге асыруға берілген лицензиясынан айырылды.

(млн. теңге)

	1.04.10.	1.07.10.	2010 жылғы 2-тоқсандағы өзгеруі, %-бен
Жиынтық активтер, оның ішінде *:	160 111	150 703	-5,9
брокерлер-дилерлер	5 449	4 603	-15,5
брокерлер-дилерлер (АӨҚО қатысушылары)	876	935	6,7
тіркеушілер	1 124	1 213	7,9
ИПБ	106 419	100 130	-5,9
инвестициялық компаниялар	35 852	35 799	-0,15
ЗАИБЖАҰ	10 391	8 023	-22,8
Міндеттемелер, оның ішінде:	34 859	30 336	-13
брокерлер-дилерлер	1 055	571	-45,9

* ЕДБ қоспағанда қаржылық көрсеткіштер бойынша ақпарат

* Информация по финансовым показателям, без учета БВУ

брокерлер-дилерлер (АӨҚО қатысушылары)	29	22	-24,1
тіркеушілер	38	47	23,7
ИПБ	23 828	18 003	-24,4
инвестициялық компаниялар	8 584	9 574	11,53
ЗАИБЖАҰ	1 325	2 119	59,9
Капитал, оның ішінде:	125 252	120 367	-3,9
брокерлер-дилерлер	4 394	4 032	-8,2
брокерлер-дилерлер (АӨҚО қатысушылары)	847	913	7,8
тіркеушілер	1 086	1 166	7,4
ИПБ	82 591	82 127	-0,6
инвестициялық компаниялар	27 268	26 225	-3,82
ЗАИБЖАҰ	9 066	5 904	-34,9
Жарғылық капитал, оның ішінде:	112 138	114 245	1,9
брокерлер-дилерлер	2 668	2 547	-4,5
брокерлер-дилерлер (АӨҚО қатысушылары)	948	1 057	11,5
Тіркеушілер	1 116	1 182	5,9
ИПБ	77 115	79 168	2,7
инвестициялық компаниялар	20 916	20 916	-
ЗАИБЖАҰ	9 375	9 375	-

Эмитенттер және қаржы құралдары

Акциялар шығарылымы

Акциялар шығарылымы және шығарылымдарды жою туралы деректер

	2009 жылғы 2-тоқсанда	2009 жылғы 3-тоқсанда	2009 жылғы 4-тоқсанда	2010 жылғы 1-тоқсанда	2010 жылғы 2-тоқсанда
Шығарылымдар тіркелді	19	14	16	10	7
Шығарылым және орналастыру қорытындысы туралы есептер бекітілді	160	180	180	178	144
Шығарылымдар жойылды	22	46	32	15	21

Есепті күнде қолданыстағы акциялар шығарылымының жалпы саны 2 177 құрады. 2010 жылғы екінші тоқсанда 183 акциялар шығарылымы (оның ішінде шығарылымдар проспектілеріне енгізілген өзгерістер) тіркелді, акциялардың шығарылымы және орналастыру қорытындысы туралы 144 есеп бекітілді, сондай-ақ 21 акциялар шығарылымы жойылды.

Тіркелген мемлекеттік емес облигациялар шығарылымы туралы деректер

	2009 жылғы 2-тоқсанда за 2 квартал 2009 года	2009 жылғы 3-тоқсанда за 3 квартал 2009 года	2009 жылғы 4-тоқсанда за 4 квартал 2009 год	2010 жылғы 1-тоқсанда за 1 квартал 2010 год	2010 жылғы 2-тоқсанда за 2 квартал 2010 год
Шығарылымдар саны	10	11	13	6	5
Шығарылымдар көлемі, млн. теңгемен	37 100	874 583	296 400	92 000	317 850

Агенттік 2010 жылғы екінші тоқсан ішінде жалпы көлемі 317 850 млн. теңгемен мемлекеттік емес облигациялардың 5 шығарылымын тіркеді.

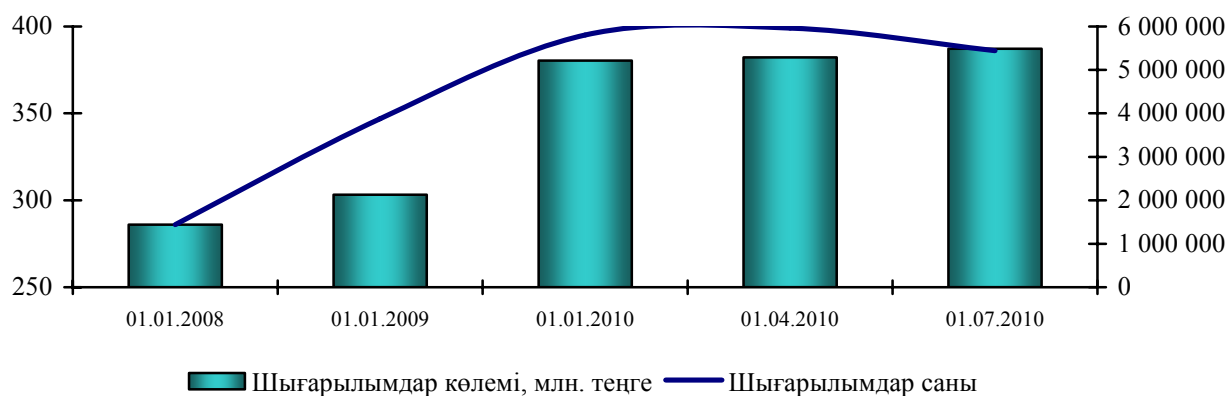
Мемлекеттік емес облигациялардың қолданыстағы

