

Қазақстан Республикасының бағалы қағаздар нарығының

2010 жылғы 1 қазандағы ағымдағы жағдайы

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

	1.10.09ж.	1.01.10ж.	1.04.10ж.	1.07.10ж.	1.10.10ж.
Оның ішінде барлық брокерлер-дилерлер:	86	83	83	81	78
банктер	24	24	24	24	24
олардың I -санаттағысы	22	22	22	22	22
банктік емес ұйымдар	53	53	53	52	49
олардың I -санаттағысы	44	44	44	42	41
АӨҚО қатысушылары	9	6	6	5	5
Тіркеушілер	12	12	11	11	10
Кастодиандар	11	11	11	11	10
ЖЗҚ зейнетақы активтерін инвестициялық басқарушылар	14	14	14	16	15
Инвестициялық портфельді басқарушылар, оның ішінде:	54	49	49	49	43
инвестициялық компаниялар	3	2	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 үшінші тоқсанда бағалы қағаздар нарығындағы қызметті жүзеге асыру құқығына 6 лицензия, оның ішінде: номиналды ұстаушы ретінде клиенттер шоттарын жүргізу құқығымен брокерлік және дилерлік қызметті жүзеге асыруға 1 лицензия («NTC-New Trust Company» АҚ), инвестициялық портфельді басқаруға 4 лицензия («Дельта-инвест» басқарушы компаниясы» АҚ, «NTC-New Trust Company» АҚ, "Premier Capital" АҚ, «Prime Financial Solutions» АҚ) және бағалы қағаздар ұстаушылардың тізілім жүйесін жүргізу жөніндегі қызметпен айналысуға 1 лицензия ("Паритет-Регистр" АҚ) берілді. Сондай-ақ есепті кезеңде 1 ұйым («ЦентрИнвест» Инвестментс Компаниясы» АҚ) бағалы қағаздар нарығында номиналды ұстаушы ретінде клиенттер шоттарын жүргізу құқығымен брокерлік және дилерлік қызметті жүзеге асыруға және 1 ұйым («Өрлеу» ЗАИБЖАҰ» АҚ) зейнетақы активтерін басқару жөніндегі қызметті; клиенттер шоттарын жүргізу құқығынсыз бағалы қағаздар нарығында брокерлік және дилерлік қызметті жүргізуге; инвестициялық портфельді басқару жөніндегі қызметті жүзеге асыруға берілген лицензиясынан айырылды.

(млн. теңге)

	1.07.10ж.	1.10.10ж.	2010 жылғы 3-тоқсандағы өзгеруі, %-бен
Жиынтық активтер, оның ішінде*:	150 703	166 124	10,2
брокерлер-дилерлер	4 603	5 641	22,6
брокерлер-дилерлер (АӨҚО қатысушылары)	935	950	1,6
Тіркеушілер	1 213	1 148	-5,4
ИПБ	100 130	114 250	14,1
инвестициялық компаниялар	35 799	36 063	0,7
ЗАИБЖАҰ	8 023	8 072	0,6
Міндеттемелер, оның ішінде:	30 336	31 483	3,8
брокерлер-дилерлер	571	743	30,1
брокерлер-дилерлер (АӨҚО қатысушылары)	22	21	-4,5
тіркеушілер	47	52	10,6
ИПБ	18 003	21 876	21,5

* ЕДБ қоспағанда қаржылық көрсеткіштер бойынша ақпарат

инвестициялық компаниялар	9 574	8 519	-11
ЗАИБЖАҰ	2 119	272	-87,2
Капитал, оның ішінде:	120 367	134 641	11,9
брокерлер-дилерлер	4 032	4 898	21,5
брокерлер-дилерлер (АӨҚО қатысушылары)	913	929	1,8
тіркеушілер	1 166	1 096	-6
ИПБ	82 127	92 374	12,5
инвестициялық компаниялар	26 225	27 544	5
ЗАИБЖАҰ	5 904	7 800	32,1
жарғылық капитал, оның ішінде:	114 245	114 334	0,1
брокерлер-дилерлер	2 547	3 346	31,4
брокерлер-дилерлер (АӨҚО қатысушылары)	1 057	1 057	-
Тіркеушілер	1 182	1 109	-6,2
ИПБ	79 168	78 786	-0,5
инвестициялық компаниялар	20 916	20 916	-
ЗАИБЖАҰ	9 375	9 120	-2,7

Эмитенттер және қаржы құралдары

Акциялар шығарылымы және шығарылымдарды жою туралы деректер

	2009 жылғы 3-тоқсанда	2009 жылғы 4-тоқсанда	2010 жылғы 1-тоқсанда	2010 жылғы 2-тоқсанда	2010 жылғы 3-тоқсанда
Шығарылымдар тіркелді	14	16	10	7	12
Шығарылым және орналастыру қорытындысы туралы есептер бекітілді	180	180	178	144	180
Шығарылымдар жойылды	46	32	15	21	17

Есепті күнде қолданыстағы акциялар шығарылымының жалпы саны 2 169 құрады. 2010 жылғы үшінші тоқсанда 190 акциялар шығарылымы (оның ішінде шығарылымдар проспектілеріне енгізілген өзгерістер) тіркелді, акциялардың шығарылымы және орналастыру қорытындысы туралы 180 есеп бекітілді, сондай-ақ 17 акциялар шығарылымы жойылды.