шығарылымы туралы деректер

	2009 жылғы 1 шілдеде	2009 жылғы 1 қазанда	2010 жылғы 1 қаңтарда	2010 жылғы 1 сәуірде	2010 жылғы 1 шілдеде
Шығарылымдар саны	383	387	395	399	386
Шығарылымдар көлемі, млн. теңгемен	4 097 185	4 935 108	5 216 267	5 289 461	5 488 811

2010 жылғы 1 шілдедегі жағдай бойынша жиынтық номиналды құны 5 488 811 млн. теңгені құрайтын қолданыстағы облигациялар шығарылымының саны 386 болды, олардың ішінде рейтингтік бағасы бар 55 шығарылымы, 118 шығарылымы – бірінші шағын санаттың рейтингтік бағасы жоқ, 38 шығарылымы – екінші шағын санаттың рейтингтік бағасы жоқ және 65 шығарылымы – буферлік санатты KASE ресми тізіміне енгізілген.

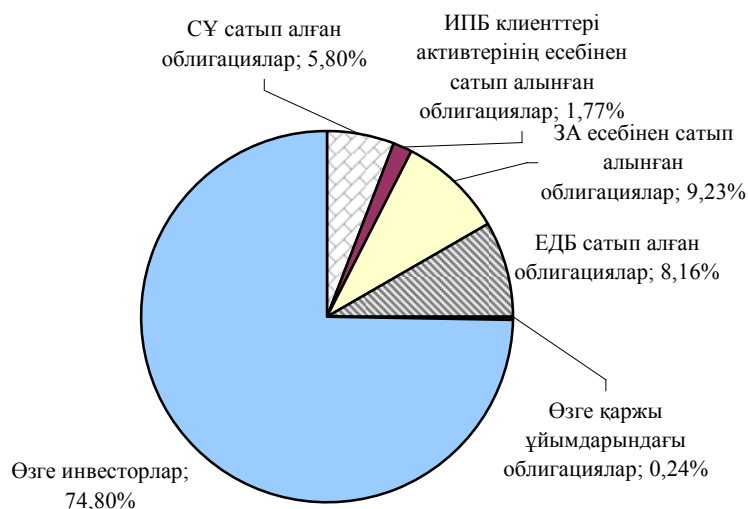
Қолданыстағы облигациялар шығарылымдарының саны мен көлемінің өзгеру динамикасы



2010 жылғы 1 шілдедегі жағдай бойынша корпоративті облигациялардың қолданыстағы шығарылымдарының жиынтық көлемі былайша көрініс алады:

- зейнетақы активтері есебінен сатып алынған облигациялар – 9,23%;
- екінші деңгейдегі банктер сатып алған облигациялар – 8,16%;
- инвестициялық портфельді басқарушы клиенттердің активтері есебінен сатып алынған облигациялар – 1,77%;
- сақтандыру (қайта сақтандыру) ұйымдары сатып алған облигациялар – 5,80%;
- өзге қаржы ұйымдары сатып алған облигациялар – 0,24%;
- өзге инвесторлар – 74,80%.

1.07.2010 ҚР корпоративті облигацияларының қолданыстағы шығарылымдарының жиынтық көлеміндегі инвесторлармен сатып алынған облигациялар үлесі



ҚР корпоративтік облигацияларының қолданыстағы шығарылымдарының жиынтық көлеміндегі 74,8%-ы кәсіби емес инвесторлардың үлесіне тиеді.

Институционалды инвесторлар–облигацияларды ұстаушылардың (ИПБ клиенттерінің активтері және ЗА) Қазақстан Республикасының аумағында шығарылған облигациялардың жалпы көлеміндегі үлес салмағы 11,0% болды.

Тіркелген пайлар шығарылымдары туралы деректер

	2009 жылғы 2-тоқсанда	2009 жылғы 3-тоқсанда	2009 жылғы 4-тоқсанда	2010 жылғы 1-тоқсанда	2010 жылғы 2-тоқсанда
Шығарылымдар тіркелді	7	3	16	4	0
Шығарылым және орналастыру қорытындысы туралы есептер бекітілді	35	42	43	32	32
Қолданыстағы шығарылымдар	186	176	182	181	171

2010 жылғы 1 шілдеде қолданыстағы пайлар шығарылымының саны 181 болды. Бұл ретте 2010 жылғы сәуір-маусым айларында шығарылым мен орналастыру қорытындылары туралы 32 есеп бекітілді және 10 шығарылым өтелді.

Қазақстан Республикасының аумағында айналыста болатын мемлекеттік бағалы қағаздар*

	2009 жылғы 1 шілдеде	2009 жылғы 1 қазанда	2010 жылғы 1 қаңтарда	2010 жылғы 1 сәуірде	(млн. теңге) 2010 жылғы 1 шілдеде
Айналыста барлығы, оның ішінде:	1 104 276	1 299 549	1 761 527	2 336 020	2 488 709
Ұлттық Банктің ноттары	145 013	180 213	473 292	963 346	990 258
Қаржы министрлігінің бағалы қағаздары	959 263	1 119 336	1 288 235	1 372 674	1 498 451
Жергілікті атқарушы органдарының бағалы қағаздары

Бағалы қағаздардың биржалық нарығының негізгі көрсеткіштері**

Қазақстандағы қор нарығының жай-күйінің негізгі индикаторы болып, бұрынғыша – KASE қор биржасы ұсынған ұйымдасқан нарығы болып табылады.

Основным индикатором состояния фондового рынка в Казахстане является организованный рынок, представленный фондовой биржей – KASE.

Ағымдағы жылғы 1 шілдеде бағалы қағаздары KASE сауда-саттығына жіберілген қазақстандық эмитенттер туралы ақпарат мынадай түрде көрінеді.

На 1 июля текущего года информация о казахстанских эмитентах, ценные бумаги которых допущены к торгам на KASE, выглядит следующим образом.

KASE сауда-саттығына жіберілген бағалы қағаздар

	шығарылым саны	эмитенттер саны
"Акциялар" секторы:	97	71
"Борыштық бағалы қағаздар" секторы:	276	82
"Инвестициялық қорлардың бағалы қағаздары" секторы:	2	2
"Депозитарлық қолхаттар" секторы:	0	0
"Халықаралық қаржы ұйымдарының бағалы қағаздары" секторы:	1	1
"Мемлекеттік бағалы қағаздар" секторы:	157	2
"Туынды бағалы қағаздар" секторы:	0	0
"Баламалы алаң"	0	0
Жиынтығы:	533	122

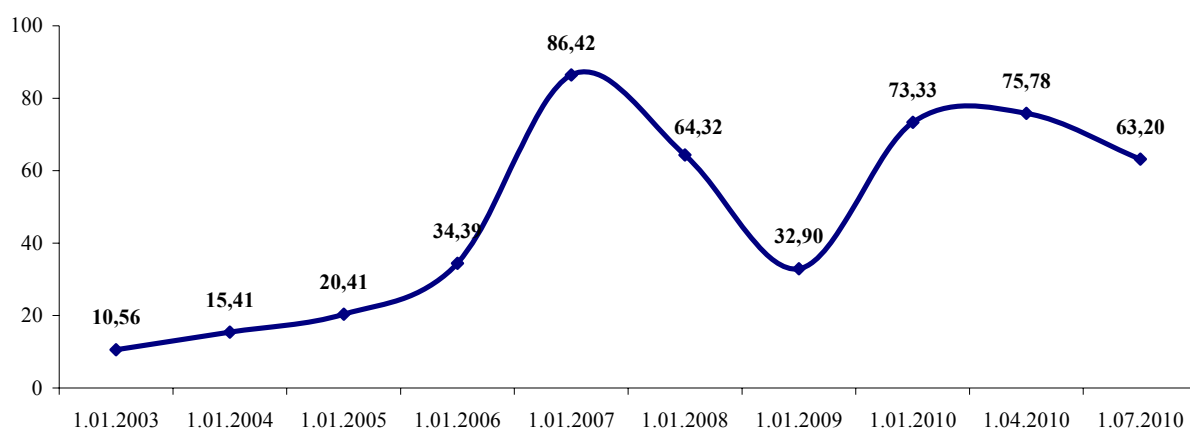
* Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкінің деректері бойынша ұсынылған ақпарат

** Биржа нарығы жөніндегі ақпарат KASE деректері бойынша ұсынылған

KASE айналымын жіберілген бағалы қағаздардың негізгі үлес салмағы борыштық бағалы қағаздарға – 51,8% (276 шығарылым) келеді. Акциялар және мемлекеттік бағалы қағаздары секторы бойынша 18,2% (97 шығарылым) және тиісінше 29,4% (157 шығарылым) болып келеді. Инвестициялық қорлардың бағалы қағаздарының үлесі 0,4%-ды (2 шығарылым) құрайды. Халықаралық қаржы ұйымдарының бағалы қағаздарының үлесіне 0,2% (1 шығарылым) келеді.