Тіркелген мемлекеттік емес облигациялар шығарылымы туралы деректер

	2009 жылғы 3- тоқсанда	2009 жылғы 4- тоқсанда	2010 жылғы 1- тоқсанда	2010 жылғы 2- тоқсанда	2010 жылғы 3- тоқсанда
Шығарылымдар саны	11	13	6	5	9
Шығарылымдар көлемі, млн. теңгемен	874 583	296 400	92 000	317 850	402 515

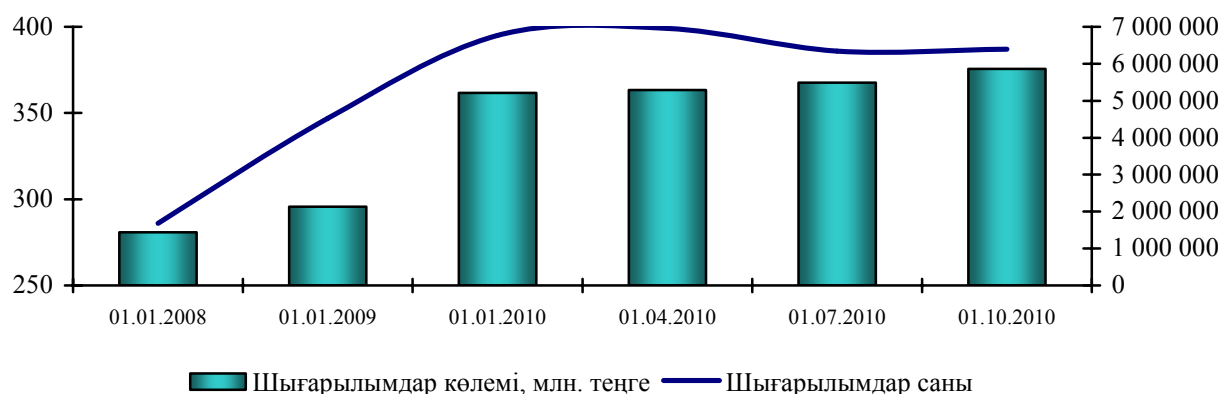
Агенттік 2010 жылғы үшінші тоқсан ішінде жалпы көлемі 402 515 млн. теңгемен мемлекеттік емес облигациялардың 9 шығарылымын тіркеді.

Мемлекеттік емес облигациялардың қолданыстағы шығарылымы туралы деректер

	2009 жылғы 1 қазанда	2010 жылғы 1 қаңтарда	2010 жылғы 1 сәуірде	2010 жылғы 1 шілдеде	2010 жылғы 1 қазанда
Шығарылымдар саны	387	395	399	386	387
Шығарылымдар көлемі, млн. теңгемен	4 935 108	5 216 267	5 289 461	5 488 811	5 860 836

2010 жылғы 1 қазандағы жағдай бойынша жиынтық номиналды құны 5 860 836 млн. теңгені құрайтын қолданыстағы облигациялар шығарылымының саны 387 болды, олардың ішінде рейтингтік бағасы бар 71 шығарылымы, 111 шығарылымы – бірінші шағын санаттың рейтингтік бағасы жоқ, 33 шығарылымы – екінші шағын санаттың рейтингтік бағасы жоқ және 40 шығарылымы – буферлік санатты KASE ресми тізіміне енгізілген.

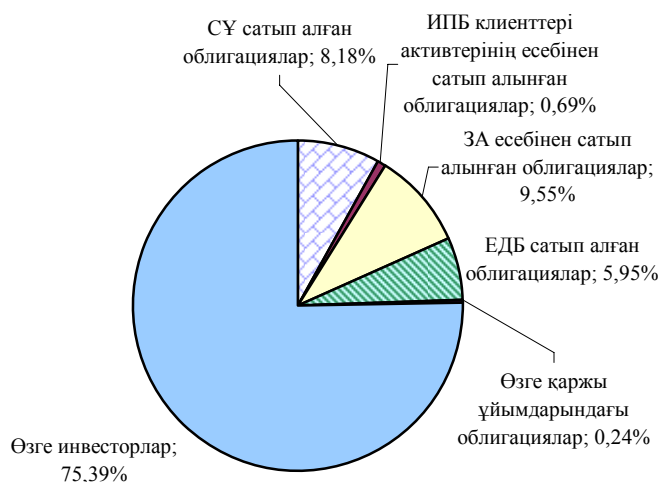
Қолданыстағы облигациялар шығарылымдарының саны мен көлемінің өзгеру динамикасы



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

- зейнетақы активтері есебінен сатып алынған облигациялар – 9,55%;
- екінші деңгейдегі банктер сатып алған облигациялар – 5,95%;
- инвестициялық портфельді басқарушы клиенттердің активтері есебінен сатып алынған облигациялар – 0,69%;
- сақтандыру (қайта сақтандыру) ұйымдары сатып алған облигациялар – 8,18%;
- өзге қаржы ұйымдары сатып алған облигациялар – 0,24%;
- өзге инвесторлар – 75,39%.

1.10.2010 ҚР корпоративті облигацияларының қолданыстағы шығарылымдарының жиынтық көлеміндегі инвесторлармен сатып алынған облигациялар үлесі



ҚР корпоративтік облигацияларының қолданыстағы шығарылымдарының жиынтық көлеміндегі 75,4%-ы кәсіби емес инвесторлардың үлесіне тиеді. Институционалды инвесторлар—облигацияларды ұстаушылардың (ИПБ клиенттерінің активтері және ЗА) Қазақстан Республикасының аумағында шығарылған облигациялардың жалпы көлеміндегі үлес салмағы 10,24% болды.

Тіркелген пайлар шығарылымдары туралы деректер

	2009 жылғы 3-тоқсанда	2009 жылғы 4-тоқсанда	2010 жылғы 1-тоқсанда	2010 жылғы 2-тоқсанда	2010 жылғы 3-тоқсанда

Шығарылымдар тіркелді	3	16	4	0	3
Шығарылым және орналастыру қорытындысы туралы есептер бекітілді	42	43	32	32	23
Қолданыстағы шығарылымдар	176	182	181	171	168

2010 жылғы 1 қазанда қолданыстағы пайлар шығарылымының саны 168 болды. Бұл ретте 2010 жылғы шілде-қыркүйек айларында шығарылым мен орналастыру қорытындылары туралы 23 есеп бекітілді және 5 шығарылым өтелді.

Қазақстан Республикасының аумағында айналыста болатын мемлекеттік бағалы қағаздар*

	(млн. теңге)				
	2009 жылғы 1 қазанда	2010 жылғы 1 қаңтарда	2010 жылғы 1 сәуірде	2010 жылғы 1 шілдеде	2010 жылғы 1 қазанда
Айналыста барлығы, оның ішінде:	1 299 549	1 761 527	2 336 020	2 488 709	2 649 062
Ұлттық Банктің ноттары	180 213	473 292	963 346	990 258	1 014 378
Қаржы министрлігінің бағалы қағаздары	1 119 336	1 288 235	1 372 674	1 498 451	1 634 684
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.

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

KASE сауда-саттығына жіберілген бағалы қағаздар

	шығарылым саны	эмитенттер саны
"Акциялар" секторы:	98	72
"Борыштық бағалы қағаздар" секторы:	255	81
"Инвестициялық қорлардың бағалы қағаздары" секторы:	2	2
"Депозитарлық қолхаттар" секторы:	0	0
"Халықаралық қаржы ұйымдарының бағалы қағаздары" секторы:	1	1
"Мемлекеттік бағалы қағаздар" секторы:	165	3
"Туынды бағалы қағаздар" секторы:	0	0
"Баламалы алаң"	0	0
Жиынтығы:	521	124

KASE айналымын жіберілген бағалы қағаздардың негізгі үлес салмағы борыштық бағалы қағаздарға – 48,9% (255 шығарылым) келеді. Акциялар және мемлекеттік бағалы қағаздары секторы бойынша 18,8% (98 шығарылым) және тиісінше 31,7% (165 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.