KASE жалпы капиталдандыру 11 081 475 млн. теңгені немесе ЖІӨ-ден 63,2% құрады. 2010 жылғы 1 сәуірдегі жағдай бойынша осындай көрсеткіш 13 288 278 млн. теңгені немесе ЖІӨ-ден 75,8% құрады. Осылайша, қор нарығын капиталдандырудың абсолюттік көріністегі көбеюі де, сондай ЖІӨ-ге қатысты қор нарығын капиталдандыру көрсеткішінің көбеюі де байқалады.

ЖІӨ-ге KASE-нің капиталдандырылуы *



* Экономика және бюджеттік жоспарлау министрлігінің ресми сайтынан алынған деректер (15 986,5 млрд. теңге)

KASE-дегі мемлекеттік емес бағалы қағаздармен жасалған мәмілелер көлемі

(млн. тенге)

	2009 жылғы 3-тоқсанда	2009 жылғы 4-тоқсанда	2010 жылғы 1-тоқсанда	2010 жылғы 2-тоқсанда
бастапқы орналастыру:	827	415 597	5 450	1 885
– "Акциялар" секторы бойынша	0	414 304	4 569	1 885
– "Борыштық бағалы қағаздар" секторы бойынша	827	1 293	881	0
– "Инвестициялық қорлардың бағалы қағаздары" секторы бойынша	0	0	0	0
– "Депозитарлық қолхаттар" секторы бойынша	0	0	0	0
– "Халықаралық қаржы ұйымдарының бағалы қағаздары" секторы бойынша	0	0	0	0
– "Туынды бағалы қағаздар" секторы бойынша	0	0	0	0
қосалқы айналыс:	121 596	115 964	49 958	66 212
– "Акциялар" секторы бойынша	46 515	33 659	6 525	19 634
– "Борыштық бағалы қағаздар" секторы бойынша	75 064	82 304	43 284	46 517
– "Инвестициялық қорлардың бағалы қағаздары" секторы бойынша	17	1	0	41
– "Депозитарлық қолхаттар" секторы бойынша	0	0	0	0
– "Халықаралық қаржы ұйымдарының бағалы қағаздары" секторы бойынша	0	0	149	20

– "Туынды бағалы қағаздар" секторы бойынша	0	0	0	0
"Листингтік емес бағалы қағаздар" секторы	42	183	47	82
"репо" мәмілелері	414 023	174 957	69 581	66 250
– "Акциялар" секторы бойынша	119 174	55 387	38 963	35 571
– "Борыштық бағалы қағаздар" секторы бойынша	294 438	119 288	30 618	30 679
– "Инвестициялық қорлардың бағалы қағаздары" секторы бойынша	194	0	0	0
– "Депозитарлық қолхаттар" секторы бойынша	0	0	0	0
– "Халықаралық қаржы ұйымдарының бағалы қағаздары" секторы бойынша	0	0	0	0
– "Туынды бағалы қағаздар" секторы бойынша	0	0	0	0
– "Листингтік емес бағалы қағаздар" секторы	217	282	0	0
Жиынтығы:	536 488	706 701	125 036	134 429

Кестеде келтірілген деректерден көрініп отырғандай, 2010 жылдың екінші тоқсанында мемлекеттік емес бағалы қағаздармен жасалған мәмілелер көлемі 7,5%-ға ұлғайды.

KASE-дегі мемлекеттік бағалы қағаздармен жасалған мәмілелер көлемі

(млн. теңге)

	2009 жылғы 2-тоқсанда	2009 жылғы 3-тоқсанда	2009 жылғы 4-тоқсанда	2010 жылғы 1-тоқсанда	2010 жылғы 2-тоқсанда
Мәмілелер көлемі, оның ішінде:	4 403 865	4 869 825	4 381 842	6 318 550	7 151 154
бастапқы орналастырулар	164 460	212 705	220 697	156 580	177 759
"репо" мәмілелері	4 072 546	4 410 550	3 947 068	5 909 085	6 804 339

Ағымдағы жылдың 2-тоқсанында ұйымдасқан нарықтағы мемлекеттік бағалы қағаздар бойынша жасалған биржалық мәмілелер көлемі 13,2%-ға ұлғайды. Бастапқы орналастырулар көлемі 13,5-ға ұлғайды. Мемлекеттік бағалы қағаздармен жасалған мәмілелердің жалпы көлеміндегі "репо" мәмілесінің үлесі 15,2%-ға ұлғайды.

KASE капиталдандырылуының өзгеру динамикасының

(млн. теңге)

Ресми тізім секторы	2009 жылғы 1 шілдеде	2009 жылғы 1 қазанда	2010 жылғы 1 қаңтарда	2010 жылғы 1 сәуірде	2010 жылғы 1 шілдеде
"Акциялар" секторы:	6 000 153	7 722 635	8 506 238	9 303 430	7 323 426
"Борыштық бағалы қағаздар" секторы	1 751 705	1 852 884	3 141 659	3 981 867	3 756 270
"Инвестициялық қорлардың бағалы қағаздары" секторы	3 864	2 981	2 981	2 981	1 779
"Депозитарлық қолхаттар" секторы	0	0	0	0	0
"Халықаралық қаржы ұйымдарының бағалы қағаздары" секторы	0	0	0	0	0
"Мемлекеттік бағалы қағаздар" секторы	0	0	0	0	0
"Туынды бағалы қағаздар" секторы	0	0	0	0	0
Жиынтығы	7 755 722	9 578 500	11 650 878	13 288 278	11 081 475

Кестеде келтірілген деректерден көрініп отырғандай, KASE ресми тізіміне кіргізілген мемлекеттік емес бағалы қағаздар бойынша нарықты жалпы капиталдандыру

2010 жылғы 1 шілдедегі жағдай бойынша 2010 жылғы 1 сәуірдегі көрсеткішпен салыстарғанда 16,6%-ға азайды.