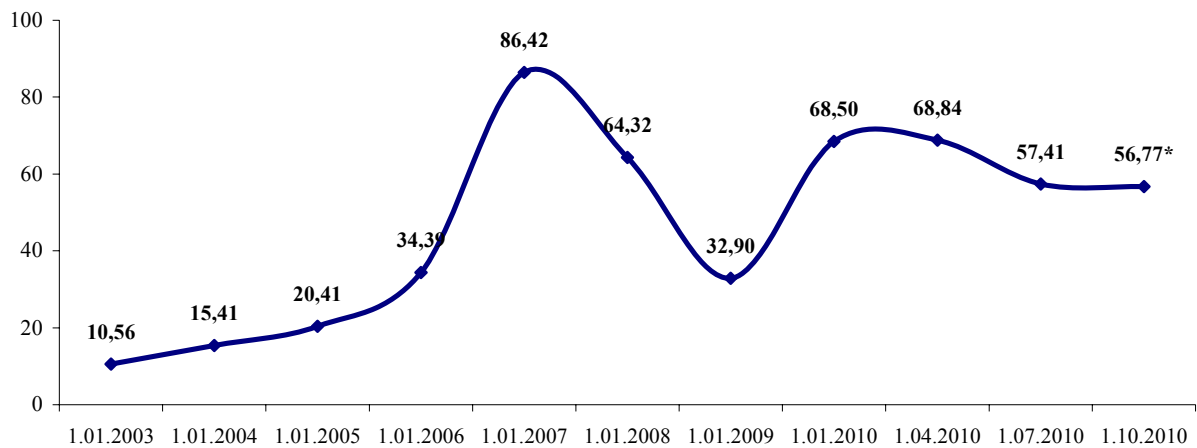
KASE жалпы капиталдандыру 10 958 072 млн. теңгені немесе ЖІӨ-ден 56,8% құрады. 2010 жылғы 1 шілдедегі жағдай бойынша осындай көрсеткіш 11 081 475 млн. теңгені немесе ЖІӨ-ден 57,4% құрады. Осылайша, қор нарығын капиталдандырудың

* Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкінің деректері бойынша ұсынылған ақпарат

** Биржа нарығы жөніндегі ақпарат KASE деректері бойынша ұсынылған

абсолюттік көріністегі көбеюі де, сондай ЖІӨ-ге қатысты қор нарығын капиталдандыру көрсеткішінің көбеюі де байқалады.

ЖІӨ-ге KASE-нің капиталдандырылуы *



* Қазақстан Республикасы Экономикалық даму және сауда министрлігінің ресми сайтынан алынған деректер (19 303,6 млрд. теңге)

KASE-дегі мемлекеттік емес бағалы қағаздармен жасалған мәмілелер көлемі

(млн. теңге)

	2009 жылғы 4-тоқсанда	2010 жылғы 1-тоқсанда	2010 жылғы 2-тоқсанда	2010 жылғы 3-тоқсанда
бастапқы орналастыру:	415 597	5 450	1 885	78 184
– "Акциялар" секторы бойынша	414 304	4 569	1 885	14 315
– "Борыштық бағалы қағаздар" секторы бойынша	1 293	881	0	63 869
– "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:	115 964	49 958	66 212	48 171
– "Акциялар" секторы бойынша	33 659	6 525	19 634	12 088
– "Борыштық бағалы қағаздар" секторы бойынша	82 304	43 284	46 517	36 083
– "Инвестициялық қорлардың бағалы қағаздары" секторы бойынша	1	0	41	0
– "Депозитарлық қолхаттар" секторы бойынша	0	0	0	0
– "Халықаралық қаржы ұйымдарының бағалы қағаздары" секторы бойынша	0	149	20	0
– "Туынды бағалы қағаздар" секторы бойынша	0	0	0	0
"Листингтік емес бағалы қағаздар" секторы	183	47	82	49
"репо" мәмілелері:	174 957	69 581	66 250	51 591
– "Акциялар" секторы бойынша	55 387	38 963	35 571	36 416
– "Борыштық бағалы қағаздар" секторы бойынша	119 288	30 618	30 679	15 175
– "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
– "Листингтік емес бағалы қағаздар" секторы	282	0	0	0
Жиынтығы	706 701	125 036	134 429	177 995

Кестеде келтірілген деректерден көрініп отырғандай, 2010 жылдың үшінші тоқсанында мемлекеттік емес бағалы қағаздармен жасалған мәмілелер көлемі 32,4%-ға ұлғайды.

КASE-дегі мемлекеттік бағалы қағаздармен жасалған мәмілелер көлемі

(млн. теңге)

	2009 жылғы 3-тоқсанда	2009 жылғы 4-тоқсанда	2010 жылғы 1-тоқсанда	2010 жылғы 2-тоқсанда	2010 жылғы 3-тоқсанда
Мәмілелер көлемі, оның ішінде:	4 869 825	4 381 842	6 318 550	7 151 154	6 419 236
бастапқы орналастырулар	212 705	220 697	156 580	177 759	224 639
"репо" мәмілелері	4 410 550	3 947 068	5 909 085	6 804 339	6 034 153

Ағымдағы жылдың 3-тоқсанында ұйымдасқан нарықтағы мемлекеттік бағалы қағаздар бойынша жасалған биржалық мәмілелер көлемі 10,2%-ға төмендеді. Бастапқы орналастырулар көлемі 26,4%-ға ұлғайды. Мемлекеттік бағалы қағаздармен жасалған мәмілелердің жалпы көлеміндегі "репо" мәмілесінің үлесі 11,3%-ға азайды.