Бағалы қағаздар нарығындағы инвесторлар Инвестициялық басқарудағы зейнетақы активтері

2010 жылғы 1 шілдедегі жағдай бойынша ЗАИБЖАҰ-ның инвестициялық басқаруындағы зейнетақы активтерінің жиынтық көлемі 2010 жылдың екінші тоқсанында 59,7 млрд. теңгеге немесе 3,0%-ға өсіп, 2 018,5 млрд. теңге болды.

Зейнетақы активтерінің орташа айлық өсімі 2009 жылғы 1 шілдеден бастап 2010 жылғы 1 шілдеге дейінгі кезеңде 31,4 млрд. теңге болды.

Зейнетақы активтерінің жиынтық көлемін бөлу

ЗАИБЖАҰ / ЖЗҚ	зейнетақы активтері	
	млн. теңге	%-бен
«Қазақстан Халық Банкі» АҚ еншілес ұйымы «Қазақстан Республикасы Халық Банкінің жинақтаушы зейнетақы қоры» АҚ	625 063	30,97
"Жетісу" ЗАИБЖАҰ" АҚ	339 742	16,83
"ҰларҮміт "Жинақтаушы зейнетақы қоры" АҚ	294 329	14,58
"АМАНАТ ҚАЗАҚСТАН жинақтаушы зейнетақы қоры " АҚ	45 413	2,25
"ГНПФ" Жинақтаушы зейнетақы қоры" АҚ	325 950	16,15
«БТА Банкі» АҚ-ның еншілес ұйымы «БТА Қазақстан Жинақтаушы Зейнетақы Қоры» АҚ	175 711	8,71
"GRANTUM Asset Management" ЗАИБЖАҰ" АҚ («Казкоммерцбанк» АҚ еншілес ұйымы АҚ)»	127 981	6,34
" ГРАНТУМ Жинақтаушы зейнетақы қоры" АҚ («Казкоммерцбанк» АҚ еншілес ұйымы АҚ)	127 981	6,34
«Банк ЦентрКредит» АҚ еншілес ұйымы» - «Капитал» ЖЗҚ» АҚ	94 288	4,67
"Мұнайгаз - Дем" жинақтаушы зейнетақы қоры" АҚ	68 366	3,39
«Еуразиялық жинақтаушы зейнетақы қоры» АҚ "	67 514	3,34
"Нұр-Траст" ЗАИБЖАҰ" АҚ, "Нұрбанк" АҚ еншілес ұйымы	61 240	3,03
"Нұрбанк" АҚ еншілес ұйымы "Атамекен" жинақтаушы зейнетақы қоры" АҚ	61 240	3,03
"Отан" ашық жинақтаушы зейнетақы қоры" АҚ («АТФ Банк» АҚ ЕҰ	57 497	2,85
"РЕСПУБЛИКА жинақтаушы зейнетақы қоры" АҚ	52 088	2,58
"Қазақмыс жинақтаушы зейнетақы қоры" АҚ	23 083	1,14
Барлық ЖЗҚ бойынша жиынтығы	2 018 523	100

2010 жылдың екінші тоқсанында инвестицияланған зейнетақы активтерінің көлемі 52,0 млрд. теңгеге немесе 2,7%-ға өсіп, 2010 жылғы 1 шілдеде 1 981,2 млрд. теңге болды.

Жинақтаушы зейнетақы қорларының инвестициялық портфеліндегі ҚР эмитенттерінің мемлекеттік бағалы қағаздарының үлесі инвестицияланған зейнетақы активтерінің жалпы көлемінен (855,5 млрд. теңге) 43,2%-ды құрайды және 2010 жылғы 1 сәуірдегі жағдай бойынша осындай көрсеткішке қатысты 1,3%-ға немесе 11,3 млрд. теңгеге өсті. Мемлекеттік емес бағалы қағаздардың үлесі 2010 жылғы 1 шілдедегі жағдай бойынша инвестицияланған зейнетақы активтерінің жалпы көлемінен (664,4 млрд. теңге) 33,5%-ды құрады.