КASE капиталдандырылуының өзгеру динамикасының

(млн.теңге)

Ресми тізім секторы	2010 жылғы 1 қазанда	2010 жылғы 1 қаңтарда	2010 жылғы 1 сәуірде	2010 жылғы 1 шілдеде	2010 жылғы 1 қазанда
"Акциялар" секторы:	7 722 635	8 506 238	9 303 430	7 323 426	8 010 139
"Борыштық бағалы қағаздар" секторы	1 852 884	3 141 659	3 981 867	3 756 270	2 946 154
"Инвестициялық қорлардың бағалы қағаздары" секторы	2 981	2 981	2 981	1 779	1 779
"Депозитарлық колхаттар" 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	9 578 500	11 650 878	13 288 278	11 081 475	10 958 072

Кестеде келтірілген деректерден көрініп отырғандай, КASE ресми тізіміне кіргізілген мемлекеттік емес бағалы қағаздар бойынша нарықты жалпы капиталдандыру 2010 жылғы 1 қазандағы жағдай бойынша 2010 жылғы 1 шілдедегі көрсеткішпен салыстарғанда 1,1%-ға төмендеді.

Бағалы қағаздар нарығындағы инвесторлар Инвестициялық басқарудағы зейнетақы активтері

2010 жылғы 1 қазандағы жағдай бойынша ЗАИБЖАҰ-ның инвестициялық басқаруындағы зейнетақы активтерінің жиынтық көлемі 2010 жылдың үшінші тоқсанында 111,3 млрд. теңгеге немесе 5,5%-ға өсіп, 2 129,8 млрд. теңге болды.

Зейнетақы активтерінің орташа айлық өсімі 2009 жылғы 1 қазаннан бастап 2010 жылғы 1 қазанға дейінгі кезеңде 31,3 млрд. теңге болды.

Зейнетақы активтерінің жиынтық көлемін бөлу

ЗАИБЖАҰ / НПФ	зейнетақы активтері	
	млн. теңге	%-бен
«Қазақстан Халық Банкі» АҚ еншілес ұйымы «Қазақстан Республикасы Халық Банкінің жинақтаушы зейнетақы қоры» АҚ	665 958	31,27
"ГНПФ "Жинақтаушы зейнетақы қоры" АҚ	350 571	16,46
"Жетісу" ЗАИБЖАҰ" АҚ	345 129	16,20
"ҰларҮміт "Жинақтаушы зейнетақы қоры" АҚ	298 248	14,00
"АМАНАТ ҚАЗАҚСТАН жинақтаушы зейнетақы қоры " АҚ	46 881	2,20
«БТА Қазақстан» Жинақтаушы зейнетақы қоры «БТА Банкі» АҚ еншілес ұйымы» АҚ	178 516	8,38
"GRANTUM Asset Management" ЗАИБЖАҰ" АҚ («Казкоммерцбанк» АҚ еншілес ұйымы АҚ)»	140 045	6,58
"ГРАНТУМ Жинақтаушы зейнетақы қоры" АҚ («Казкоммерцбанк» АҚ еншілес ұйымы АҚ)	140 045	6,58
«Банк ЦентрКредит» АҚ еншілес ұйымы» - «Капитал» ЖЗҚ» АҚ	103 255	4,85
"Мұнайгаз - Дем" жинақтаушы зейнетақы қоры" АҚ	73 149	3,43
«Еуразиялық жинақтаушы зейнетақы қоры» АҚ	70 760	3,32
"Нұр-Траст" ЗАИБЖАҰ" АҚ, "Нұрбанк" АҚ еншілес ұйымы	64 243	3,02
"Нұрбанк" АҚ еншілес ұйымы "Атамекен" жинақтаушы зейнетақы қоры" АҚ	64 243	3,02
"Отан" ашық жинақтаушы зейнетақы қоры" АҚ	59 107	2,78
"РЕСПУБЛИКА жинақтаушы зейнетақы қоры" АҚ	55 432	2,60
"Қазақмыс жинақтаушы зейнетақы қоры" АҚ	23 684	1,11
Барлық ЖЗҚ бойынша жиынтығы	2 129 849	100

2010 жылдың үшінші тоқсанында инвестицияланған зейнетақы активтерінің көлемі 117,4 млрд. теңгеге немесе 5,9%-ға өсіп, 2010 жылғы 1 қазанда 2 098,6 млрд. теңге болды.

Жинақтаушы зейнетақы қорларының инвестициялық портфеліндегі ҚР эмитенттерінің мемлекеттік бағалы қағаздарының үлесі инвестицияланған зейнетақы активтерінің жалпы көлемінен (954,6 млрд. теңге) 45,5%-ды құрайды және 2010 жылғы 1 шілдедегі жағдай бойынша осындай көрсеткішке қатысты 11,6%-ға немесе 99,1 млрд. теңгеге өсті. Мемлекеттік емес бағалы қағаздардың үлесі 2010 жылғы 1 қазандағы жағдай бойынша инвестицияланған зейнетақы активтерінің жалпы көлемінен (717,1 млрд. теңге) 34,2%-ды құрады.

ЖЗҚ-ның жиынтық инвестициялық портфелі

Қаржы құралдары	1.07.2010ж.		1.10.2010ж.	
	млн. теңге	%	млн. теңге	%
ҚР мемлекеттік бағалы қағаздары, оның ішінде	855 544	43,18	954 620	45,49
Қаржы министрлігінің бағалы қағаздары	742 087	37,45	830 328	39,56
Ұлттық Банктің ноттары	113 457	5,73	124 162	5,92
жергілікті атқарушы органдарының бағалы қағаздары	0	0	130	0,01
Шетелдік эмитенттердің мемлекеттік емес бағалы қағаздары	196 048	9,90	191 315	9,11
акциялар	40 626	2,05	43 665	2,08
облигациялар	155 422	7,85	147 649	7,03
Шетелдік инвестициялық қорлардың пайлары			0	0,00
Халықаралық қаржы ұйымдарының бағалы қағаздары	40 807	2,06	42 551	2,03
Шетелдік эмитенттердің мемлекеттік бағалы қағаздары	78 127	3,94	41 357	1,97
Тазартылған алтын	16 445	0,83	24 956	1,19
ҚР эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздары, оның ішінде	664 385	33,53	717 088	34,17
акциялар	179 497	9,06	178 467	8,50

облигациялар оның ішінде:	484 888	24,47	538 621	25,67
шетелдік валютада номинирленген	26 034	1,31	54 438	2,60
теңгемен номинирленген	458 854	23,16	484 184	23,07
Екінші деңгейдегі банктердегі салымдар	130 521	6,59	127 322	6,07
Туынды бағалы қағаздар	-666	-0,03	-603	-0,03
Жиынтығы	1 981 211	100	2 098 606	100

Қазақстан Республикасының екінші деңгейдегі банктеріндегі салымдар көлемі 2010 жылғы үшінші тоқсанда 2,5%-ға азайып, 127,3 млрд. теңге болды.

ҚР эмитенттері техникалық дефолтқа жол берген, жинақтаушы зейнетақы қорларының инвестициялық портфеліндегі мемлекеттік емес борыштық бағалы қағаздардың үлесі 2010 жылғы 1 қазанда зейнетақы активтерінің жалпы көлемінің 3,9%-ын құрады, бұл абсолютті мән бойынша 83,4 млрд. теңге болды.

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

Қаржы құралдары	млн. теңге	жиынтыққа, %-бен
ҚР мемлекеттік бағалы қағаздары, оның ішінде:	39 654	57,89
ҚР еурооблигациялары	0	0
Қаржы министрлігінің бағалы қағаздары	36 232	52,89
Ұлттық Банктің ноттары	3 422	5,00
жергілікті атқарушы органдардың бағалы қағаздары	0	0
Екінші деңгейдегі банктердегі салымдар	13 624	19,89
Халықаралық қаржы ұйымдарының бағалы қағаздары	0	0
Шетелдік эмитенттердің мемлекеттік бағалы қағаздары	0	0
Шетелдік инвестициялық қорлардың пайлары	0	0
ҚР эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздары, оның ішінде:	9 551	13,94
акциялар	1 773	2,59
облигациялар	7 778	11,35
Шетелдік эмитенттердің мемлекеттік емес бағалы қағаздары, оның ішінде:	2 310	3,37
акциялар	1 187	1,73
облигациялар	1 123	1,64
"Кері РЕПО" операциялары	3 365	4,91
Жиынтығы:	68 504	100

2010 жылғы 1 қазанда жинақтаушы зейнетақы қорларының жиынтық меншікті портфеліндегі ең көп көлемді ҚР мемлекеттік емес бағалы қағаздары алады – 39 654 млн. теңге (57,89%). Бұл ретте меншікті активтер портфелінің 19,89%-ы екінші деңгейдегі банктердің салымдарына орналастырылған. ҚР эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздарының үлесі 13,94% құрады.

Инвестициялық қорлардың саны

	1.10.2009	1.01.2010	1.04.2010	1.07.2010	1.10.2010
Инвестициялық пай қорларының саны, оның ішінде	176	182	181	171	168
ашық	17	16	16	15	15
жабық	136	143	140	131	129
аралық	23	23	25	25	24
Акционерлік инвестициялық қорлардың саны	42	41	39	35	34