ЖЗҚ-ның жиынтық инвестициялық портфелі

Қаржы құралдары	1.04.2010.		1.07.2010.	
	млн. теңге	%	млн. теңге	%
ҚР мемлекеттік бағалы қағаздары, оның ішінде	844 176	43,76	855 544	43,18
ҚР еурооблигациялары	0	0	0	0
Қаржы министрлігінің бағалы қағаздары	708 483	36,73	742 087	37,45

Ұлттық Банктің ноттары	135 693	7,03	113 457	5,73
Шетелдік эмитенттердің мемлекеттік емес бағалы қағаздары	209 169	10,84	196 048	9,90
акциялар	51 349	2,66	40 626	2,05
облигациялар	157 820	8,18	155 422	7,85
Шетелдік инвестициялық қорлардың пайлары	0	0		
Халықаралық қаржы ұйымдарының бағалы қағаздары	38 354	1,99	40 807	2,06
Шетелдік эмитенттердің мемлекеттік бағалы қағаздары	3 085	0,16	78 127	3,94
Тазартылған алтын	14 494	0,75	16 445	0,83
ҚР эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздары, оның ішінде	699 973	36,28	664 385	33,53
акциялар	196 463	10,18	179 497	9,06
облигациялар оның ішінде:	503 510	26,10	484 888	24,47
шетелдік валютада номинирленген	22 082	1,15	26 034	1,31
теңгемен номинирленген	481 429	24,95	458 854	23,16
Екінші деңгейдегі банктердегі салымдар	120 084	6,23	130 521	6,59
Туынды бағалы қағаздар	-119	-0,01	-666	-0,03
Жиынтығы	1 929 216	100	1 981 211	100

Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банктеріндегі салымдар көлемі 2010 жылғы екінші тоқсанда 8,7%-ға ұлғайып, 130,5 млрд. теңге болды.

ҚР эмитенттері техникалық дефолтқа жол берген, жинақтаушы зейнетақы қорларының инвестициялық портфеліндегі мемлекеттік емес борыштық бағалы қағаздардың үлесі 2010 жылғы 1 шілдеде зейнетақы активтерінің жалпы көлемінің 4,2%-ын құрады, бұл абсолютті мән бойынша 85,1 млрд. теңге болды.

2010 жылғы 1 шілдедегі меншікті активтер есебінен сатып алынған ЖЗҚ-ның жиынтық инвестициялық портфелі

Қаржы құралдары	млн. теңге	жиынтыққа, %-бен
ҚР мемлекеттік бағалы қағаздары, оның ішінде:	41 402	59,71
ҚР еурооблигациялары	0	0
Қаржы министрлігінің бағалы қағаздары	36 295	52,34
Ұлттық Банктің ноттары	5 107	7,37
жергілікті атқарушы органдардың бағалы қағаздары	0	0
Екінші деңгейдегі банктердегі салымдар	14 028	20,23
Халықаралық қаржы ұйымдарының бағалы қағаздары	0	0
Шетелдік эмитенттердің мемлекеттік бағалы қағаздары	1 047	1,51
Шетелдік инвестициялық қорлардың пайлары	0	0
ҚР эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздары, оның ішінде:	9 434	13,61
акциялар	1 828	2,64
облигациялар	7 606	10,97
Шетелдік эмитенттердің мемлекеттік емес бағалы қағаздары, оның ішінде:	2 228	3,21
акциялар	1 111	1,60
облигациялар	1 117	1,61
"Кері РЕПО" операциялары	1 200	1,73
Жиынтығы:	69 339	100

2010 жылғы 1 шілдеде жинақтаушы зейнетақы қорларының жиынтық меншікті портфеліндегі ең көп көлемді ҚР мемлекеттік емес бағалы қағаздары алады – 41 402 млн. теңге (59,71%). Бұл ретте меншікті активтер портфелінің 20,23%-ы екінші деңгейдегі

банктердің салымдарына орналастырылған. ҚР эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздарының үлесі 13,61% құрады.

Инвестициялық қорлардың саны

	1.07.2009	1.10.2009	1.01.2010	1.04.2010	1.07.2010
Инвестициялық пай қорларының саны, оның ішінде:	186	176	182	181	171
ашық	18	17	16	16	15
жабық	143	136	143	140	131
аралық	25	23	23	25	25
Акционерлік инвестициялық қорлардың саны	45	42	41	39	35

Инвестициялық пай қорлары пайшыларының саны

	1.07.2010
Инвестициялық пай қорлары пайшыларының саны, оның ішінде:	2 406
Заңды тұлғалар	86
Жеке тұлғалар	2 320

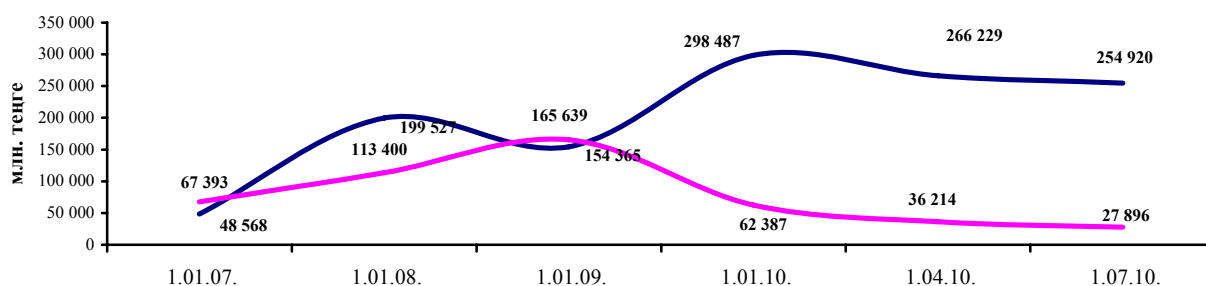
2010 жылғы 1 шілдедегі инвестициялық қорлар активтері

2010 жылғы 1 шілдедегі жағдай бойынша инвестициялық пай қорының және акционерлік инвестициялық қорлардың жиынтық активтері 254 920 млн. теңге және сәйкесінше 27 896 млн. теңге болды. 2010 жылғы 2-тоқсанда инвестициялық пай қорларының активтері 4,2%-ға азайды, акционерлік инвестициялық қорлардың активтері 23,0%-ға азайды.

(млн. теңге)

	2009 жылғы 1 шілдеде	2009 жылғы 1 қазанда	2010 жылғы 1 қаңтарда	2010 жылғы 1 сәуірде	2010 жылғы 1 шілдеде
Инвестициялық пай қорлары	299 444	305 601	298 488	266 229	254 920
ашық	296 939	302 691	295 616	263 201	252 316
жабық	613	680	832	865	816
аралық	1 892	2 230	2040	2 163	1 788
Акционерлік инвестициялық қорлар	104 285	59 090	62 387	36 214	27 896

Инвестициялық қорлар активтерінің өзгеру динамикасы



**2010 жылғы 1 шілдедегі инвестициялық қорлардың
жиынтық инвестициялық портфелі**

(млн. теңге)

Қаржы құралдары	Инвестициялық пай қорлары		Акционерлік инвестициялық қорлар	
	млн. теңге	жиынтығы на, %-бен	млн. теңге	жиынтығына, %-бен
ҚР мемлекеттік бағалы қағаздары, оның ішінде:	453	0,18	8	0,03
ҚР еурооблигациялары	0	0	0	0
Қаржы министрлігінің бағалы қағаздары	453	0,18	8	0,03
Ұлттық Банктің ноттары	0	0	0	0
жергілікті атқарушы органдардың бағалы қағаздары	0	0	0	0
Екінші деңгейдегі банктердегі салымдар	26 380	10,35	770	2,76
Халықаралық қаржы ұйымдарының бағалы қағаздары	0	0	0	0
Шетелдік эмитенттердің мемлекеттік бағалы қағаздары	0	0	0	0
Тазартылған алтын	0	0	0	0
ҚР эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздары, оның ішінде:	14 781	5,80	2 873	10,30
акциялар	7 381	2,90	347	1,24
облигациялар	7 400	2,90	2 526	9,05
Шетелдік эмитенттердің мемлекеттік емес бағалы қағаздары, оның ішінде:	5 010	1,97	437	1,56
акциялар	1 910	0,75	224	0,80
облигациялар	3 100	1,22	213	0,76
Инвестициялық қорлардың пайлары	684	0,27	154	0,55
Депозитарлық қолхаттар	525	0,21	68	0,24
"Кері РЕПО" операциясы	1 201	0,47	2	0,01
Жер учаскелері	6 738	2,64	1 616	5,79
Үйлер мен ғимараттар	11 712	4,59	12 597	45,16
Жылжымайтын мүліктің салынып жатқан және қайта құрастырылып жатқан объектілері	5 873	2,30	6 111	21,91
Жобалық-сметалық құжаттама	0	0	0	0
Жерді пайдалану және жер қойнауын пайдалану құқықтары	0	0	0	0
Акционерлік қоғам болып табылмайтын заңды тұлғалардың капиталындағы инвестициялық қордың инвестициялары	172 593	67,70	890	3,19
Туынды қаржылық құралдар	1 501	0,59	0	0
Өзге активтер/ дебиторлық берешек	7 469	2,93	2 370	8,50
Жиынтығы:	254 920	100	27 896	100

Инвестициялық пай қорларының жиынтық инвестициялық портфеліндегі негізгі үлесті үлесі акционерлік қоғам болып табылмайтын заңды тұлғалар капиталына инвестициялар иеленеді, олардың үлесіне 172 593 млн. теңге немесе 67,7% тиеді.

Ал акционерлік инвестициялық қорлар портфелінің көп бөлігі (72,9%) өзге мүліктің (жер учаскелері, үйлер мен ғимараттар, жылжымайтын мүліктің салынып жатқан және қайта құрастырылып жатқан объектілері) үлесіне тиеді.