Инвестициялық пай қорлары пайшыларының саны

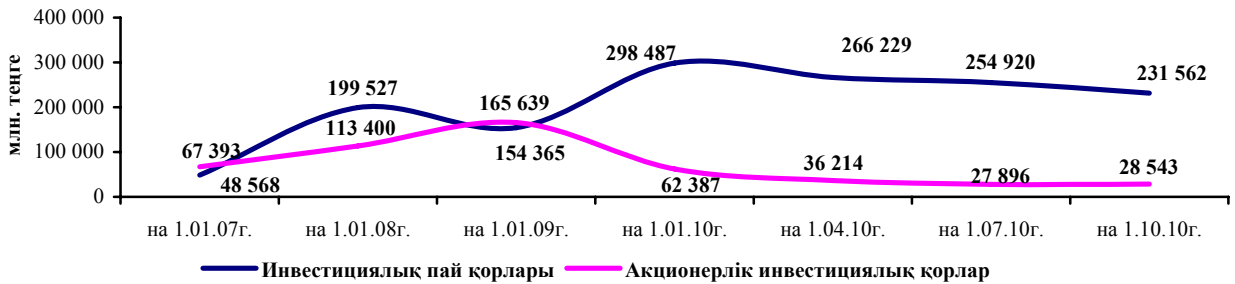
	1.07.2010	1.10.2010
Инвестициялық пай қорлары пайшыларының саны, оның ішінде	2 406	1 960
Заңды тұлғалар	86	82
Жеке тұлғалар	2 320	1 878

2010 жылғы 1 қазандағы инвестициялық қорлар активтері

2010 жылғы 1 қазандағы жағдай бойынша инвестициялық пай қорының және акционерлік инвестициялық қорлардың жиынтық активтері 231 562 млн. теңге және сәйкесінше 28 543 млн. теңге болды. 2010 жылғы 3-тоқсанда инвестициялық пай қорларының активтері 9,2%-ға азайды, акционерлік инвестициялық қорлардың активтері 2,3%-ға көбейді.

	(млн. теңге)				
	2009 жылғы 1 қазанда	2010 жылғы 1 қантарда	2010 жылғы 1 сәуірде	2010 жылғы 1 шілдеде	2010 жылғы 1 қазанда
Инвестициялық пай қорлары	305 601	298 488	266 229	254 920	231 562
ашық	302 691	295 616	263 201	252 316	228 934
жабық	680	832	865	816	823
аралық	2 230	2040	2 163	1 788	1 805
Акционерлік инвестициялық қорлар	59 090	62 387	36 214	27 896	28 543

Инвестициялық қорлар активтерінің өзгеру динамикасы



2010 жылғы 1 қазандағы инвестициялық қорлардың жиынтық инвестициялық портфелі

Қаржы құралдары	(млн. теңге)			
	Инвестициялық пай қорлары		Акционерлік инвестициялық қорлар	
	млн. теңге	жиынтығына, %-бен	млн. теңге	жиынтығына, %-бен
ҚР мемлекеттік бағалы қағаздары, оның ішінде:	502	0,22	13	0,05
ҚР еурооблигациялары	0	0	0	0
Қаржы министрлігінің бағалы қағаздары	442	0,19	13	0,05
Ұлттық Банктің ноттары	60	0,03	0	0
жергілікті атқарушы органдардың бағалы қағаздары	0	0	0	0
Екінші деңгейдегі банктердегі салымдар	22 830	9,86	396	1,39

	10			
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:	16 387	7,08	3 463	12,13
акциялар	9 142	3,95	328	1,15
облигациялар	7 245	3,13	3 135	10,98
Шетелдік эмитенттердің мемлекеттік емес бағалы қағаздары, оның ішінде:	2 251	0,97	313	1,09
акциялар	1 844	0,80	21	0,07
облигациялар	407	0,17	292	1,02
Инвестициялық қорлардың пайлары	10	0	154	0,54
Депозитарлық қолхаттар	457	0,20	133	0,47
"Кері РЕПО" операциясы	598	0,26	46	0,16
Жер учаскелері	6 812	2,94	1 616	5,66
Үйлер мен ғимараттар	11 712	5,06	12 591	44,11
Жылжымайтын мүліктің салынып жатқан және қайта құрастырылып жатқан объектілері	5 789	2,50	6 111	21,41
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	156 553	67,61	890	3,12
Туынды қаржы құралдары	0	0	0	0
Өзге активтер/ дебиторлық берешек	7 661	3,30	2 817	9,87
Жиынтығы:	231 562	100	28 543	100

Инвестициялық пай және акционерлік қорларының жиынтық инвестициялық портфеліндегі негізгі үлесті өзге мүлік (акционерлік қоғам болып табылмайтын заңды тұлғалардың капиталындағы инвестициялық қорлардың инвестициялары, жер учаскелері, үйлер мен ғимараттар, жылжымайтын мүліктің салынып жатқан және қайта құрастырылып жатқан объектілері, жобалық-сметалық құжаттамалар, жерді пайдалану және жер қойнауын пайдалану құқықтары) 78,1% (180,9 млрд.теңге) және тиісінше 74,3% (21,2 млрд.теңге) иеленеді.

ҚР эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздары инвестициялық пай қорларының инвестициялық портфелінде 7,1%, акционерлік инвестициялық қорлар портфелінде – 12,1%-ды иеленіп отыр. Шетел эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздарының ИПҚ-ның жиынтық портфеліндегі үлесі қомақты емес – 2,0% болса, АИҚ-ның портфелінде - 1,1% болды.

2010 жылғы 1 қазандағы екінші деңгейдегі банктердің инвестициялық портфелінің құрылымы

Қаржы құралдары	млн. теңге	жиынтығында %-бен
ҚР мемлекеттік бағалы қағаздары, оның ішінде:	1 246 943	73,5
ҚР Ұлттық Банктің ноттары	824 496	48,6
ҚР Қаржы министрлігінің бағалы қағаздары	422 447	24,9
Халықаралық қаржы ұйымдарының бағалы қағаздары	42 838	2,5
Шет мемлекеттердің бағалы қағаздары	23 825	1,4
ҚР эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздары, оның ішінде:	277 103	16,3
акциялар	48 688	2,9
облигациялар	228 415	13,4

Шетелдік эмитенттердің мемлекеттік емес бағалы қағаздары, оның ішінде:	107 540	6,3
акциялар	1 547	0,1
облигациялар	105 993	6,2
Жиынтығы:	1 698 249	100

ЕДБ портфелінің қомақты үлесін ҚР мемлекеттік бағалы қағаздары құрайды – 73,5% немесе 1 246 943 млн. теңге. ҚР эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздарының үлесіне 16,3%-ы келеді. Шетел эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздары жиынтық портфельдің 4,3%-ын, шет мемлекеттердің бағалы қағаздары – 1,7%-ын құрайды.

2010 жылғы 1 қазандағы сақтандыру ұйымдарының инвестициялық портфелінің құрылымы

Қаржы құралдары	млн. теңге	жиынтығында %-бен
ҚР мемлекеттік бағалы қағаздары, оның ішінде:	51 029	21,92
- ҚР еурооблигациялары	0	0,00
- Қаржы министрлігінің бағалы қағаздары	43 459	18,67
- Ұлттық Банктің ноттары	7 570	3,25
- жергілікті атқарушы органдарының бағалы қағаздары	0	0
Екінші деңгейдегі банктердегі салымдар	74 667	32,08
Халықаралық қаржы ұйымдарының бағалы қағаздары	5 497	2,36
Инвестициялық қорлардың пайлары	151	0,06
Шет мемлекеттердің бағалы қағаздары	5 777	2,48
ҚР эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздары, оның ішінде:	75 200	32,31
- акциялар	8 712	3,74
- облигациялар	66 487	28,56
Шетелдік эмитенттердің мемлекеттік емес бағалы қағаздары, оның ішінде:	13 959	6,00
- акциялар	4 216	1,81
- облигациялар	9 744	4,19
"Кері РЕПО" операциялары	6 496	2,79
Жиынтығы:	232 776	100,00

Есепті күнге сақтандыру ұйымдарының жиынтық инвестициялық портфелінің көлемі 232 776 млн. теңге болды. Бұл ретте екінші деңгейдегі банктердегі салымдарға - 32,08%, ҚР эмитенттерінің корпоративті бағалы қағаздарына – 32,31%, Қазақстан Республикасының мемлекеттік бағалы қағаздарының үлесіне 21,92%-дан келеді.

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

Қаржы құралдары	млн. теңге	жиынтығында %-бен
ҚР мемлекеттік бағалы қағаздары, оның ішінде:	8 650	20,7
ҚР еурооблигациялары	0	0,0
Қаржы министрлігінің бағалы қағаздары	7 864	18,8
Ұлттық Банктің ноттары	786	1,9
жергілікті атқарушы органдарының бағалы қағаздары	0	0,0
Екінші деңгейдегі банктердегі салымдар	2 516	6,0
Халықаралық қаржы ұйымдарының бағалы қағаздары	194	0,5
Шетелдік эмитенттердің мемлекеттік бағалы қағаздары	3	0,0
ҚР эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздары, оның ішінде:	22 486	53,6

акциялар	12 730	30,4
облигациялар	9 756	23,3
Шетелдік эмитенттердің мемлекеттік емес бағалы қағаздары, оның ішінде:	5 960	14,2
акциялар	1 768	4,2
облигациялар	4 192	10,0
Инвестициялық қорлардың пайлары	2 025	4,8
Туынды қаржы құралдары	0	0,0
"Кері РЕПО" операциялары	79	0,2
Жиынтығы:	41 913	100

2010 жылғы 1 қазандағы жағдай бойынша бағалы қағаздар нарығына кәсіби қатысушылардың жиынтық инвестициялық портфелі 41 913 млн. теңге болды. Портфель құрылымындағы ең көп үлесті ҚР эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздары иеленеді – 53,6%. ҚР мемлекеттік бағалы қағаздары – 20,7% құрады, шетел эмитенттерінің мемлекеттік емес бағалы қағаздары 14,2%-ды құрайды.