ҚР эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздары инвестициялық пай қорларының инвестициялық портфелінде 5,8%, акционерлік инвестициялық қорлар портфелінде – 10,3%-ды иеленіп отыр. Шетел эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздарының ИПҚ-ның жиынтық портфеліндегі үлесі қомақты емес – 2,0% болса, АИҚ-ның портфелінде - 1,6% болды.

2010 жылғы 1 шілдедегі екінші деңгейдегі банктердің инвестициялық портфелінің құрылымы

Қаржы құралдары	млн. теңге	жиынтығында %-бен
ҚР мемлекеттік бағалы қағаздары, оның ішінде:	1 164 172	51,1
ҚР Ұлттық Банктің ноттары	778 816	34,2
ҚР Қаржы министрлігінің бағалы қағаздары	385 356	16,9
Халықаралық қаржы ұйымдарының бағалы қағаздары	42 832	1,9
Шет мемлекеттердің бағалы қағаздары	37 648	1,7
ҚР эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздары, оның ішінде:	935 997	41,0
акциялар	35 203	1,5
облигациялар	900 794	39,5
Шетелдік эмитенттердің мемлекеттік емес бағалы қағаздары, оның ішінде:	97 507	4,3
акциялар	900	0,1
облигациялар	96 607	4,2
Жиынтығы:	2 278 156	100

ЕДБ портфелінің қомақты үлесін ҚР мемлекеттік бағалы қағаздары құрайды – 51,1% немесе 1 164 172 млн. теңге. ҚР эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздарының үлесіне 41%-ы келеді. Шетел эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздары жиынтық портфельдің 4,3%-ын, шет мемлекеттердің бағалы қағаздары – 1,7%-ын құрайды.

2010 жылғы 1 шілдедегі сақтандыру ұйымдарының инвестициялық портфелінің құрылымы

Қаржы құралдары	млн. теңге	жиынтығында %-бен
ҚР мемлекеттік бағалы қағаздары, оның ішінде:	41 753	19,49
- ҚР еурооблигациялары	0	0,00
- Қаржы министрлігінің бағалы қағаздары	36 733	17,15
- Ұлттық Банктің ноттары	5 020	2,34
- жергілікті атқарушы органдарының бағалы қағаздары	0	0
Екінші деңгейдегі банктердегі салымдар	75 003	35,01
Халықаралық қаржы ұйымдарының бағалы қағаздары	1 992	0,93
Инвестициялық қорлардың пайлары	150	0,07
Шет мемлекеттердің бағалы қағаздары	5 295	2,47
ҚР эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздары, оның ішінде:	68 505	31,97
- акциялар	6 945	3,24
- облигациялар	61 560	28,73
Шетелдік эмитенттердің мемлекеттік емес бағалы қағаздары, оның ішінде:	12 880	6,01
- акциялар	2 567	1,20
- облигациялар	10 313	4,81
"Кері РЕПО" операциялары	8 684	4,05
Жиынтығы:	214 262	100,00

Есепті күнге сақтандыру ұйымдарының жиынтық инвестициялық портфелінің көлемі 214 262 млн. теңге болды. Бұл ретте екінші деңгейдегі банктердегі салымдарға - 35,01%, ҚР эмитенттерінің корпоративті бағалы қағаздарына – 31,97%, Қазақстан Республикасының мемлекеттік бағалы қағаздарының үлесіне 19,49%-дан келеді.

2010 жылғы 1 шілдедегі бағалы қағаздар нарығы кәсіби қатысушыларының инвестициялық портфелінің құрылымы

Қаржы құралдары	млн. теңге	жиынтығында %-бен
ҚР мемлекеттік бағалы қағаздары, оның ішінде:	5 988	15,7
ҚР еурооблигациялары	0	0
Қаржы министрлігінің бағалы қағаздары	5 173	13,6
Ұлттық Банктің ноттары	815	2,1
жергілікті атқарушы органдарының бағалы қағаздары	0	0,0
Екінші деңгейдегі банктердегі салымдар	1 731	4,5
Халықаралық қаржы ұйымдарының бағалы қағаздары	218	0,6
Шетелдік эмитенттердің мемлекеттік бағалы қағаздары	3	0
ҚР эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздары, оның ішінде:	21 423	56,2
акциялар	11 537	30,3
облигациялар	9 886	25,9
Шетелдік эмитенттердің мемлекеттік емес бағалы қағаздары, оның ішінде:	5 984	15,7
акциялар	1 739	4,6
облигациялар	4 245	11,1
Инвестициялық қорлардың пайлары	2 480	6,5
Туынды қаржы құралдары	0	0
"Кері РЕПО" операциялары	288	0,8
Жиынтығы:	38 115	100

2010 жылғы 1 шілдедегі жағдай бойынша бағалы қағаздар нарығына кәсіби қатысушылардың жиынтық инвестициялық портфелі 38 115 млн. теңге болды. Портфель құрылымындағы ең көп үлесті ҚР эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздары иеленеді – 56,2%. ҚР мемлекеттік бағалы қағаздары – 15,7% құрады, шетел эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздары 15,7%-ды құрайды.